

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告

2016年6月30日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2016年8月24日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年1月13日起至2016年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
§4 管理人报告 .....	8
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	11
§5 托管人报告 .....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	11
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 .....	11
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计） .....	11
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
§7 投资组合报告 .....	40
7.1 期末基金资产组合情况 .....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	70
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	70
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	70
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	70
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
7.12 投资组合报告附注 .....	71
§8 基金份额持有人信息 .....	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	72
§9 开放式基金份额变动 .....	73
§10 重大事件揭示 .....	73
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	73

10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	73
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	73
10.4	基金投资策略的改变 .....	73
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	74
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	74
10.8	其他重大事件 .....	76
§11	备查文件目录 .....	78
11.1	备查文件目录 .....	78
11.2	存放地点 .....	78
11.3	查阅方式 .....	78

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中欧数据挖掘混合
基金主代码	001990
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年1月13日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	291,712,269.26份
基金合同存续期	不定期

### 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	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
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	姓名	黎忆海
	联系电话	021-68609600
		洪渊
		010-66105799

人	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333号东方汇经大 厦五层	北京市西城区复兴门内大街 55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号东方汇经大 厦五层	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	易会满

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中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333号东方汇经大厦五层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日）
本期已实现收益	11,906,181.77

本期利润	24,061,110.71
加权平均基金份额本期利润	0.0564
本期加权平均净值利润率	5.60%
本期基金份额净值增长率	5.80%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	10,045,149.45
期末可供分配基金份额利润	0.0344
期末基金资产净值	308,535,705.76
期末基金份额净值	1.058
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	5.80%

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。

4、本基金合同于2016年1月13日生效。

### 3.2 基金净值表现

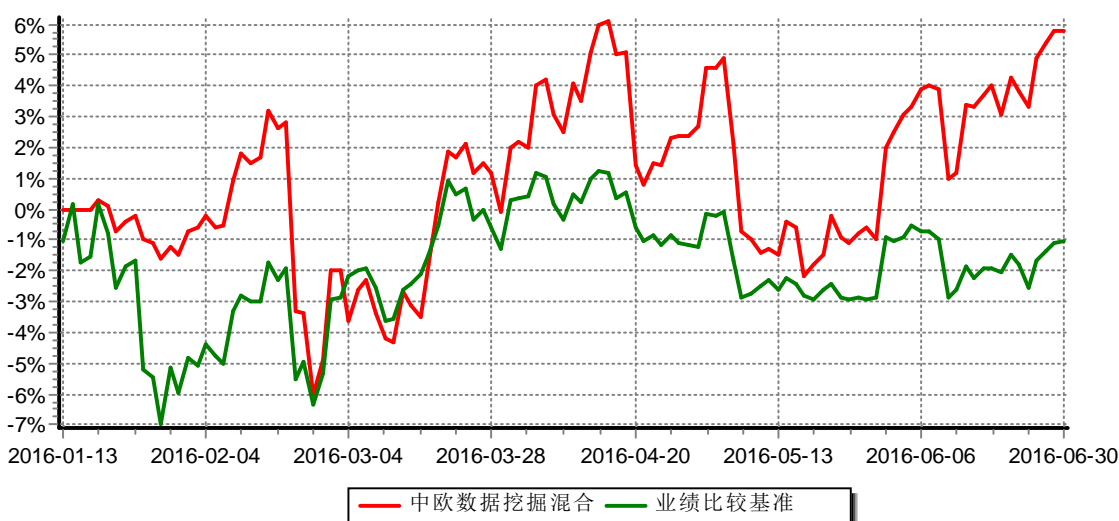
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.73%	0.98%	-0.13%	0.59%	3.86%	0.39%
过去三个月	3.52%	1.15%	-1.33%	0.61%	4.85%	0.54%
自基金合同生效日起至今	5.80%	1.22%	-1.01%	0.94%	6.81%	0.28%

注：本基金业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%，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

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金  
基金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1月13日-2016年6月30日)



注：本基金基金合同生效日期为2016年1月13日，自基金合同生效日起到本报告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例应当符合基金合同的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、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，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2016年6月30日，本基金管理人共管理40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	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----



		理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
曲径	基金经 理,事业 部负责 人	2016年1月 13日	—	9年	历任千禧年基金量化基金 经理, 中信证券股份有限 公司另类投资业务线高级 副总裁。2015年4月加入中 欧基金管理有限公司, 现 任事业部负责人, 中欧沪 深300指数增强型证券投 资基金 (LOF) 基金经理, 中欧数据挖掘多因子灵活 配置混合型证券投资基金 基金经理。

注: 1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日; 若该基金经理自基金合同生效日起即任职, 则任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、本基金基金合同和其他相关法律法规的规定, 本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定, 无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定, 从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关, 通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。在公平交易稽核审计过程中, 针对投资组合间同向交易价差出现异常的情况, 我们分别从交易动机、交易时间间隔、交易时间顺序、指令下达明细等方面进行了进一步深入分析, 并与基金经理进行了沟通确认, 从最终结果看, 造成同向价差的原因主要在于各基金所遇申赎时点不同、股价波动等不可控因素, 基金经理已在其可控范围内尽力确保交易公平, 未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价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%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场经历了A股市场经历了熔断暴跌，底部振荡，和小幅反弹三个阶段；二季度大盘筑底企稳，经过一季度的大幅震荡后，整体波动率明显下降，不同行业收益分化较大，业绩好成长性预期强的行业，如新能源车产业链等板块有结构化行情。在报告期内，我们依据量化模型的预测逐步建仓；在结构化行情中，量化模型配置的热点板块及其价值洼地，在窄幅振荡的市场中获得了稳定的超额收益，覆盖板块包括智能制造、白酒、有色、新能源车等。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为5.80%，同期业绩比较基准增长率为-1.01%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度，我们认为人民币汇率压力减缓，投资者风险偏好逐步上升，可能走出一波较好的行情。我们看好智能制造、国企改革、新能源车、白酒等概念板块，将继续配置相关个股。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以XBRL形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期

内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。

上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### **§ 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，本基金托管人在对中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关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，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的管理人——中欧基金管理有限公司在中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、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。本报告期内，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

#### **5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年半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 半年度财务会计报告（未经审计）**

## 6.1 资产负债表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日
<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	65,880,150.74
结算备付金		26,689,727.24
存出保证金		6,075,508.52
交易性金融资产	6.4.7.2	203,635,793.47
其中：股票投资		203,635,793.47
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		11,979,528.73
应收利息	6.4.7.5	19,458.47
应收股利		—
应收申购款		34,814.67
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		314,314,981.84
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年6月30日</b>
<b>负债：</b>		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—

卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		4,027,468.52
应付管理人报酬		418,826.05
应付托管费		69,804.36
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	1,039,524.56
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	6.4.7.8	223,652.59
负债合计		5,779,276.08
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	6.4.7.9	291,712,269.26
未分配利润	6.4.7.10	16,823,436.50
所有者权益合计		308,535,705.76
负债和所有者权益总计		314,314,981.84

注：1.报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.058元，基金份额总额291,712,269.26份。

2.本基金合同于2016年1月13日生效，故无上年度可比期间数据。

## 6.2 利润表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月13日至2016年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2016年1月13日（基金合同生效日）至 2016年6月30日
一、收入		31,933,911.96
1.利息收入		1,069,231.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	483,771.94
债券利息收入		—

资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		585,459.14
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		18,024,421.61
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,618,103.78
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	6.4.7.14	3,756,912.00
股利收益	6.4.7.15	649,405.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	12,154,928.94
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	685,330.33
<b>减：二、费用</b>		7,872,801.25
1. 管理人报酬		2,980,779.45
2. 托管费		496,796.62
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.18	4,180,986.90
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.19	214,238.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		24,061,110.71

减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>24,061,110.71</b>

注：本基金合同于2016年1月13日生效，故无上年度可比期间数据。

### 6.3 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：2016年1月13日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	506,409,681.98	—	506,409,681.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	24,061,110.71	24,061,110.71
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)	-214,697,412.72	-7,237,674.21	-221,935,086.93
其中：1.基金申购款	8,828,584.60	89,762.98	8,918,347.58
2.基金赎回款	-223,525,997.32	-7,327,437.19	-230,853,434.51
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）	291,712,269.26	16,823,436.50	308,535,705.76

注：本基金合同于2016年1月13日生效，故无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]2423号《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基金,存续期限不定。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。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国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)。本基金投资组合中: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:沪深300指数收益率 $\times$ 60%+中债综合指数收益率 $\times$ 40%。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2016年8月24日批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。



### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月13日(基金合同生效日)至2016年6月30日止期间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2016年6月30日的财务状况以及2016年1月13日(基金合同生效日)至2016年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2016年1月13日(基金合同生效日)至2016年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为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公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

同一类别的基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分

配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》，若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本，按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值；若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本，按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确

定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局/财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《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》、财税[2015]101号《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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2) 对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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%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。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
活期存款	65,880,150.74
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	65,880,150.74

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	193,696,544.53	203,635,793.47	9,939,248.94
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	193,696,544.53	203,635,793.47	9,939,248.94

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	18,645.77
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	644.40
应收债券利息	—
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	—
其他	168.30
合计	19,458.47

#### 6.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,039,524.56
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,039,524.56

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	10,112.31
预提信息披露费	182,324.88
预提审计费	31,215.40
合计	223,652.59

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	506,409,681.98	506,409,681.98
本期申购	8,828,584.60	8,828,584.60
本期赎回（以“-”号填列）	-223,525,997.32	-223,525,997.32
本期末	291,712,269.26	291,712,269.26

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自2015年12月16日至2016年1月11日止期间公开发售，共募集有效净认购资金506,108,438.33元。根据《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》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入301,243.65元在本基金成立后，折算为301,243.65份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《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》和《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》的相关规定，本基金于2016年1月13日（基金合同生效日）起至2016年2月18日止的期间，暂不向投资人开放基金交易

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	11,906,181.77	12,154,928.94	24,061,110.71
本期基金份额交易产	-1,861,032.32	-5,376,641.89	-7,237,674.21



生的变动数			
其中：基金申购款	23,472.65	66,290.33	89,762.98
基金赎回款	-1,884,504.97	-5,442,932.22	-7,327,437.19
本期已分配利润	—	—	—
本期末	10,045,149.45	6,778,287.05	16,823,436.50

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
活期存款利息收入	439,028.67
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	43,181.10
其他	1,562.17
合计	483,771.94

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	13,618,103.78
股票投资收益——赎回差价 收入	—
股票投资收益——申购差价 收入	—
合计	13,618,103.78

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
卖出股票成交总额	1,310,845,614.33
减：卖出股票成本总额	1,297,227,510.55
买卖股票差价收入	13,618,103.78

#### 6.4.7.13 债券投资收益

无余额。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无余额。

##### 6.4.7.14.2 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
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
期货	3,756,912.00

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
股票投资产生的股利收益	649,405.83
基金投资产生的股利收益	—
合计	649,405.83

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
1.交易性金融资产	9,939,248.94
——股票投资	9,939,248.94
——债券投资	—

——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	2,215,680.00
——权证投资	—
——期货投资	2,215,680.00
3.其他	—
合计	12,154,928.94

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
基金赎回费收入	685,197.05
转换费收入	133.28
合计	685,330.33

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
交易所市场交易费用	4,167,561.99
银行间市场交易费用	—
期货市场交易费用	13424.91
合计	4,180,986.90

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日

审计费用	31,215.40
信息披露费	182,324.88
开户费	400.00
汇划手续费	298.00
合计	214,238.28

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于2016年7月14日宣告2016年度第1次分红，向截至2016年7月18日止在本基金份额注册登记人中欧基金管理有限公司登记在册的全体持有人，按每10份基金份额派发红利0.330元。

#### 6.4.9 关联方关系

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

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司("中欧基金")	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司("万盛基业")	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司("北京百骏")	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
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 ("中	基金管理人的控股子公司

欧盛世资管")	
钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司 （"钱滚滚财富"）	基金管理人的控股子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	1,059,707,441.85	37.84%

注：本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	986,905.86	37.84%	183,292.26	17.63%

注：本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

###### 6.4.10.1.4 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	535,000,000.00	16.41%

注：本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,980,779.45
其中：支付销售机构的客户维护费	1,968,932.39

注：1.支付基金管理人 中欧基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

2.本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	496,796.62

注：1.支付基金托管人 中国工商银行 的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

2.本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

无。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	65,880,150.74	439,028.67

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同于2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**6.4.12 期末（2016年6月30日）本基金持有的流通受限证券**

**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	未上市	5.8	5.8	971	5,631.8	5,631.8
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	未上市	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	未上市	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98

601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	未上市	12.98	12.98	2,191	28,439.18	28,439.18
--------	------	------------	------------	-----	-------	-------	-------	-----------	-----------

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000018	神州长城	2016-06-24	筹划重大事项	12.17	2016-07-11	12.88	7,200	90,816.51	87,624.00
000025	特力A	2016-06-29	股价异常波动	73.92	2016-07-05	73.00	1,500	106,352.92	110,880.00
000401	冀东水泥	2016-04-06	筹划重大事项	10.90	2016-07-14	11.32	22,300	232,617.00	243,070.00
000407	胜利股份	2016-05-23	筹划重大事项	6.73		—	33,100	222,994.00	222,763.00
000415	渤海金控	2016-02-01	筹划重大事项	6.82	2016-08-11	7.50	6,600	46,615.77	45,012.00
000551	创元科技	2016-06-07	筹划重大事项	9.18	2016-07-07	10.10	17,100	156,689.42	156,978.00
000651	格力电器	2016-02-22	筹划重大事项	19.22		—	9,400	180,186.00	180,668.00
000803	金宇车城	2016-06-23	筹划重大事项	21.24		—	3,700	88,444.59	78,588.00
000923	河北宣工	2016-04-06	筹划重大事项	15.80		—	29,544	409,996.94	466,795.20
000936	华西股份	2016-05-24	筹划重大事项	8.22	2016-07-13	9.04	50,708	514,082.04	416,819.76
000955	欣龙控股	2016-04-08	重大资产重组	8.55	2016-08-10	9.00	48,500	374,600.49	414,675.00
002059	云南旅游	2016-06-01	筹划重大事项	8.56		—	15,500	138,335.00	132,680.00
002101	广东鸿图	2016-05-03	筹划重大事项	21.62		—	10,790	208,147.40	233,279.80
002127	南极电商	2016-05-16	筹划重大事项	9.63		—	15,200	151,012.00	146,376.00
002134	天津普林	2016-05-09	筹划重大事项	14.50	2016-07-29	13.26	40,900	601,126.81	593,050.00
002190	成飞集成	2016-04-21	筹划重大事项	35.44	2016-07-12	38.98	9,300	335,823.00	329,592.00
002249	大洋电机	2016-06-08	重大资产重组	11.97	2016-07-28	10.77	900	10,386.00	10,773.00
002277	华昌	2016-	重大资产	10.50	2016-	10.65	8,100	71,408.46	85,050.00



中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告

4	化工	06-13	重组		07-07					
002283	天润曲轴	2016-03-23	重大资产重组	17.15		—	24,900	339,869.00	427,035.00	
002289	ST宇顺	2016-04-29	重大资产重组	26.04		—	26,200	675,437.00	682,248.00	
002331	皖通科技	2016-04-18	重大资产重组	16.54	2016-07-11	15.31	38,160	547,516.36	631,166.40	
002452	长高集团	2016-06-14	筹划重大事项	12.02	2016-07-12	10.82	25,900	276,933.75	311,318.00	
002469	三维工程	2016-05-10	筹划重大事项	9.01	2016-08-02	8.11	61,300	584,189.00	552,313.00	
002492	恒基达鑫	2016-02-24	筹划重大事项	12.66		—	12,700	148,845.34	160,782.00	
002591	恒大高新	2016-04-15	重大资产重组	17.78		—	17,800	241,012.00	316,484.00	
300040	九洲电气	2016-06-27	筹划重大事项	13.73		—	6,100	69,113.00	83,753.00	
300080	易成新能	2016-05-19	重大资产重组	7.76		—	15,700	124,598.21	121,832.00	
300111	向日葵	2016-06-14	筹划重大事项	4.90		—	6,500	31,915.00	31,850.00	
300176	鸿特精密	2016-04-27	筹划重大事项	30.20		—	11,000	247,103.89	332,200.00	
300351	永贵电器	2016-06-29	筹划重大事项	33.93	2016-07-04	33.30	26,500	747,963.96	899,145.00	
300353	东土科技	2016-06-23	筹划重大事项	22.09		—	12,100	227,432.00	267,289.00	
300355	蒙草生态	2016-06-30	筹划重大事项	7.11	2016-07-06	7.38	37,000	252,860.00	263,070.00	
300356	光一科技	2016-05-26	筹划重大事项	48.44	2016-08-10	44.27	2,600	85,689.86	125,944.00	
300427	红相电力	2016-06-13	筹划重大事项	21.89		—	20,000	396,688.00	437,800.00	
600005	武钢股份	2016-06-27	重大资产重组	2.76		—	22,400	63,314.00	61,824.00	
600019	宝钢股份	2016-06-27	重大资产重组	4.90		—	23,200	117,292.00	113,680.00	
600318	新力金融	2016-03-24	重大资产重组	26.84		—	31,400	732,293.61	842,776.00	
600385	山东金泰	2016-04-26	筹划重大事项	22.84	2016-08-05	20.56	25,564	582,013.92	583,881.76	
600408	安泰	2016-04-14	筹划重大	5.88		—	39,800	217,272.00	234,024.00	

	集团		事项						
600556	慧球科技	2016-01-19	重大资产重组	15.80	2016-07-07	14.22	700	11,060.00	11,060.00
600653	中华控股	2016-05-05	重大资产重组	3.93		—	37,700	136,909.09	148,161.00
600773	西藏城投	2016-06-30	重大资产重组	15.67		—	400	6,592.00	6,268.00
600796	钱江生化	2016-05-31	重大资产重组	9.80		—	14,900	160,651.86	146,020.00
600986	科达股份	2016-06-27	重大资产重组	15.98	2016-07-18	17.58	58,300	943,721.72	931,634.00
601611	中国核建	2016-06-30	股价异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	9,075	31,490.25	189,849.00

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、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。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通

过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2016年6月30日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,880,150.74	—	—	—	65,880,150.74
结算备付金	26,689,727.24	—	—	—	26,689,727.24
存出保证金	6,075,508.52	—	—	—	6,075,508.52
交易性金融资产	—	—	—	203,635,793.47	203,635,793.47
应收证券清算	—	—	—	11,979,528.73	11,979,528.73

款					
应收利息	—	—	—	19,458.47	19,458.47
应收申购款	—	—	—	34,814.67	34,814.67
资产总计	98,645,386.50	—	—	215,669,595.34	314,314,981.84
负债					
应付证券清算款	—	—	—		
应付赎回款	—	—	—	4,027,468.52	4,027,468.52
应付管理人报酬	—	—	—	418,826.05	418,826.05
应付托管费	—	—	—	69,804.36	69,804.36
应付交易费用	—	—	—	1,039,524.56	1,039,524.56
其他负债	—	—	—	223,652.59	223,652.59
负债总计	—	—	—	5,779,276.08	5,779,276.08
利率敏感度缺口	98,645,386.50	—	—	209,890,319.26	308,535,705.76

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年6月30日，本基金未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上

市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	203,635,793.47	66.00
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—
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	203,635,793.47	66.00

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币万元)
		本期末 2016年6月30日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	1,552.06
	2. 业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-1,552.06

#### 6.4.14 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

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于2016年06月30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190,710,734.29元，属于第二层次的余额为12,925,059.18元，无属于第三层次的余额。

##### (ii)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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

##### (d)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应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	203,635,793.47	64.79
	其中：股票	203,635,793.47	64.79
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	92,569,877.98	29.45
7	其他各项资产	18,109,310.39	5.76
8	合计	314,314,981.84	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	8,957,310.88	2.90
B	采矿业	4,905,367.21	1.59
C	制造业	136,055,120.07	44.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,960,515.71	1.61
E	建筑业	7,361,076.74	2.39
F	批发和零售业	10,366,368.80	3.36



G	交通运输、仓储和邮政业	2,684,869.00	0.87
H	住宿和餐饮业	264,334.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,151,613.61	1.99
J	金融业	1,994,638.03	0.65
K	房地产业	7,859,096.81	2.55
L	租赁和商务服务业	4,307,637.75	1.40
M	科学研究和技术服务业	879,660.85	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	1,113,136.50	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	227,450.00	0.07
Q	卫生和社会工作	338,390.93	0.11
R	文化、体育和娱乐业	2,899,805.58	0.94
S	综合	2,309,401.00	0.75
	合计	203,635,793.47	66.00

### 7.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002094	青岛金王	224,542	5,997,516.82	1.94
2	002299	圣农发展	226,020	5,853,918.00	1.90
3	600398	海澜之家	424,100	4,792,330.00	1.55
4	603338	浙江鼎力	85,700	3,950,770.00	1.28
5	603898	好莱客	105,809	3,289,601.81	1.07
6	002091	江苏国泰	143,300	2,271,305.00	0.74
7	002108	沧州明珠	85,273	2,208,570.70	0.72
8	600567	山鹰纸业	748,000	2,124,320.00	0.69
9	000601	韶能股份	190,700	1,992,815.00	0.65
10	300083	劲胜精密	218,900	1,808,114.00	0.59

11	002081	金螳螂	173,709	1,740,564.18	0.56
12	002643	万润股份	33,700	1,714,656.00	0.56
13	603799	华友钴业	46,000	1,711,200.00	0.55
14	002614	蒙发利	139,330	1,673,353.30	0.54
15	002281	光迅科技	25,301	1,624,324.20	0.53
16	300063	天龙集团	52,500	1,563,450.00	0.51
17	600322	天房发展	345,987	1,543,102.02	0.50
18	000799	酒鬼酒	63,200	1,504,160.00	0.49
19	300097	智云股份	28,900	1,446,445.00	0.47
20	600828	茂业商业	201,700	1,371,560.00	0.44
21	300073	当升科技	20,240	1,354,865.60	0.44
22	000998	隆平高科	67,300	1,277,354.00	0.41
23	600298	安琪酵母	70,400	1,255,936.00	0.41
24	002635	安洁科技	31,600	1,212,808.00	0.39
25	002572	索菲亚	21,600	1,210,032.00	0.39
26	603598	引力传媒	49,935	1,200,936.75	0.39
27	002597	金禾实业	88,200	1,188,054.00	0.39
28	600622	嘉宝集团	86,100	1,183,875.00	0.38
29	300429	强力新材	8,400	1,173,144.00	0.38
30	000909	数源科技	56,800	1,166,672.00	0.38
31	000567	海德股份	36,700	1,161,555.00	0.38
32	300156	神雾环保	56,000	1,152,480.00	0.37
33	002006	精功科技	84,298	1,140,551.94	0.37
34	600259	广晟有色	19,800	1,133,748.00	0.37
35	002229	鸿博股份	43,867	1,100,184.36	0.36
36	002434	万里扬	101,000	1,098,880.00	0.36
37	000404	华意压缩	114,068	1,097,334.16	0.36
38	002056	横店东磁	63,443	1,078,531.00	0.35
39	002502	骅威文化	42,400	1,043,040.00	0.34
40	600093	禾嘉股份	82,700	1,026,307.00	0.33

41	002284	亚太股份	53,600	1,023,224.00	0.33
42	000970	中科三环	69,500	1,008,445.00	0.33
43	002557	洽洽食品	53,700	1,000,968.00	0.32
44	600891	秋林集团	78,000	996,060.00	0.32
45	002104	恒宝股份	60,300	991,332.00	0.32
46	002697	红旗连锁	160,560	969,782.40	0.31
47	002575	群兴玩具	85,000	964,750.00	0.31
48	300408	三环集团	53,300	957,268.00	0.31
49	002024	苏宁云商	88,000	955,680.00	0.31
50	600073	上海梅林	83,000	950,350.00	0.31
51	601717	郑煤机	164,700	938,790.00	0.30
52	300272	开能环保	60,600	935,058.00	0.30
53	600986	科达股份	58,300	931,634.00	0.30
54	300351	永贵电器	26,500	899,145.00	0.29
55	002383	合众思壮	23,900	856,337.00	0.28
56	600318	新力金融	31,400	842,776.00	0.27
57	300405	科隆精化	17,100	786,771.00	0.26
58	603012	创力集团	56,700	760,914.00	0.25
59	002734	利民股份	22,400	752,416.00	0.24
60	002696	百洋股份	38,642	739,607.88	0.24
61	600508	上海能源	79,123	733,470.21	0.24
62	000488	晨鸣纸业	89,700	712,218.00	0.23
63	600816	安信信托	42,069	709,704.03	0.23
64	300230	永利股份	24,400	709,552.00	0.23
65	002196	方正电机	20,500	700,895.00	0.23
66	300047	天源迪科	34,900	696,255.00	0.23
67	300249	依米康	70,250	694,070.00	0.22
68	002289	*ST宇顺	26,200	682,248.00	0.22
69	300065	海兰信	17,600	680,768.00	0.22
70	002035	华帝股份	27,762	679,613.76	0.22

71	300392	腾信股份	24,500	663,460.00	0.22
72	600155	宝硕股份	47,800	656,772.00	0.21
73	002235	安妮股份	35,900	653,739.00	0.21
74	002533	金杯电工	48,100	645,983.00	0.21
75	000060	中金岭南	61,800	644,574.00	0.21
76	300278	华昌达	37,600	642,584.00	0.21
77	002331	皖通科技	38,160	631,166.40	0.20
78	002121	科陆电子	53,400	627,450.00	0.20
79	600117	西宁特钢	122,000	613,660.00	0.20
80	002134	天津普林	40,900	593,050.00	0.19
81	002542	中化岩土	78,200	592,756.00	0.19
82	600060	海信电器	33,500	592,280.00	0.19
83	603999	读者传媒	19,120	591,381.60	0.19
84	300124	汇川技术	30,400	589,760.00	0.19
85	600385	山东金泰	25,564	583,881.76	0.19
86	002444	巨星科技	28,700	583,184.00	0.19
87	002080	中材科技	29,000	582,320.00	0.19
88	600599	熊猫金控	21,500	574,910.00	0.19
89	600900	长江电力	46,000	574,540.00	0.19
90	600452	涪陵电力	16,801	561,321.41	0.18
91	002607	亚夏汽车	48,700	559,563.00	0.18
92	002469	三维工程	61,300	552,313.00	0.18
93	002552	宝鼎科技	35,600	546,460.00	0.18
94	002564	天沃科技	70,100	539,770.00	0.17
95	002707	众信旅游	26,400	535,920.00	0.17
96	002435	长江润发	29,700	534,303.00	0.17
97	600338	西藏珠峰	18,100	531,959.00	0.17
98	000628	高新发展	39,100	517,293.00	0.17
99	002213	特尔佳	25,875	511,548.75	0.17
100	002077	大港股份	22,500	499,500.00	0.16

101	000501	鄂武商 A	31,730	497,843.70	0.16
102	600498	烽火通信	20,400	495,312.00	0.16
103	600757	长江传媒	57,742	484,455.38	0.16
104	002554	惠博普	66,000	475,200.00	0.15
105	000923	河北宣工	29,544	466,795.20	0.15
106	002239	奥特佳	28,900	465,579.00	0.15
107	002325	洪涛股份	50,520	464,278.80	0.15
108	600110	诺德股份	47,000	462,480.00	0.15
109	600233	大杨创世	22,800	443,688.00	0.14
110	300427	红相电力	20,000	437,800.00	0.14
111	600310	桂东电力	52,500	431,025.00	0.14
112	002624	完美世界	11,400	430,350.00	0.14
113	300251	光线传媒	37,200	430,032.00	0.14
114	300078	思创医惠	12,800	428,032.00	0.14
115	002283	天润曲轴	24,900	427,035.00	0.14
116	000967	盈峰环境	19,200	426,048.00	0.14
117	000890	法尔胜	40,100	424,659.00	0.14
118	002357	富临运业	27,400	422,782.00	0.14
119	002361	神剑股份	54,400	422,144.00	0.14
120	600820	隧道股份	49,800	417,822.00	0.14
121	300350	华鹏飞	11,700	417,690.00	0.14
122	000662	天夏智慧	19,400	417,100.00	0.14
123	000936	华西股份	50,708	416,819.76	0.14
124	300031	宝通科技	16,300	415,976.00	0.13
125	600489	中金黄金	37,000	415,880.00	0.13
126	000955	欣龙控股	48,500	414,675.00	0.13
127	600620	天宸股份	39,300	409,899.00	0.13
128	002053	云南盐化	14,300	405,977.00	0.13
129	002454	松芝股份	22,100	401,778.00	0.13
130	002688	金河生物	35,200	396,000.00	0.13

131	600076	康欣新材	25,700	389,355.00	0.13
132	300263	隆华节能	34,800	389,064.00	0.13
133	000698	沈阳化工	59,200	387,168.00	0.13
134	002730	电光科技	23,100	385,308.00	0.12
135	600750	江中药业	12,099	384,748.20	0.12
136	600777	新潮实业	21,700	383,873.00	0.12
137	002242	九阳股份	20,900	379,962.00	0.12
138	300089	文化长城	30,400	374,528.00	0.12
139	002719	麦趣尔	7,700	374,066.00	0.12
140	002699	美盛文化	11,200	373,968.00	0.12
141	002098	浔兴股份	31,800	369,516.00	0.12
142	002582	好想你	9,300	367,536.00	0.12
143	300342	天银机电	11,950	363,997.00	0.12
144	300221	银禧科技	17,700	361,434.00	0.12
145	300449	汉邦高科	6,300	359,982.00	0.12
146	603718	海利生物	21,900	359,598.00	0.12
147	300010	立思辰	17,100	358,758.00	0.12
148	000563	陕国投 A	65,300	358,497.00	0.12
149	000028	国药一致	5,500	358,050.00	0.12
150	000402	金融街	36,800	357,696.00	0.12
151	600990	四创电子	4,100	355,429.00	0.12
152	603555	贵人鸟	14,100	351,513.00	0.11
153	600869	智慧能源	34,000	350,200.00	0.11
154	601058	赛轮金宇	104,300	348,362.00	0.11
155	603989	艾华集团	10,700	346,894.00	0.11
156	002544	杰赛科技	10,700	343,149.00	0.11
157	600029	南方航空	48,400	341,704.00	0.11
158	300456	耐威科技	5,000	338,750.00	0.11
159	603118	共进股份	8,300	337,727.00	0.11
160	002616	长青集团	16,200	335,340.00	0.11

161	603609	禾丰牧业	21,100	334,013.00	0.11
162	002310	东方园林	13,900	332,488.00	0.11
163	300176	鸿特精密	11,000	332,200.00	0.11
164	002190	成飞集成	9,300	329,592.00	0.11
165	600266	北京城建	26,200	327,238.00	0.11
166	002050	三花股份	33,600	324,240.00	0.11
167	000019	深深宝 A	23,700	321,372.00	0.10
168	603011	合锻股份	27,643	319,553.08	0.10
169	002553	南方轴承	22,600	318,434.00	0.10
170	002591	恒大高新	17,800	316,484.00	0.10
171	002179	中航光电	7,300	316,236.00	0.10
172	600830	香溢融通	33,600	315,168.00	0.10
173	002452	长高集团	25,900	311,318.00	0.10
174	600221	海南航空	97,900	310,343.00	0.10
175	002191	劲嘉股份	26,600	308,294.00	0.10
176	002352	鼎泰新材	6,400	307,712.00	0.10
177	601799	星宇股份	6,700	306,994.00	0.10
178	002051	中工国际	15,580	306,458.60	0.10
179	601390	中国中铁	43,700	304,589.00	0.10
180	300084	海默科技	24,900	304,278.00	0.10
181	000697	炼石有色	13,000	297,050.00	0.10
182	300394	天孚通信	7,200	293,832.00	0.10
183	002112	三变科技	11,400	292,182.00	0.09
184	603030	全筑股份	10,600	290,016.00	0.09
185	600517	置信电气	30,300	288,153.00	0.09
186	300100	双林股份	6,500	284,765.00	0.09
187	600635	大众公用	46,700	281,601.00	0.09
188	603818	曲美家居	17,400	278,400.00	0.09
189	002290	禾盛新材	10,000	278,300.00	0.09
190	000902	新洋丰	22,200	277,722.00	0.09

191	600756	浪潮软件	9,200	276,920.00	0.09
192	300197	铁汉生态	19,900	275,814.00	0.09
193	600053	九鼎投资	7,900	273,577.00	0.09
194	600872	中炬高新	22,000	271,480.00	0.09
195	300420	五洋科技	4,300	270,212.00	0.09
196	002736	国信证券	15,600	269,100.00	0.09
197	000978	桂林旅游	25,600	269,056.00	0.09
198	300353	东土科技	12,100	267,289.00	0.09
199	300479	神思电子	6,200	265,794.00	0.09
200	000750	国海证券	35,900	265,301.00	0.09
201	000089	深圳机场	31,200	265,200.00	0.09
202	000059	华锦股份	28,500	265,050.00	0.09
203	300011	鼎汉技术	11,270	264,506.90	0.09
204	600754	锦江股份	7,900	264,334.00	0.09
205	300355	蒙草抗旱	37,000	263,070.00	0.09
206	601116	三江购物	22,500	261,900.00	0.08
207	002097	山河智能	25,000	257,250.00	0.08
208	002288	超华科技	25,200	249,480.00	0.08
209	300499	高澜股份	2,400	249,024.00	0.08
210	603766	隆鑫通用	12,100	244,662.00	0.08
211	000401	冀东水泥	22,300	243,070.00	0.08
212	002353	杰瑞股份	12,400	239,072.00	0.08
213	300493	润欣科技	3,300	237,963.00	0.08
214	002048	宁波华翔	10,400	237,848.00	0.08
215	601311	骆驼股份	11,900	236,215.00	0.08
216	000333	美的集团	9,900	234,828.00	0.08
217	600408	安泰集团	39,800	234,024.00	0.08
218	002101	广东鸿图	10,790	233,279.80	0.08
219	601088	中国神华	16,400	230,748.00	0.07
220	000158	常山股份	16,500	229,185.00	0.07



221	600006	东风汽车	25,700	227,959.00	0.07
222	603377	东方时尚	5,000	227,450.00	0.07
223	600705	中航资本	38,200	224,616.00	0.07
224	601028	玉龙股份	31,400	224,196.00	0.07
225	000407	胜利股份	33,100	222,763.00	0.07
226	000957	中通客车	4,700	213,380.00	0.07
227	300369	绿盟科技	4,900	207,319.00	0.07
228	300232	洲明科技	12,000	190,200.00	0.06
229	601611	中国核建	9,075	189,849.00	0.06
230	300056	三维丝	10,400	187,720.00	0.06
231	300015	爱尔眼科	5,081	185,608.93	0.06
232	603601	再升科技	3,800	182,894.00	0.06
233	002461	珠江啤酒	15,700	182,434.00	0.06
234	000651	格力电器	9,400	180,668.00	0.06
235	002340	格林美	20,300	178,031.00	0.06
236	000667	美好集团	49,600	177,072.00	0.06
237	002463	沪电股份	33,500	176,880.00	0.06
238	000568	泸州老窖	5,900	175,230.00	0.06
239	002438	江苏神通	8,000	175,120.00	0.06
240	002709	天赐材料	2,500	174,850.00	0.06
241	002493	荣盛石化	14,195	172,043.40	0.06
242	300516	久之洋	982	172,016.94	0.06
243	002304	洋河股份	2,300	165,416.00	0.05
244	600436	片仔癀	3,600	162,036.00	0.05
245	002492	恒基达鑫	12,700	160,782.00	0.05
246	002425	凯撒股份	7,300	160,600.00	0.05
247	300202	聚龙股份	6,500	157,365.00	0.05
248	000551	创元科技	17,100	156,978.00	0.05
249	300058	蓝色光标	16,100	156,331.00	0.05
250	600240	华业资本	15,600	156,312.00	0.05

251	300219	鸿利光电	10,000	155,800.00	0.05
252	002640	跨境通	8,800	155,056.00	0.05
253	300512	中亚股份	1,550	154,876.00	0.05
254	000766	通化金马	7,700	154,308.00	0.05
255	603737	三颗树	1,327	154,038.16	0.05
256	300207	欣旺达	6,000	154,020.00	0.05
257	002055	得润电子	5,000	153,100.00	0.05
258	600763	通策医疗	4,900	152,782.00	0.05
259	603339	四方申购	2,793	151,995.06	0.05
260	000627	天茂集团	19,500	150,735.00	0.05
261	002579	中京电子	9,600	150,528.00	0.05
262	002481	双塔食品	20,500	149,650.00	0.05
263	600549	厦门钨业	5,000	148,550.00	0.05
264	600487	亨通光电	11,800	148,444.00	0.05
265	600653	申华控股	37,700	148,161.00	0.05
266	300203	聚光科技	5,600	147,840.00	0.05
267	002127	南极电商	15,200	146,376.00	0.05
268	002308	威创股份	8,900	146,227.00	0.05
269	600796	钱江生化	14,900	146,020.00	0.05
270	002595	豪迈科技	6,800	145,316.00	0.05
271	300324	旋极信息	6,700	143,782.00	0.05
272	300315	掌趣科技	13,400	140,566.00	0.05
273	601012	隆基股份	10,700	139,635.00	0.05
274	300162	雷曼股份	6,200	136,338.00	0.04
275	000937	冀中能源	25,500	135,660.00	0.04
276	002344	海宁皮城	13,900	135,525.00	0.04
277	002317	众生药业	11,300	135,487.00	0.04
278	600557	康缘药业	8,280	135,212.40	0.04
279	300133	华策影视	8,680	135,147.60	0.04
280	600789	鲁抗医药	14,900	133,206.00	0.04

281	002059	云南旅游	15,500	132,680.00	0.04
282	600898	三联商社	10,600	132,606.00	0.04
283	000735	罗牛山	20,400	131,580.00	0.04
284	300498	温氏股份	3,600	130,392.00	0.04
285	300033	同花顺	1,600	130,320.00	0.04
286	600688	上海石化	21,200	129,320.00	0.04
287	002019	亿帆鑫富	8,400	129,192.00	0.04
288	600227	赤天化	22,400	128,800.00	0.04
289	000703	恒逸石化	12,800	126,336.00	0.04
290	300356	光一科技	2,600	125,944.00	0.04
291	002477	雏鹰农牧	20,800	124,176.00	0.04
292	600354	敦煌种业	15,400	123,662.00	0.04
293	000863	三湘股份	13,400	123,280.00	0.04
294	600850	华东电脑	4,290	123,080.10	0.04
295	600351	亚宝药业	12,240	122,767.20	0.04
296	600270	外运发展	7,000	122,430.00	0.04
297	002464	金利科技	2,000	122,200.00	0.04
298	300080	易成新能	15,700	121,832.00	0.04
299	002714	牧原股份	2,400	121,272.00	0.04
300	600743	华远地产	25,500	120,615.00	0.04
301	002462	嘉事堂	3,200	119,200.00	0.04
302	603779	威龙股份	2,790	117,068.40	0.04
303	002007	华兰生物	3,720	116,808.00	0.04
304	603959	N百利	2,815	116,681.75	0.04
305	601888	中国国旅	2,600	114,348.00	0.04
306	600019	宝钢股份	23,200	113,680.00	0.04
307	300092	科新机电	7,400	113,220.00	0.04
308	002385	大北农	14,000	112,840.00	0.04
309	300252	金信诺	3,400	112,642.00	0.04
310	600593	大连圣亚	3,600	111,564.00	0.04

311	002293	罗莱生活	8,100	110,970.00	0.04
312	002645	华宏科技	4,200	110,880.00	0.04
313	000025	特力A	1,500	110,880.00	0.04
314	000607	华媒控股	13,100	110,433.00	0.04
315	002494	华斯股份	7,100	109,695.00	0.04
316	600776	东方通信	13,000	109,070.00	0.04
317	300431	暴风集团	1,500	108,750.00	0.04
318	600054	黄山旅游	6,750	108,607.50	0.04
319	002402	和而泰	4,000	108,200.00	0.04
320	002078	太阳纸业	22,100	107,848.00	0.03
321	002223	鱼跃医疗	3,400	107,848.00	0.03
322	300348	长亮科技	2,900	107,184.00	0.03
323	000021	深科技	9,700	106,797.00	0.03
324	002224	三力士	4,600	106,490.00	0.03
325	000729	燕京啤酒	14,027	106,464.93	0.03
326	002079	苏州固锝	9,500	106,115.00	0.03
327	002137	麦达数字	6,200	105,152.00	0.03
328	000656	金科股份	27,300	104,286.00	0.03
329	600729	重庆百货	4,200	104,160.00	0.03
330	300013	新宁物流	5,800	104,110.00	0.03
331	601127	小康股份	4,341	103,619.67	0.03
332	300098	高新兴	6,500	103,220.00	0.03
333	002722	金轮股份	2,700	102,492.00	0.03
334	300341	麦迪电气	6,000	102,300.00	0.03
335	600736	苏州高新	11,200	102,256.00	0.03
336	002535	林州重机	12,600	101,808.00	0.03
337	002043	兔宝宝	10,150	101,804.50	0.03
338	002182	云海金属	5,100	101,490.00	0.03
339	002164	宁波东力	8,900	101,371.00	0.03
340	300482	万孚生物	1,900	100,605.00	0.03

341	300036	超图软件	4,100	100,450.00	0.03
342	002418	康盛股份	9,500	100,320.00	0.03
343	600835	上海机电	5,200	99,788.00	0.03
344	300194	福安药业	4,600	99,590.00	0.03
345	300159	新研股份	5,500	99,275.00	0.03
346	300215	电科院	7,700	99,176.00	0.03
347	600771	广誉远	3,400	99,076.00	0.03
348	000965	天保基建	16,600	98,272.00	0.03
349	002400	省广股份	6,900	97,497.00	0.03
350	002472	双环传动	4,000	97,280.00	0.03
351	002074	国轩高科	2,464	97,254.08	0.03
352	300185	通裕重工	10,900	97,228.00	0.03
353	000732	泰禾集团	5,000	97,200.00	0.03
354	300270	中威电子	5,700	97,071.00	0.03
355	002599	盛通股份	2,700	96,714.00	0.03
356	000031	中粮地产	10,233	96,497.19	0.03
357	600892	宝诚股份	1,500	96,480.00	0.03
358	600862	南通科技	6,800	96,424.00	0.03
359	002413	雷科防务	7,020	96,384.60	0.03
360	600188	兖州煤业	8,800	96,272.00	0.03
361	300053	欧比特	5,300	96,195.00	0.03
362	002125	湘潭电化	4,800	96,000.00	0.03
363	300317	珈伟股份	2,900	95,700.00	0.03
364	300131	英唐智控	8,100	95,661.00	0.03
365	002151	北斗星通	2,841	95,628.06	0.03
366	300042	朗科科技	2,800	95,452.00	0.03
367	300018	中元华电	7,500	95,325.00	0.03
368	000868	安凯客车	12,500	95,125.00	0.03
369	603010	万盛股份	4,300	95,116.00	0.03
370	300077	国民技术	4,800	95,040.00	0.03

371	002609	捷顺科技	5,400	94,986.00	0.03
372	000792	盐湖股份	4,500	94,950.00	0.03
373	300117	嘉寓股份	14,140	94,879.40	0.03
374	300115	长盈精密	4,600	94,760.00	0.03
375	002322	理工环科	5,000	94,700.00	0.03
376	601111	中国国航	14,000	94,640.00	0.03
377	300311	任子行	4,336	94,611.52	0.03
378	002369	卓翼科技	8,400	94,500.00	0.03
379	002093	国脉科技	7,600	94,316.00	0.03
380	300497	富祥股份	800	94,160.00	0.03
381	300241	瑞丰光电	5,700	94,107.00	0.03
382	300280	南通锻压	3,300	93,654.00	0.03
383	300168	万达信息	3,600	93,564.00	0.03
384	300043	互动娱乐	6,600	93,522.00	0.03
385	300193	佳士科技	9,000	93,510.00	0.03
386	300327	中颖电子	1,750	93,502.50	0.03
387	002660	茂硕电源	6,200	93,434.00	0.03
388	300120	经纬电材	6,300	93,429.00	0.03
389	600039	四川路桥	23,700	93,378.00	0.03
390	000989	九芝堂	4,100	93,357.00	0.03
391	002321	华英农业	9,900	93,258.00	0.03
392	300069	金利华电	2,900	93,090.00	0.03
393	300136	信维通信	4,420	92,643.20	0.03
394	600784	鲁银投资	10,500	92,505.00	0.03
395	002027	分众传媒	5,600	92,456.00	0.03
396	000901	航天科技	2,300	92,345.00	0.03
397	601233	桐昆股份	8,500	92,310.00	0.03
398	002301	齐心集团	4,500	92,250.00	0.03
399	300319	麦捷科技	3,200	92,224.00	0.03
400	300238	冠昊生物	2,100	92,148.00	0.03

401	300302	同有科技	2,820	91,565.40	0.03
402	002798	帝王洁具	1,056	91,555.20	0.03
403	002410	广联达	6,400	91,520.00	0.03
404	601567	三星医疗	6,200	91,450.00	0.03
405	002329	皇氏集团	6,100	91,439.00	0.03
406	600645	中源协和	2,600	91,364.00	0.03
407	300037	新宙邦	1,400	91,266.00	0.03
408	002088	鲁阳节能	5,864	91,243.84	0.03
409	300444	双杰电气	3,100	91,047.00	0.03
410	000836	鑫茂科技	14,700	90,846.00	0.03
411	002298	中电鑫龙	5,500	90,750.00	0.03
412	002194	武汉凡谷	7,100	90,738.00	0.03
413	002769	普路通	1,000	90,680.00	0.03
414	000983	西山煤电	11,100	90,465.00	0.03
415	300418	昆仑万维	3,200	90,464.00	0.03
416	600129	太极集团	5,100	90,321.00	0.03
417	002265	西仪股份	6,000	90,180.00	0.03
418	002010	传化股份	4,550	90,044.50	0.03
419	002748	世龙实业	5,400	89,910.00	0.03
420	002264	新华都	10,500	89,775.00	0.03
421	002092	中泰化学	10,600	89,676.00	0.03
422	002124	天邦股份	8,420	89,673.00	0.03
423	002118	紫鑫药业	6,100	89,670.00	0.03
424	300247	乐金健康	10,800	89,640.00	0.03
425	002786	银宝山新	3,000	89,610.00	0.03
426	002309	中利科技	5,000	89,550.00	0.03
427	601126	四方股份	8,500	89,505.00	0.03
428	600213	亚星客车	7,000	89,320.00	0.03
429	300094	国联水产	6,100	89,182.00	0.03
430	300086	康芝药业	7,750	89,125.00	0.03

431	300377	赢时胜	1,800	89,082.00	0.03
432	000591	太阳能	5,900	89,031.00	0.03
433	002671	龙泉股份	7,200	88,920.00	0.03
434	002102	冠福股份	7,100	88,892.00	0.03
435	002013	中航机电	6,592	88,860.16	0.03
436	300248	新开普	3,300	88,803.00	0.03
437	002305	南国置业	15,800	88,796.00	0.03
438	300410	正业科技	1,800	88,650.00	0.03
439	000788	北大医药	6,800	88,604.00	0.03
440	300209	天泽信息	3,500	88,375.00	0.03
441	600505	西昌电力	9,900	88,308.00	0.03
442	601898	中煤能源	17,100	88,236.00	0.03
443	300122	智飞生物	5,700	88,179.00	0.03
444	600178	东安动力	10,100	88,072.00	0.03
445	600711	盛屯矿业	11,900	88,060.00	0.03
446	000040	宝安地产	7,500	88,050.00	0.03
447	002638	勤上光电	4,100	88,027.00	0.03
448	002119	康强电子	4,300	87,978.00	0.03
449	002243	通产丽星	6,900	87,975.00	0.03
450	300023	宝德股份	3,400	87,958.00	0.03
451	300179	四方达	11,500	87,860.00	0.03
452	002132	恒星科技	19,960	87,824.00	0.03
453	000707	双环科技	12,300	87,822.00	0.03
454	000733	振华科技	3,900	87,750.00	0.03
455	002606	大连电瓷	4,500	87,705.00	0.03
456	300222	科大智能	3,200	87,648.00	0.03
457	000018	神州长城	7,200	87,624.00	0.03
458	002752	昇兴股份	5,200	87,568.00	0.03
459	300129	泰胜风能	12,500	87,500.00	0.03
460	300379	东方通	1,100	87,428.00	0.03



461	000797	中国武夷	5,840	87,249.60	0.03
462	002323	雅百特	6,700	87,234.00	0.03
463	002581	未名医药	3,200	87,200.00	0.03
464	002460	赣锋锂业	2,600	86,970.00	0.03
465	300443	金雷风电	1,300	86,723.00	0.03
466	300119	瑞普生物	5,400	86,670.00	0.03
467	000400	许继电气	5,600	86,464.00	0.03
468	300158	振东制药	5,349	86,386.35	0.03
469	000507	珠海港	15,750	86,310.00	0.03
470	000430	张家界	7,600	86,260.00	0.03
471	002619	巨龙管业	6,100	86,193.00	0.03
472	300196	长海股份	2,200	86,174.00	0.03
473	002270	法因数控	5,300	86,072.00	0.03
474	300048	合康变频	7,300	85,848.00	0.03
475	000420	吉林化纤	12,850	85,838.00	0.03
476	000078	海王生物	11,550	85,816.50	0.03
477	300090	盛运环保	10,600	85,754.00	0.03
478	300079	数码视讯	10,000	85,700.00	0.03
479	600506	香梨股份	3,900	85,683.00	0.03
480	002459	天业通联	5,200	85,592.00	0.03
481	002208	合肥城建	4,400	85,448.00	0.03
482	002594	比亚迪	1,400	85,414.00	0.03
483	300068	南都电源	3,900	85,254.00	0.03
484	000687	华讯方舟	4,300	85,140.00	0.03
485	002274	华昌化工	8,100	85,050.00	0.03
486	000810	创维数字	4,700	84,929.00	0.03
487	002653	海思科	5,300	84,906.00	0.03
488	002523	天桥起重	14,550	84,826.50	0.03
489	000012	南玻A	7,400	84,804.00	0.03
490	300088	长信科技	5,700	84,759.00	0.03

491	601777	力帆股份	7,200	84,744.00	0.03
492	600586	金晶科技	19,700	84,710.00	0.03
493	300144	宋城演艺	3,400	84,694.00	0.03
494	000609	绵世股份	6,600	84,678.00	0.03
495	300376	易事特	3,100	84,599.00	0.03
496	300359	全通教育	2,850	84,531.00	0.03
497	002359	齐星铁塔	3,400	84,490.00	0.03
498	002565	上海绿新	11,400	84,474.00	0.03
499	300388	国祯环保	3,700	84,397.00	0.03
500	000888	峨眉山 A	7,000	84,280.00	0.03
501	000838	财信发展	7,400	84,138.00	0.03
502	600695	绿庭投资	10,000	84,100.00	0.03
503	300028	金亚科技	4,600	83,996.00	0.03
504	300206	理邦仪器	7,550	83,956.00	0.03
505	000673	当代东方	6,700	83,951.00	0.03
506	300138	晨光生物	5,020	83,834.00	0.03
507	600980	北矿磁材	2,900	83,810.00	0.03
508	300040	九洲电气	6,100	83,753.00	0.03
509	600331	宏达股份	15,300	83,538.00	0.03
510	002204	大连重工	20,600	83,224.00	0.03
511	600022	山东钢铁	35,100	83,187.00	0.03
512	002570	贝因美	6,500	83,135.00	0.03
513	300021	大禹节水	4,400	82,896.00	0.03
514	002039	黔源电力	4,310	82,881.30	0.03
515	000540	中天城投	13,300	82,859.00	0.03
516	000550	江铃汽车	3,400	82,824.00	0.03
517	600657	信达地产	16,600	82,668.00	0.03
518	300459	浙江金科	2,800	82,628.00	0.03
519	002772	众兴菌业	3,300	82,599.00	0.03
520	300250	初灵信息	2,789	82,526.51	0.03

521	600231	凌钢股份	34,800	82,476.00	0.03
522	000716	黑芝麻	12,200	82,472.00	0.03
523	300481	濮阳惠成	1,600	82,368.00	0.03
524	300296	利亚德	2,600	82,316.00	0.03
525	002485	希努尔	5,088	82,222.08	0.03
526	000993	闽东电力	9,300	82,119.00	0.03
527	300014	亿纬锂能	1,900	82,061.00	0.03
528	002169	智光电气	3,600	81,900.00	0.03
529	000958	东方能源	5,900	81,715.00	0.03
530	300495	美尚生态	1,700	81,634.00	0.03
531	002785	万里石	3,000	81,300.00	0.03
532	002192	融捷股份	2,200	81,290.00	0.03
533	000426	兴业矿业	10,800	81,216.00	0.03
534	002315	焦点科技	1,200	80,952.00	0.03
535	000560	昆百大A	9,000	80,820.00	0.03
536	600761	安徽合力	8,000	80,720.00	0.03
537	000573	粤宏远A	10,700	80,678.00	0.03
538	601179	中国西电	15,900	80,613.00	0.03
539	000966	长源电力	12,400	80,600.00	0.03
540	000603	盛达矿业	4,400	80,432.00	0.03
541	300187	永清环保	6,000	80,400.00	0.03
542	002411	必康股份	4,500	80,325.00	0.03
543	000506	中润资源	10,600	79,818.00	0.03
544	002106	莱宝高科	6,700	79,596.00	0.03
545	002600	江粉磁材	6,555	79,184.40	0.03
546	000762	西藏矿业	3,200	79,104.00	0.03
547	600429	三元股份	10,100	79,083.00	0.03
548	600987	航民股份	6,500	78,780.00	0.03
549	603885	吉祥航空	3,000	78,750.00	0.03
550	000803	金宇车城	3,700	78,588.00	0.03

551	600707	彩虹股份	6,652	78,493.60	0.03
552	000860	顺鑫农业	3,300	78,474.00	0.03
553	600395	盘江股份	9,500	78,470.00	0.03
554	300113	顺网科技	2,054	77,969.84	0.03
555	600847	万里股份	2,600	77,948.00	0.03
556	600193	创兴资源	6,400	77,632.00	0.03
557	600156	华升股份	7,650	77,341.50	0.03
558	603131	上海沪工	1,263	76,664.10	0.02
559	000876	新希望	9,100	75,712.00	0.02
560	002285	世联行	9,500	74,005.00	0.02
561	601886	江河集团	7,200	73,944.00	0.02
562	002332	仙琚制药	6,600	73,920.00	0.02
563	600422	昆药集团	5,400	73,656.00	0.02
564	300039	上海凯宝	7,000	71,190.00	0.02
565	600219	南山铝业	9,600	71,040.00	0.02
566	600095	哈高科	7,000	69,510.00	0.02
567	000900	现代投资	10,300	69,422.00	0.02
568	600587	新华医疗	3,000	69,270.00	0.02
569	002468	艾迪西	2,400	68,688.00	0.02
570	000725	京东方A	29,600	68,376.00	0.02
571	000066	长城电脑	5,300	67,575.00	0.02
572	600415	小商品城	10,900	67,362.00	0.02
573	600826	兰生股份	2,500	65,450.00	0.02
574	002669	康达新材	2,700	65,340.00	0.02
575	002326	永太科技	3,200	65,280.00	0.02
576	000425	徐工机械	21,100	64,566.00	0.02
577	600426	华鲁恒升	7,280	64,136.80	0.02
578	002219	恒康医疗	5,800	64,090.00	0.02
579	000416	民生控股	8,400	63,840.00	0.02
580	300515	三德科技	1,355	63,508.85	0.02

581	300274	阳光电源	2,600	63,440.00	0.02
582	600418	江淮汽车	5,000	63,400.00	0.02
583	002267	陕天然气	6,000	63,000.00	0.02
584	002771	真视通	600	62,970.00	0.02
585	600100	同方股份	4,200	62,832.00	0.02
586	002508	老板电器	1,700	62,509.00	0.02
587	002327	富安娜	7,300	62,123.00	0.02
588	600755	厦门国贸	7,800	62,010.00	0.02
589	000418	小天鹅 A	1,900	61,978.00	0.02
590	000006	深振业 A	8,400	61,908.00	0.02
591	600397	安源煤业	14,000	61,880.00	0.02
592	600005	武钢股份	22,400	61,824.00	0.02
593	600566	济川药业	2,400	61,776.00	0.02
594	300075	数字政通	2,400	61,560.00	0.02
595	300518	盛讯达	1,306	61,186.10	0.02
596	000786	北新建材	6,700	60,836.00	0.02
597	002202	金风科技	4,000	60,520.00	0.02
598	600180	瑞茂通	4,000	60,440.00	0.02
599	300373	扬杰科技	2,500	60,275.00	0.02
600	000669	金鸿能源	3,600	60,120.00	0.02
601	000671	阳光城	10,100	59,994.00	0.02
602	000513	丽珠集团	1,300	59,943.00	0.02
603	002180	艾派克	2,100	59,913.00	0.02
604	002294	信立泰	2,200	59,840.00	0.02
605	600325	华发股份	5,400	59,778.00	0.02
606	000887	中鼎股份	2,700	59,697.00	0.02
607	300422	博世科	1,800	59,652.00	0.02
608	002503	搜于特	4,800	59,616.00	0.02
609	000801	四川九洲	4,800	59,136.00	0.02
610	601718	际华集团	7,700	58,828.00	0.02

611	600056	中国医药	3,700	58,682.00	0.02
612	002424	贵州百灵	3,400	58,480.00	0.02
613	000581	威孚高科	2,900	58,464.00	0.02
614	600519	贵州茅台	200	58,384.00	0.02
615	000898	鞍钢股份	15,200	58,216.00	0.02
616	600466	蓝光发展	6,800	58,208.00	0.02
617	300346	南大光电	1,300	58,149.00	0.02
618	002588	史丹利	4,700	58,045.00	0.02
619	600867	通化东宝	2,800	57,932.00	0.02
620	600211	西藏药业	1,300	57,668.00	0.02
621	600153	建发股份	4,800	57,600.00	0.02
622	000596	古井贡酒	1,200	57,540.00	0.02
623	002701	奥瑞金	6,500	57,395.00	0.02
624	600201	生物股份	2,100	57,393.00	0.02
625	000951	中国重汽	6,000	57,360.00	0.02
626	002038	双鹭药业	1,900	57,342.00	0.02
627	600323	瀚蓝环境	4,500	57,105.00	0.02
628	002605	姚记扑克	3,500	57,085.00	0.02
629	601369	陕鼓动力	8,900	56,782.00	0.02
630	000892	星美联合	4,000	56,600.00	0.02
631	601668	中国建筑	10,568	56,221.76	0.02
632	300285	国瓷材料	1,400	55,846.00	0.02
633	603019	中科曙光	1,400	55,748.00	0.02
634	300467	迅游科技	900	55,692.00	0.02
635	600893	中航动力	1,600	55,440.00	0.02
636	002111	威海广泰	2,100	55,209.00	0.02
637	600887	伊利股份	3,300	55,011.00	0.02
638	600271	航天信息	2,300	54,740.00	0.02
639	600643	爱建集团	5,600	54,712.00	0.02
640	000931	中关村	6,800	54,264.00	0.02

641	300143	星河生物	2,300	53,705.00	0.02
642	600079	人福医药	3,200	53,664.00	0.02
643	600795	国电电力	18,300	53,619.00	0.02
644	002437	誉衡药业	6,100	53,070.00	0.02
645	000030	富奥股份	7,400	53,058.00	0.02
646	000063	中兴通讯	3,700	53,058.00	0.02
647	600251	冠农股份	6,600	52,800.00	0.02
648	600048	XD保利地	6,100	52,643.00	0.02
649	002230	科大讯飞	1,600	52,560.00	0.02
650	300070	碧水源	3,500	52,080.00	0.02
651	000652	泰达股份	11,300	51,980.00	0.02
652	000599	青岛双星	7,500	51,600.00	0.02
653	002005	德豪润达	8,700	51,417.00	0.02
654	002200	云投生态	2,700	50,922.00	0.02
655	600801	华新水泥	8,000	50,480.00	0.02
656	000825	太钢不锈	15,900	50,244.00	0.02
657	002236	大华股份	3,800	49,780.00	0.02
658	601699	潞安环能	7,600	49,704.00	0.02
659	002422	科伦药业	3,200	49,312.00	0.02
660	600885	宏发股份	1,600	49,136.00	0.02
661	600388	龙净环保	3,900	48,984.00	0.02
662	002028	思源电气	4,400	48,180.00	0.02
663	600485	信威集团	2,700	48,168.00	0.02
664	601003	柳钢股份	12,300	47,970.00	0.02
665	000807	云铝股份	7,300	47,815.00	0.02
666	002743	富煌钢构	3,300	47,586.00	0.02
667	600300	维维股份	8,000	47,520.00	0.02
668	600416	湘电股份	3,800	47,386.00	0.02
669	300055	万邦达	2,600	47,346.00	0.02
670	601992	金隅股份	6,100	47,275.00	0.02

671	002250	联化科技	3,300	47,256.00	0.02
672	002799	环球印务	1,080	47,131.20	0.02
673	600112	天成控股	4,200	46,872.00	0.02
674	002165	红宝丽	5,000	46,700.00	0.02
675	300211	亿通科技	3,400	46,682.00	0.02
676	600386	北巴传媒	2,500	46,650.00	0.02
677	600874	创业环保	6,000	46,620.00	0.02
678	002188	巴士在线	1,600	46,288.00	0.02
679	000709	河钢股份	16,700	46,259.00	0.01
680	002427	尤夫股份	2,300	46,161.00	0.01
681	600141	兴发集团	4,000	46,080.00	0.01
682	601225	陕西煤业	8,900	46,013.00	0.01
683	601872	招商轮船	9,800	45,864.00	0.01
684	600157	永泰能源	11,600	45,704.00	0.01
685	000939	凯迪生态	5,100	45,645.00	0.01
686	601101	昊华能源	7,200	45,576.00	0.01
687	600177	雅戈尔	3,300	45,507.00	0.01
688	002131	利欧股份	2,655	45,373.95	0.01
689	002138	顺络电子	2,500	45,325.00	0.01
690	600963	岳阳林纸	7,400	45,288.00	0.01
691	000009	中国宝安	3,300	45,210.00	0.01
692	600500	中化国际	5,000	45,200.00	0.01
693	000415	渤海金控	6,600	45,012.00	0.01
694	600309	万华化学	2,600	44,980.00	0.01
695	000623	吉林敖东	1,800	44,910.00	0.01
696	002431	棕榈股份	3,900	44,850.00	0.01
697	000528	柳工	6,900	44,712.00	0.01
698	000793	华闻传媒	4,500	44,460.00	0.01
699	000027	深圳能源	6,950	44,341.00	0.01
700	300231	银信科技	2,400	44,256.00	0.01



701	002531	天顺风能	6,900	44,229.00	0.01
702	600021	上海电力	4,300	44,161.00	0.01
703	000069	华侨城 A	6,900	44,160.00	0.01
704	002090	金智科技	1,500	44,055.00	0.01
705	600551	时代出版	2,200	43,912.00	0.01
706	600998	九州通	2,500	43,775.00	0.01
707	600825	新华传媒	5,500	43,725.00	0.01
708	600115	东方航空	6,600	43,626.00	0.01
709	002655	共达电声	2,700	43,605.00	0.01
710	601866	中海集运	11,000	43,560.00	0.01
711	000719	大地传媒	4,100	43,296.00	0.01
712	002489	浙江永强	5,400	42,768.00	0.01
713	000536	华映科技	2,600	41,808.00	0.01
714	600004	白云机场	3,400	41,684.00	0.01
715	600337	美克家居	3,200	41,632.00	0.01
716	601688	华泰证券	2,200	41,624.00	0.01
717	601607	上海医药	2,300	41,515.00	0.01
718	600075	新疆天业	3,600	41,436.00	0.01
719	002504	弘高创意	1,700	41,140.00	0.01
720	000421	南京中北	4,100	41,041.00	0.01
721	600582	天地科技	9,000	40,500.00	0.01
722	600959	江苏有线	2,900	40,484.00	0.01
723	600894	广日股份	3,000	39,990.00	0.01
724	600252	中恒集团	9,200	39,928.00	0.01
725	600859	王府井	2,600	39,624.00	0.01
726	600216	浙江医药	3,000	39,570.00	0.01
727	002216	三全食品	4,600	39,560.00	0.01
728	600782	新钢股份	7,400	39,442.00	0.01
729	300067	安诺其	4,600	38,594.00	0.01
730	601618	中国中冶	10,400	38,376.00	0.01

731	000959	首钢股份	10,300	38,110.00	0.01
732	000708	大冶特钢	3,400	38,080.00	0.01
733	600028	中国石化	8,000	37,760.00	0.01
734	600509	天富能源	5,100	37,485.00	0.01
735	601965	中国汽研	3,900	37,479.00	0.01
736	000625	长安汽车	2,700	36,909.00	0.01
737	600382	广东明珠	2,300	36,800.00	0.01
738	002128	露天煤业	4,900	36,799.00	0.01
739	002665	首航节能	4,600	36,294.00	0.01
740	600184	光电股份	1,600	36,224.00	0.01
741	601333	广深铁路	9,200	35,972.00	0.01
742	601216	君正集团	4,800	35,856.00	0.01
743	601678	滨化股份	7,000	35,630.00	0.01
744	600068	葛洲坝	6,100	35,502.00	0.01
745	000685	中山公用	3,400	35,292.00	0.01
746	600585	海螺水泥	2,400	34,896.00	0.01
747	603958	哈森股份	2,372	34,394.00	0.01
748	000543	皖能电力	4,800	34,272.00	0.01
749	600970	中材国际	5,400	34,020.00	0.01
750	000572	海马汽车	6,300	32,697.00	0.01
751	300111	向日葵	6,500	31,850.00	0.01
752	600496	精工钢构	7,400	31,524.00	0.01
753	000600	建投能源	3,600	31,428.00	0.01
754	002233	塔牌集团	3,900	31,317.00	0.01
755	601966	玲珑轮胎	2,191	28,439.18	0.01
756	600720	祁连山	4,000	26,840.00	0.01
757	002392	北京利尔	5,300	26,182.00	0.01
758	002802	洪汇新材	1,629	24,565.32	0.01
759	600507	方大特钢	5,000	24,000.00	0.01
760	002063	远光软件	1,500	23,175.00	0.01

761	300343	联创股份	1,000	21,710.00	0.01
762	600483	福能股份	1,800	20,430.00	0.01
763	603909	合诚股份	1,095	20,126.10	0.01
764	300085	银之杰	600	17,940.00	0.01
765	600158	中体产业	1,000	17,750.00	0.01
766	600503	华丽家族	1,800	16,506.00	0.01
767	000552	靖远煤电	4,600	16,192.00	0.01
768	603699	纽威股份	900	15,966.00	0.01
769	600376	首开股份	1,400	15,568.00	0.01
770	600138	中青旅	800	15,456.00	0.01
771	603169	兰石重装	1,200	14,952.00	0.00
772	000852	石化机械	1,000	14,870.00	0.00
773	600094	大名城	1,500	14,250.00	0.00
774	603016	新宏泰	1,602	13,600.98	0.00
775	600516	方大炭素	1,400	12,796.00	0.00
776	002221	东华能源	1,000	12,190.00	0.00
777	600064	南京高科	800	11,960.00	0.00
778	600556	慧球科技	700	11,060.00	0.00
779	600704	物产中大	1,170	10,951.20	0.00
780	600067	冠城大通	1,500	10,815.00	0.00
781	002249	大洋电机	900	10,773.00	0.00
782	000616	海航投资	2,000	10,680.00	0.00
783	600811	东方集团	1,600	10,656.00	0.00
784	600639	浦东金桥	400	9,992.00	0.00
785	002419	天虹商场	800	9,568.00	0.00
786	000926	福星股份	800	9,384.00	0.00
787	300520	科大国创	926	9,306.30	0.00
788	002244	滨江集团	1,300	8,710.00	0.00
789	000961	中南建设	1,500	8,415.00	0.00
790	000897	津滨发展	1,800	6,966.00	0.00

791	002271	东方雨虹	400	6,892.00	0.00
792	000979	中弘股份	2,500	6,850.00	0.00
793	000620	新华联	700	6,405.00	0.00
794	600773	西藏城投	400	6,268.00	0.00
795	000631	顺发恒业	1,200	5,844.00	0.00
796	600748	上实发展	600	5,784.00	0.00
797	002805	丰元股份	971	5,631.80	0.00
798	601336	新华保险	100	4,040.00	0.00
799	601318	中国平安	100	3,204.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002195	二三四五	13,775,606.14	4.46
2	002643	万润股份	11,235,524.50	3.64
3	002235	安妮股份	10,508,242.15	3.41
4	000060	中金岭南	9,592,811.12	3.11
5	002024	苏宁云商	9,581,562.38	3.11
6	000878	云南铜业	9,414,391.56	3.05
7	002048	宁波华翔	9,381,683.15	3.04
8	000158	常山股份	9,040,355.67	2.93
9	002094	青岛金王	8,995,595.26	2.92
10	300228	富瑞特装	8,459,285.90	2.74
11	000807	云铝股份	8,263,677.33	2.68
12	002151	北斗星通	7,875,868.25	2.55
13	000977	浪潮信息	7,780,070.33	2.52
14	300073	当升科技	7,257,224.38	2.35
15	600872	中炬高新	7,217,406.40	2.34
16	002241	歌尔声学	7,010,534.38	2.27

17	601928	凤凰传媒	6,918,769.57	2.24
18	600666	奥瑞德	6,665,711.47	2.16
19	600266	北京城建	6,371,021.00	2.06
20	002548	金新农	6,321,313.27	2.05
21	000735	罗牛山	6,291,760.99	2.04
22	000860	顺鑫农业	6,285,584.00	2.04

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	002195	二三四五	13,200,437.80	4.28
2	002643	万润股份	10,200,860.70	3.31
3	002235	安妮股份	10,147,355.88	3.29
4	002048	宁波华翔	9,415,689.32	3.05
5	000060	中金岭南	9,144,195.50	2.96
6	002024	苏宁云商	9,096,997.50	2.95
7	000158	常山股份	8,946,366.22	2.90
8	300073	当升科技	8,693,658.40	2.82
9	000878	云南铜业	8,673,158.48	2.81
10	000807	云铝股份	8,552,014.25	2.77
11	002151	北斗星通	8,127,458.23	2.63
12	300228	富瑞特装	8,113,411.00	2.63
13	000977	浪潮信息	7,921,859.96	2.57
14	002548	金新农	7,431,880.90	2.41
15	600872	中炬高新	7,149,206.18	2.32
16	601928	凤凰传媒	7,035,152.01	2.28
17	002241	歌尔声学	6,961,200.89	2.26
18	300100	双林股份	6,722,732.24	2.18
19	000735	罗牛山	6,619,167.00	2.15

20	000860	顺鑫农业	6,613,230.00	2.14
21	000983	西山煤电	6,565,856.86	2.13
22	600666	奥瑞德	6,424,744.50	2.08

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,490,924,055.08
卖出股票的收入（成交）总额	1,310,845,614.33

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

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 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（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1612	中证500指数	24	27,149,760.00	2,986,760.00	
IC1609	中证500指数	-16	-18,784,640	-771,080.00	

			.00		
公允价值变动总额合计(元)					2,215,680.00
股指期货投资本期收益(元)					3,756,912.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					2,215,680.00

### 7.10.2 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 7.11.2 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。

#### 7.11.3 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。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,075,508.52
2	应收证券清算款	11,979,528.73
3	应收股利	—
4	应收利息	19,458.47
5	应收申购款	34,814.67
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	18,109,310.39

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

本报告中因四舍五入原因，投资组合报告中市值占总资产或净资产比例的分项之和与合计可能存在尾差。

### § 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,227	90,397.36	197,637.46	0.07%	291,514,631.80	99.93%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,545,243.01	0.53%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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基金	>100



本基金基金经理持有本基金	50~100
--------------	--------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年1月13日)基金份额总额	506,409,681.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	8,828,584.60
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	223,525,997.32
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	—
本报告期期末基金份额总额	291,712,269.26

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人于2016年5月7日发布公告，卞玺云女士自2016年5月7日起担任中欧基金管理有限公司督察长职务。相关变更事项已按规定向中国基金业协会办理相关手续并向中国证监会和上海证监局报告。

#### 10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(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。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	2	1,059,707,441.85	37.84%	986,905.86	37.84%	—
国金证券	1	611,445,086.01	21.83%	569,439.92	21.83%	—
国信证券	1	333,391,916.08	11.9%	310,487.97	11.9%	—
东北证券	1	231,324,661.12	8.26%	215,432.94	8.26%	—
广发证券	2	214,620,812.63	7.66%	199,874.91	7.66%	—
华泰证券	1	208,251,737.52	7.44%	193,945.52	7.44%	—
中信证券	1	99,685,824.18	3.56%	92,838.05	3.56%	—
申银万国	1	20,015,590.29	0.71%	18,640.55	0.71%	—
兴业证券	1	14,832,591.55	0.53%	13,813.7	0.53%	—
东吴证券	1	7,389,669.18	0.26%	6,882.04	0.26%	—
海通证券	1	—	—	—	—	—
中信建投	1	—	—	—	—	—
光大证券	1	—	—	—	—	—

东方证券	1	—	—	—	—	—
平安证券	1	—	—	—	—	—
安信证券	1	—	—	—	—	—
东兴证券	1	—	—	—	—	—
国泰君安	1	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	1	—	—	—	—	—
中投证券	1	—	—	—	—	—
西南证券	1	—	—	—	—	—

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

2.本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
国都证券	—	—	535,000,000	16.41%	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	2,685,000,000	82.36%	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	40,000,000	1.23%	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—

中信建投	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	—	—	—	—	—	—
中投证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司督察长离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
2	中欧基金管理有限公司关于中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集时间的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-11
3	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生效公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-14
4	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-20
5	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“宝通科技”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-27
6	中欧数据挖掘多因子混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-16
7	中欧基金管理有限公司代行督察	中国证监会指定报刊及网	2016-02-19

	长公告	站	
8	中欧基金管理有限公司关于中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-19
9	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-25
10	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增同花顺为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-18
11	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行开展的申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-30
12	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增盈米财富为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-30
13	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长安汽车”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-31
14	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金互相转换范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-15
15	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-21
16	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-28
17	中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-07
18	中欧基金管理有限公司关于新增金牛理财为旗下部分基金代销机	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-16

	构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告		
19	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行开通基金转换和定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-23
20	中欧基金管理有限公司关于新增浦发银行为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-25
21	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-17
22	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-28

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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报纸上公开披露的各项公告

### 11.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 11.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

二〇一六年八月二十四日