

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告

2017年06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：2017年08月29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2017年8月28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2017年1月1日起至2017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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§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	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47
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	47
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	47
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	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	48
7.12 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§9 开放式基金份额变动	50
§10 重大事件揭示	50
10.1 基金份额持有人大会决议	50

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	50
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4	基金投资策略的改变	51
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况	51
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8	其他重大事件	54
§11	影响投资者决策的其他重要信息	57
§12	备查文件目录	57
12.1	备查文件目录	57
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 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	317,674,530.09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A	中欧数据挖掘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	317,150,734.02份	523,796.07份

注：自2017年1月19日起,本基金增加C类份额，登记机构为中欧基金管理有限公司，原份额更名为A类份额。

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333号五层	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》、《证券日报》
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

单位：人民币元

	中欧数据挖掘A	中欧数据挖掘C
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日 -2017年06月30日）	报告期（2017年1月19日至 2017年6月30日）
本期已实现收益	-21,517,434.32	-33,487.72
本期利润	-10,104,194.96	-15,611.07
加权平均基金份额本期利润	-0.0313	-0.0391
本期加权平均净值利润率	-3.13%	-3.95%
本期基金份额净值增长率	-3.18%	-0.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)	
期末可供分配利润	-10,568,738.65	-19,833.62
期末可供分配基金份额利润	-0.0333	-0.0379
期末基金资产净值	311,075,668.46	511,307.84
期末基金份额净值	0.9808	0.9762
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.56%	-0.89%

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、本基金于2017年1月19日增加C类份额，增加份额当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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 (中欧数据挖掘A)	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	3.82%	0.62%	3.34%	0.41%	0.48%	0.21%

过去三个月	-3.47%	0.67%	3.28%	0.38%	-6.75%	0.29%
过去六个月	-3.18%	0.59%	5.48%	0.35%	-8.66%	0.24%
过去一年	0.71%	0.58%	8.05%	0.41%	-7.34%	0.17%
自基金合同生效起至今	6.56%	0.84%	6.95%	0.63%	-0.39%	0.21%

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。

阶段 (中欧数据挖掘C)	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	3.75%	0.62%	3.34%	0.41%	0.41%	0.21%
过去三个月	-3.66%	0.67%	3.28%	0.38%	-6.94%	0.29%
自基金份额起始运作日起至今	-0.89%	0.57%	5.26%	0.36%	-6.15%	0.21%

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A

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年01月13日-2017年06月30日)

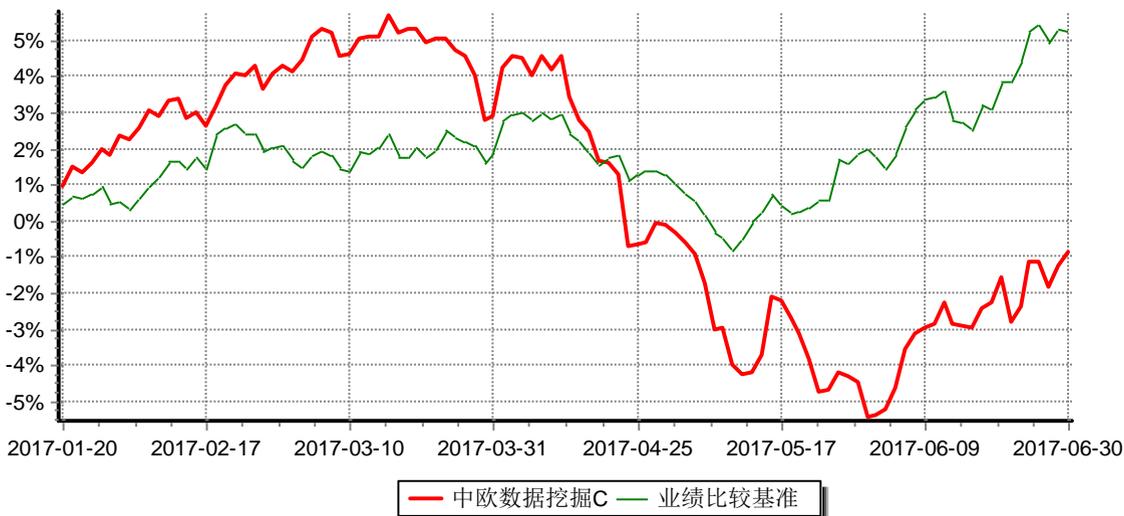


注：本基金合同生效日期为2016年1月13日，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例已达到合同的规定。

中欧数据挖掘C

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年01月20日-2017年06月30日)



注：自2017年1月19日起本基金增加C类份额，图示日期为2017年1月20日至2017年6月30日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7

月19日正式成立。股东为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2017年6月30日，本基金管理人共管理57只开放式基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
曲径	基金经理, 事业部负责人	2016年01月13日	—	10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1日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。

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

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

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1次，为量化组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，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

2017年以来A股市场市场波动率和风险较低，利率市场收紧和金融板块去杠杆的市场环境下，大盘龙头股行走出了稳定上涨的行情，整体趋势上行。在报告期内，我们利用量化模型配置了热点板块及其价值洼地，并搭配基于分析师的事件套利、预测高分红、业绩预告超预期，以获取选股收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金A类份额净值增长率为-3.18%，同期业绩比较基准增长率为5.48%；C类份额净值增长率为-0.89%，同期业绩比较基准增长率为5.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为，央行维持谨慎中性货币政策的环境下，流动性收紧已经从银行间逐渐传到资本市场，同时观察到，在6月底市场流动性收紧已经达到边界极值，流动性紧张略有宽松，因此在下半年，我们继续看好此前超跌且有业绩支撑的中盘蓝筹。

未来我们将维持一贯操作方式，利用量化择时模型判断仓位，采纳量化选股模块进行具体热点板块和相关个股的配置，同时关注基于分析师行为的事件套利模块，挑选估值合理，盈利质量较高的相关个股和板块。

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中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2017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：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	22,311,951.33	89,248,656.97
结算备付金		7,493,806.73	3,628,538.76
存出保证金		3,526,448.13	5,959,211.71
交易性金融资产	6.4.7.2	239,895,092.17	143,780,148.56
其中：股票投资		239,895,092.17	143,780,148.56
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	40,000,000.00	200,000,000.00
应收证券清算款		—	5,198,449.95
应收利息	6.4.7.5	70,665.48	227,373.66
应收股利		—	—
应收申购款		14,548.51	306,819.94
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		313,312,512.35	448,349,199.55
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
负债：			

短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	44,203,351.90
应付赎回款		68,575.17	516,921.91
应付管理人报酬		382,417.14	451,704.97
应付托管费		63,736.19	75,284.18
应付销售服务费		324.10	—
应付交易费用	6.4.7.7	937,651.85	1,015,456.44
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	272,831.60	366,940.19
负债合计		1,725,536.05	46,629,659.59
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	317,674,530.09	396,481,150.92
未分配利润	6.4.7.10	-6,087,553.79	5,238,389.04
所有者权益合计		311,586,976.30	401,719,539.96
负债和所有者权益总计		313,312,512.35	448,349,199.55

注：报告截止日2017年6月30日，中欧数据挖掘A类基金份额净值0.9808元，基金份额317,150,734.02份；中欧数据挖掘C类基金份额净值0.9762元，基金份额523,796.07份。

6.2 利润表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	2016年1月13日（基金 合同生效日）至2016 年6月30日
一、收入		-3,139,400.11	31,933,911.96

1.利息收入		2,152,158.92	1,069,231.08
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	208,400.78	483,771.94
债券利息收入		19.33	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		1,943,738.81	585,459.14
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”号填列）		-17,231,498.78	18,024,421.61
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	-17,944,924.84	13,618,103.78
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .13	7,565.77	—
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	-950,796.42	3,756,912.00
股利收益	6.4.7 .15	1,656,656.71	649,405.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7 .16	11,431,116.01	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	508,823.74	685,330.33
减：二、费用		6,980,405.92	7,872,801.25
1. 管理人报酬		2,732,641.71	2,980,779.45
2. 托管费		455,440.30	496,796.62
3. 销售服务费		1,552.41	—

4. 交易费用	6.47 .18	3,621,057.71	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	6.47 .19	169,713.79	214,238.28
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-10,119,806.03	24,061,110.71
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-10,119,806.03	24,061,110.71

注: 本基金合同于2016年1月13日生效, 同时自2017年1月19日增加C类份额, 基金合同生效及增加份额当期的相关数据和指标按实际存续期计算, 下同。

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: 2017年01月01日-2017年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06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)	396,481,150.92	5,238,389.04	401,719,539.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-10,119,806.03	-10,119,806.03
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)	-78,806,620.83	-1,206,136.80	-80,012,757.63
其中: 1.基金申购款	69,179,040.39	1,399,110.50	70,578,150.89
2.基金赎回款	-147,985,661.22	-2,605,247.30	-150,590,908.52
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)	317,674,530.09	-6,087,553.79	311,586,976.30
项 目	上年度可比期间		
	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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]2423号文《关于准予中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资

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，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第57号验资报告予以验证。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(以下简称"中国工商银行")。

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）。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×60%+中债综合指数收益率×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2017年8月29日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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(以下简称"中国基金业协会")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、中国基金业协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2017年半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

无。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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政策的补充通知》、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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)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，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

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	22,311,951.33
定期存款	—
其中: 存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	22,311,951.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	230,931,871.85	239,895,092.17	8,963,220.32
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	—	—	—
其他	—	—	—
合计	230,931,871.85	239,895,092.17	8,963,220.32

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位: 人民币元

项目	本期末2017年06月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	

权益衍生工具	15,549,520.00	—	—	
股指期货	15,549,520.00			
其他衍生工具	—	—	—	
合计	15,549,520.00	—	—	

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0。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0。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）：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值 (元)	公允价值变 动(元)	风险指标说明
IC1712	IC1712	7	8,275,120.0 0	394,440.00	套保
IC1708	IC1708	6	7,274,400.0 0	82,920.00	套保
公允价值变动总额合计（元）					477,360.00
股指期货投资本期收益（元）					-950,796.42
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-271,023.58

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	40,000,000.00	—
合计	40,000,000.00	—

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:2017年06月30日

应收活期存款利息	4,671.27
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	1,767.10
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	64,109.61
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	117.50
合计	70,665.48

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 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	937,651.85
银行间市场应付交易费用	—
合计	937,651.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	36.15
预提信息披露费	242,887.01
预提审计费	29,752.78
应付转换费	155.66
合计	272,831.60

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘A)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	396,481,150.92	396,481,150.92
本期申购	68,652,874.65	68,652,874.65
本期赎回	-147,983,291.55	-147,983,291.55
本期末	317,150,734.02	317,150,734.02
项目 (中欧数据挖掘C)	基金份额(份)	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	—	—
本期申购	526,165.74	526,165.74
本期赎回	-2,369.67	-2,369.67
本期末	523,796.07	523,796.07

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	13,409,265.98	-8,170,876.94	5,238,389.04
本期利润	-21,517,434.32	11,413,239.36	-10,104,194.96
本期基金份额交易产生的变动数	-2,460,570.31	1,251,310.67	-1,209,259.64
其中：基金申购款	2,262,041.38	-865,951.63	1,396,089.75
基金赎回款	-4,722,611.69	2,117,262.30	-2,605,349.39
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-10,568,738.65	4,493,673.09	-6,075,065.56

单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	—	—	—
本期利润	-33,487.72	17,876.65	-15,611.07
本期基金份额交易产生的变动数	13,654.10	-10,531.26	3,122.84
其中：基金申购款	13,557.79	-10,537.04	3,020.75
基金赎回款	96.31	5.78	102.09
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-19,833.62	7,345.39	-12,488.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	165,376.76
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	40,631.57
其他	2,392.45
合计	208,400.78

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 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-17,944,924.84
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	-17,944,924.84

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 2017年01月01日-2017年06月30日
卖出股票成交总额	1,155,810,547.95
减：卖出股票成本总额	1,173,755,472.79
买卖股票差价收入	-17,944,924.84

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30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	7,565.77
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	7,565.77

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	217,585.18
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	210,000.00
减：应收利息总额	19.41
买卖债券差价收入	7,565.77

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 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 2017年01月01日-2017年06月30日
期货	-950,796.42

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,656,656.71
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,656,656.71

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
1.交易性金融资产	11,702,139.59
——股票投资	11,702,139.59
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2.衍生工具	-271,023.58
——权证投资	—
——期货投资	-271,023.58
3.其他	—
合计	11,431,116.01

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
基金赎回费收入	480,856.33
转换费收入	27,967.41
合计	508,823.74

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
交易所市场交易费用	3,616,705.15
银行间市场交易费用	—
期货市场交易费用	4,352.56
合计	3,621,057.71

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
审计费用	24,752.78
信息披露费	142,887.01
帐户维护费	1,500.00
汇划手续费	574.00
合计	169,713.79

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

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 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月13日-2016年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	289,908,138.50	12.02%	1,059,707,441.85	37.84%

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 2017年01月01日-2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金	期末应付佣金余额	占应付佣金

		总量的比例		余额的比例
国都证券	269,990.41	12.02%	257,714.01	27.49%
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月13日-2016年06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	占应付佣金余额的比例
国都证券	986,905.86	37.84%	183,292.26	17.63%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月13日-2016年06月30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	217,585.10	100.00%	—	—

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 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月13日-2016年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	823,000,000.00	25.95%	535,000,000.00	16.41%

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 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月13日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,732,641.71	2,980,779.45
其中：支付销售机构的客户维护费	726,508.92	1,968,932.39

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月13日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	455,440.30	496,796.62

注：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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧数据挖掘A	中欧数据挖掘C	合计
国都证券	—	2.97	2.97
中欧基金	—	534.14	534.14
中国工商银行	—	—	—
合计	—	537.11	537.11

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性划付给基金管理人，由基金管理人支付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月 30日		上年度可比期间 2016年01月13日-2016年06月 30日	
	中欧数据挖掘 A	中欧数据挖 掘C	中欧数据挖掘 A	中欧数据挖 掘C
	期初持有的基金份额	—	—	—
期间申购/买入总份额	—	152,284.26	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	—	152,284.26	—	—
占基金总份额比例	—	29.07%	—	—

注：1、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。

2、本基金管理人于2017年1月20日通过中欧基金管理有限公司直销中心申购本基金C类份额150,000.00元，申购费用0元，符合本基金招募说明书的相关规定。

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 2017年01月01日-2017年06月30 日		上年度可比期间 2016年01月13日-2016年06月30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	22,311,951.33	165,376.76	65,880,150.74	439,028.67

注：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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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

6.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本基金本报告期内不存在利润分配情况。资产负债表日之后，半年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：6.4.8.2)。

6.4.12 期末（2017年06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

无。

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 (单位: 股)	期末 成本总额	期末 估值总额
000007	全新好	2017-01-16	筹划重大事项	13.05	2017-07-17	14.28	331,200	5,521,961.00	4,322,160.00
600643	爱建集团	2017-04-17	筹划重大事项	16.31	2017-08-02	16.48	265,300	4,037,488.51	4,327,043.00
000034	神州数码	2017-03-21	筹划重大事项	24.45	2017-07-18	22.01	67,100	1,598,261.00	1,640,595.00
002509	天广中茂	2017-06-12	筹划重大事项	9.20			35,220	299,120.63	324,024.00
002696	百洋股份	2017-06-22	重大资产重组	20.87	2017-07-03	21.74	122,820	2,526,672.00	2,563,253.40
30019	纳川	2017-	筹划重大	5.75			22,80	167,563.00	131,100.00

8	股份	04-20	事项				0		
300510	金冠电气	2017-03-10	重大资产重组	34.85	2017-07-11	35.00	61,700	1,943,370.70	2,150,245.00
300518	盛讯达	2016-12-13	重大资产重组	113.30	2017-07-10	101.97	700	92,103.00	79,310.00
600655	豫园商城	2016-12-20	筹划重大事项	11.32			8,400	94,062.00	95,088.00
601088	中国神华	2017-06-05	筹划重大事项	22.29			13,600	265,999.00	303,144.00
601717	郑煤机	2017-04-24	筹划重大事项	7.79			14,200	124,645.46	110,618.00
601919	中国远洋	2017-05-17	筹划重大事项	5.35	2017-07-26	5.89	686,400	3,680,441.00	3,672,240.00
603598	引力传媒	2017-05-10	筹划重大事项	16.21			66,300	1,094,814.02	1,074,723.00

注：本基金截至2017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。在有效控制组合风险的前提下，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发行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2017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 2017年06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	22,311,951.33	—	—	—	22,311,951.33
结算备付金	7,493,806.73	—	—	—	7,493,806.73
存出保证金	3,526,448.13	—	—	—	3,526,448.13
交易性金融资产	—	—	—	239,895,092.17	239,895,092.17
买入返售金融	40,000,000.	—	—	—	40,000,000.

资产	00				00
应收利息	—	—	—	70,665.48	70,665.48
应收申购款	—	—	—	14,548.51	14,548.51
资产总计	73,332,206.19	—	—	239,980,306.16	313,312,512.35
负债					
应付证券清算款	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	68,575.17	68,575.17
应付管理人报酬	—	—	—	382,417.14	382,417.14
应付托管费	—	—	—	63,736.19	63,736.19
应付销售服务费	—	—	—	324.10	324.10
应付交易费用	—	—	—	937,651.85	937,651.85
其他负债	—	—	—	272,831.60	272,831.60
负债总计	—	—	—	1,725,536.05	1,725,536.05
利率敏感度缺口	73,332,206.19	—	—	238,254,770.11	311,586,976.30
上年度末 2016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	89,248,656.97	—	—	—	89,248,656.97
结算备付金	3,628,538.76	—	—	—	3,628,538.76
存出保证金	5,959,211.71	—	—	—	5,959,211.71
交易性金融资产	—	—	—	143,780,148.56	143,780,148.56
买入返售金融	200,000,000	—	—	—	200,000,000

资产	.00				.00
应收证券清算款	—	—	—	5,198,449.95	5,198,449.95
应收利息	—	—	—	227,373.66	227,373.66
应收申购款	—	—	—	306,819.94	306,819.94
资产总计	298,836,407.44	—	—	149,512,792.11	448,349,199.55
负债					
应付证券清算款	—	—	—	44,203,351.90	44,203,351.90
应付赎回款	—	—	—	516,921.91	516,921.91
应付管理人报酬	—	—	—	451,704.97	451,704.97
应付托管费	—	—	—	75,284.18	75,284.18
应付交易费用	—	—	—	1,015,456.44	1,015,456.44
其他负债	—	—	—	366,940.19	366,940.19
负债总计	—	—	—	46,629,659.59	46,629,659.59
利率敏感度缺口	298,836,407.44	—	—	102,883,132.52	401,719,539.96

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2017年6月30日，本基金未持有交易性债券资产（2016年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人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

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016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	239,895,092.17	76.99	143,780,148.56	35.79
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	239,895,092.17	76.99	143,780,148.56	35.79

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 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日

	业绩比较基准上升5%	-1,181.63	2,025.16
	业绩比较基准下降5%	1,181.63	-2,025.16

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2017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219,101,548.77元，属于第二层次的余额为20,793,543.40元，无属于第三层次的余额（2016年12月31日：属于第一层次的余额为134,033,601.89元，属于第二层次的余额为9,746,546.67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2017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（2016年12月31日：同）。

(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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《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：(1)金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2)纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3)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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	239,895,092.17	76.57
	其中：股票	239,895,092.17	76.57
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	40,000,000.00	12.77
	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	29,805,758.06	9.51
7	其他各项资产	3,611,662.12	1.15
8	合计	313,312,512.35	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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,563,253.40	0.82
B	采矿业	745,932.00	0.24
C	制造业	151,755,242.30	48.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,563,854.00	1.79
E	建筑业	19,381,112.00	6.22
F	批发和零售业	8,780,001.50	2.82
G	交通运输、仓储和邮政业	9,146,536.85	2.94
H	住宿和餐饮业	4,322,160.00	1.39
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,208,857.00	2.96
J	金融业	15,259,279.00	4.90
K	房地产业	6,852,139.00	2.20
L	租赁和商务服务业	6,159,405.12	1.98
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	157,320.00	0.05
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	239,895,092.17	76.99

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

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	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

	码				值比例 (%)
1	002456	欧菲光	583,300	10,598,561.00	3.40
2	600076	康欣新材	1,012,700	9,083,919.00	2.92
3	002831	裕同科技	109,670	8,225,250.00	2.64
4	600582	天地科技	1,680,600	7,713,954.00	2.48
5	600196	复星医药	237,700	7,366,323.00	2.36
6	600066	宇通客车	324,400	7,127,068.00	2.29
7	600114	东睦股份	403,303	7,057,802.50	2.27
8	000065	北方国际	282,200	6,710,716.00	2.15
9	601231	环旭电子	414,100	6,505,511.00	2.09
10	002050	三花智控	389,199	6,351,727.68	2.04
11	002640	跨境通	282,842	6,010,392.50	1.93
12	600466	蓝光发展	694,900	5,996,987.00	1.92
13	002310	东方园林	350,400	5,858,688.00	1.88
14	000858	五粮液	104,500	5,816,470.00	1.87
15	600491	龙元建设	540,600	5,800,638.00	1.86
16	300302	同有科技	321,700	5,793,817.00	1.86
17	300124	汇川技术	198,504	5,069,792.16	1.63
18	600270	外运发展	263,645	4,990,799.85	1.60
19	601888	中国国旅	164,408	4,955,257.12	1.59
20	300083	劲胜智能	526,500	4,864,860.00	1.56
21	300203	聚光科技	170,639	4,798,368.68	1.54
22	002182	云海金属	515,600	4,738,364.00	1.52
23	000895	双汇发展	198,200	4,707,250.00	1.51
24	600019	宝钢股份	687,800	4,615,138.00	1.48
25	300430	诚益通	130,380	4,542,439.20	1.46
26	002543	万和电气	180,000	4,422,600.00	1.42
27	600643	爱建集团	265,300	4,327,043.00	1.39
28	000007	全新好	331,200	4,322,160.00	1.39
29	300395	菲利华	283,100	4,147,415.00	1.33
30	601919	中国远洋	686,400	3,672,240.00	1.18

31	600110	诺德股份	251,400	3,542,226.00	1.14
32	600310	桂东电力	505,600	3,468,416.00	1.11
33	603600	永艺股份	196,350	3,231,921.00	1.04
34	600686	金龙汽车	232,000	3,085,600.00	0.99
35	600176	中国巨石	278,900	3,062,322.00	0.98
36	002223	鱼跃医疗	128,900	3,052,352.00	0.98
37	300496	中科创达	100,000	2,830,000.00	0.91
38	300432	富临精工	115,300	2,755,670.00	0.88
39	002696	百洋股份	122,820	2,563,253.40	0.82
40	601318	中国平安	51,100	2,535,071.00	0.81
41	002206	海利得	336,000	2,496,480.00	0.80
42	000902	新洋丰	275,000	2,475,000.00	0.79
43	300510	金冠电气	61,700	2,150,245.00	0.69
44	002838	道恩股份	60,000	2,148,000.00	0.69
45	601166	兴业银行	116,000	1,955,760.00	0.63
46	601818	光大银行	481,200	1,948,860.00	0.63
47	002479	富春环保	151,600	1,804,040.00	0.58
48	601988	中国银行	470,100	1,739,370.00	0.56
49	000776	广发证券	96,100	1,657,725.00	0.53
50	000034	神州数码	67,100	1,640,595.00	0.53
51	000686	东北证券	109,000	1,095,450.00	0.35
52	603598	引力传媒	66,300	1,074,723.00	0.34
53	002462	嘉事堂	15,000	589,350.00	0.19
54	000725	京东方A	132,700	552,032.00	0.18
55	601668	中国建筑	54,200	524,656.00	0.17
56	002081	金螳螂	44,300	486,414.00	0.16
57	000039	中集集团	24,100	434,523.00	0.14
58	600028	中国石化	61,200	362,916.00	0.12
59	000625	长安汽车	24,000	346,080.00	0.11
60	002152	广电运通	40,800	339,048.00	0.11
61	600750	江中药业	9,600	333,600.00	0.11

62	600104	上汽集团	10,600	329,130.00	0.11
63	002585	双星新材	42,120	325,587.60	0.10
64	002509	天广中茂	35,220	324,024.00	0.10
65	300182	捷成股份	32,500	310,700.00	0.10
66	000821	京山轻机	23,000	305,210.00	0.10
67	601088	中国神华	13,600	303,144.00	0.10
68	002244	滨江集团	43,200	298,944.00	0.10
69	000402	金融街	25,000	293,000.00	0.09
70	600011	华能国际	39,700	291,398.00	0.09
71	300156	神雾环保	8,500	278,460.00	0.09
72	600048	保利地产	26,400	263,208.00	0.08
73	002087	新野纺织	45,200	255,380.00	0.08
74	600690	青岛海尔	15,200	228,760.00	0.07
75	601933	永辉超市	32,200	227,976.00	0.07
76	000488	晨鸣纸业	17,500	225,750.00	0.07
77	600518	康美药业	10,000	217,400.00	0.07
78	601607	上海医药	7,500	216,600.00	0.07
79	601006	大秦铁路	23,400	196,326.00	0.06
80	600637	东方明珠	9,000	195,030.00	0.06
81	600660	福耀玻璃	7,100	184,884.00	0.06
82	600529	山东药玻	6,900	169,533.00	0.05
83	000807	云铝股份	23,400	168,948.00	0.05
84	601111	中国国航	17,300	168,675.00	0.05
85	002466	天齐锂业	3,100	168,485.00	0.05
86	600054	黄山旅游	9,200	157,320.00	0.05
87	600741	华域汽车	6,400	155,136.00	0.05
88	300198	纳川股份	22,800	131,100.00	0.04
89	300063	天龙集团	15,500	129,425.00	0.04
90	600183	生益科技	9,700	119,698.00	0.04
91	600221	海南航空	36,800	118,496.00	0.04
92	601717	郑煤机	14,200	110,618.00	0.04

93	600720	祁连山	13,700	107,271.00	0.03
94	000876	新希望	12,600	103,572.00	0.03
95	600655	豫园商城	8,400	95,088.00	0.03
96	600089	特变电工	8,556	88,383.48	0.03
97	600583	海油工程	12,800	79,872.00	0.03
98	300518	盛讯达	700	79,310.00	0.03

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300154	瑞凌股份	12,251,312.61	3.05
2	300395	菲利华	12,044,457.59	3.00
3	600582	天地科技	10,631,853.00	2.65
4	002206	海利得	9,905,006.35	2.47
5	601231	环旭电子	9,696,209.80	2.41
6	600076	康欣新材	9,420,649.00	2.35
7	002441	众业达	9,412,461.20	2.34
8	002456	欧菲光	9,378,176.71	2.33
9	300430	诚益通	9,120,463.88	2.27
10	002696	百洋股份	9,009,209.50	2.24
11	000858	五粮液	8,982,996.52	2.24
12	601318	中国平安	8,905,008.20	2.22
13	002708	光洋股份	8,657,499.68	2.16
14	002640	跨境通	8,547,165.25	2.13
15	300390	天华超净	8,364,896.60	2.08
16	600310	桂东电力	8,283,407.62	2.06
17	000023	深天地A	8,094,340.94	2.01
18	300305	裕兴股份	8,066,721.50	2.01
19	600066	宇通客车	8,002,089.67	1.99

20	002244	滨江集团	7,976,558.00	1.99
----	--------	------	--------------	------

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	300154	瑞凌股份	11,555,920.60	2.88
2	300305	裕兴股份	10,037,367.53	2.50
3	000815	美利云	8,967,474.00	2.23
4	002441	众业达	8,944,245.15	2.23
5	300390	天华超净	8,569,141.45	2.13
6	002708	光洋股份	8,488,323.14	2.11
7	600090	同济堂	8,080,246.06	2.01
8	000023	深天地 A	7,950,383.53	1.98
9	603616	韩建河山	7,949,599.47	1.98
10	002244	滨江集团	7,783,949.00	1.94
11	601318	中国平安	7,620,076.68	1.90
12	300395	菲利华	7,303,570.67	1.82
13	600776	东方通信	7,275,780.87	1.81
14	000809	*ST新城	7,178,462.81	1.79
15	002206	海利得	7,073,893.48	1.76
16	300341	麦迪电气	7,067,910.30	1.76
17	002348	高乐股份	7,038,322.77	1.75
18	603008	喜临门	6,732,304.00	1.68
19	601117	中国化学	6,728,584.00	1.67
20	600054	黄山旅游	6,666,770.50	1.66

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

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,258,168,276.81
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,155,810,547.95
--------------	------------------

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)	风险指标说明
IC1712	IC1712	7	8,275,120.0 0	394,440.00	套保
IC1708	IC1708	6	7,274,400.0 0	82,920.00	套保
公允价值变动总额合计（元）					477,360.00
股指期货投资本期收益（元）					-950,796.42
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-271,023.58

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	3,526,448.13
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	70,665.48
5	应收申购款	14,548.51
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	3,611,662.12

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧数据挖掘A	3,273	96,899.09	159,838,420.13	50.40%	157,312,313.89	49.60%
中欧数据挖掘C	38	13,784.11	152,284.26	29.07%	371,511.81	70.93%
合计	3,311	95,945.19	159,990,704.39	50.36%	157,683,825.70	49.64%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧数据挖掘A	208,902.62	0.07%
	中欧数据挖掘C	249.38	0.05%
	合计	209,152.00	0.07%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量
----	------	-------------

		区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧数据挖掘A	0~10
	中欧数据挖掘C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧数据挖掘A	0
	中欧数据挖掘C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧数据挖掘A	中欧数据挖掘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	396,481,150.92	—
本报告期基金总申购份额	68,652,874.65	526,165.74
减：本报告期基金总赎回份额	147,983,291.55	2,369.67
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	317,150,734.02	523,796.07

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2017年3月30日发布公告，顾伟先生自2017年3月30日起担任中欧基金管理有限公司副总经理职务。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的情况

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	
中泰证券	1	335,076,290.22	13.89%	312,057.24	13.89%	
国都证券	2	289,908,138.5	12.02%	269,990.41	12.02%	
海通证券	1	280,851,217.67	11.64%	261,558.4	11.64%	
安信证券	1	237,010,782.96	9.82%	220,728.83	9.82%	
东吴证券	1	230,293,929.28	9.55%	214,476.45	9.55%	
光大证券	1	207,152,692.7	8.59%	192,920.45	8.59%	
中信证券	1	149,997,	6.22%	139,692.27	6.22%	

		162.37				
兴业证券	1	143,161,441.41	5.93%	133,323.49	5.93%	
国信证券	1	130,509,334.94	5.41%	121,541.72	5.41%	
国泰君安	1	104,988,651.96	4.35%	97,777.09	4.35%	
广发证券	2	103,873,072.97	4.31%	96,736.98	4.31%	
广州证券	1	81,693,996.45	3.39%	76,082.07	3.39%	
申银万国	1	72,976,991.82	3.02%	67,964.31	3.02%	
浙商证券	1	39,580,148.75	1.64%	36,861.86	1.64%	
天风证券	1	5,524,467.8	0.23%	5,144.83	0.23%	
东北证券	1	—	—	—	—	
东方证券	1	—	—	—	—	
东兴证券	1	—	—	—	—	
国金证券	1	—	—	—	—	
华泰证券	1	—	—	—	—	
平安证券	1	—	—	—	—	
申万宏源西部证券	1	—	—	—	—	
西部证券	1	—	—	—	—	
西南证券	1	—	—	—	—	
中投证券	1	—	—	—	—	
中信建投	1	—	—	—	—	

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

2.本报告期内,本基金新增天风证券、西部证券上海交易单元。

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
中泰证券	—	—	—	—	—	—
国都证券	217,585.1	100%	823,000,000	25.95%	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
安信证券	—	—	—	—	—	—
东吴证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
中信证券	—	—	665,000,000	20.96%	—	—
兴业证券	—	—	885,000,000	27.9%	—	—
国信证券	—	—	456,000,000	14.38%	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
广发证券	—	—	93,000,000	2.93%	—	—
广州证券	—	—	—	—	—	—
申银万国	—	—	—	—	—	—
浙商证券	—	—	250,000,000	7.88%	—	—
天风证券	—	—	—	—	—	—
东北证券	—	—	—	—	—	—
东方证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	—	—	—	—
国金证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
申万宏源西部证券	—	—	—	—	—	—

西部证券	—	—	—	—	—	—
西南证券	—	—	—	—	—	—
中投证券	—	—	—	—	—	—
中信建投	—	—	—	—	—	—

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,本基金新增天风证券、西部证券上海交易单元。

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关于旗下基金2016年12月31日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-01
2	中欧基金管理有限公司关于新增银河证券为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-09
3	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“高新兴”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-12
4	中欧基金管理有限公司关于新增京东金融-北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金代销机构并开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-17
5	中欧基金管理有限公司关于新增部分渠道为旗下部分基金代销机构并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	2017-01-19
6	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金增加C类份额、提高净值精度并相应修改基金合	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-19

	同的公告		
7	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（修订）	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-19
8	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4季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-01-20
9	中欧基金管理有限公司关于调整个人投资者开户证件类型公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-11
10	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过同花顺代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-16
11	中欧基金管理有限公司北京分公司办公地址变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-22
12	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-23
13	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（2017年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-25
14	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摘要（2017年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	2017-02-25
15	中欧基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-02
16	中欧基金管理有限公司关于新增国信证券为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-13
17	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构同步开通转换和定投业务并参	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-24

	与费率优惠活动的公告		
18	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过国信证券代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-28
19	中欧基金管理有限公司关于副总经理变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-30
20	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	2017-03-30
21	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
22	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告摘要	中国证监会指定报刊及网站	2017-03-31
23	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“省广股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-13
24	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2017年1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-21
25	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-22
26	中欧基金管理有限公司关于新增华夏财富为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-04-24
27	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“全新好”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-03
28	中欧基金管理有限公司关于新增汇成基金为旗下部分基金代销机构同步开通转换与定投业务并参	中国证监会指定报刊及网站	2017-05-16

	与费率优惠活动的公告		
29	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“爱建集团”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-22
30	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2017-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年1月1日至2017年6月30日	103,181,499.60	—	—	103,181,499.60	32.48%

产品特有风险

本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站(www.zofund.com)查阅，或在营业时间内至基金管理人、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
二〇一七年八月二十九日