

---

# 中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

## 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人:中欧基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

送出日期:2021 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2020年01月01日起至2020年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	91
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	92
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	92
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	92
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	92
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	92

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	93
8.12 投资组合报告附注 .....	93
§9 基金份额持有人信息 .....	94
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	94
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	94
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	95
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情 况 .....	95
§10 开放式基金份额变动 .....	95
§11 重大事件揭示 .....	96
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	96
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	96
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	96
11.4 基金投资策略的改变 .....	96
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	96
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	96
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	96
11.8 其他重大事件 .....	99
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	102
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	102
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	103
§13 备查文件目录 .....	103
13.1 备查文件目录 .....	103
13.2 存放地点 .....	103
13.3 查阅方式 .....	103

## § 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	560,977,859.55份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中欧数据挖掘混合A	中欧数据挖掘混合C
下属分级基金的交易代码	001990	004234
报告期末下属分级基金的份额总额	376,726,641.51份	184,251,218.04份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	中欧基金管理有限公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话	021-68609700、400-700-9700		95588
传真	021-33830351		010-66105798
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号五层		北京市西城区复兴门内大街5 5号
办公地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路333号五层		北京市西城区复兴门内大街5 5号
邮政编码	200120		100140
法定代表人	窦玉明		陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020年		2019年		2018年	
	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C
本期已实现收益	142,403,638.43	50,144,026.44	33,325,423.18	8,249,484.96	-15,043,277.16	-7,462,909.17
本期利润	173,070,341.50	69,275,089.58	42,754,901.81	9,430,391.23	-18,932,661.37	-9,428,066.68
加权平均基金份额本期利润	0.6516	0.6382	0.4858	0.3657	-0.1799	-0.3780
本期加权平均净值利润率	38.85%	38.82%	47.14%	35.63%	-19.05%	-41.99%
本期基金份额净值增长率	56.92%	55.68%	51.88%	50.44%	-19.34%	-19.77%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	285,000,395.06	129,313,188.01	30,542,125.66	7,739,300.53	-19,806,113.66	-4,414,808.80
期末可供分配基金份额利润	0.7565	0.7018	0.2277	0.1995	-0.1873	-0.1987
期末基金资产净值	729,683,458.73	345,787,358.17	165,585,472.32	46,756,925.76	85,948,840.64	17,807,150.11
期末基金份额净值	1.9369	1.8767	1.2343	1.2055	0.8127	0.8013
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020年末		2019年末		2018年末	
基金份额累计净值增长率	110.43%	90.53%	34.10%	22.39%	-11.71%	-18.65%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧数据挖掘混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.41%	1.15%	2.73%	1.10%	6.68%	0.05%
过去六个月	21.47%	1.43%	8.15%	1.38%	13.32%	0.05%
过去一年	56.92%	1.55%	19.92%	1.54%	37.00%	0.01%
过去三年	92.23%	1.45%	17.38%	1.20%	74.85%	0.25%
自基金合同生效起至今	110.43%	1.25%	32.29%	1.00%	78.14%	0.25%

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

中欧数据挖掘混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.19%	1.15%	2.73%	1.10%	6.46%	0.05%
过去六个月	20.99%	1.43%	8.15%	1.38%	12.84%	0.05%
过去一年	55.68%	1.55%	19.92%	1.54%	35.76%	0.01%
过去三年	87.90%	1.45%	17.38%	1.20%	70.52%	0.25%

自基金份额 运作日至今	90.53%	1.32%	30.20%	1.07%	60.33%	0.25%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	-------

注：本基金业绩比较基准为：中证 500 指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。比较基准每个交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

中欧数据挖掘混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年01月13日-2020年12月31日)



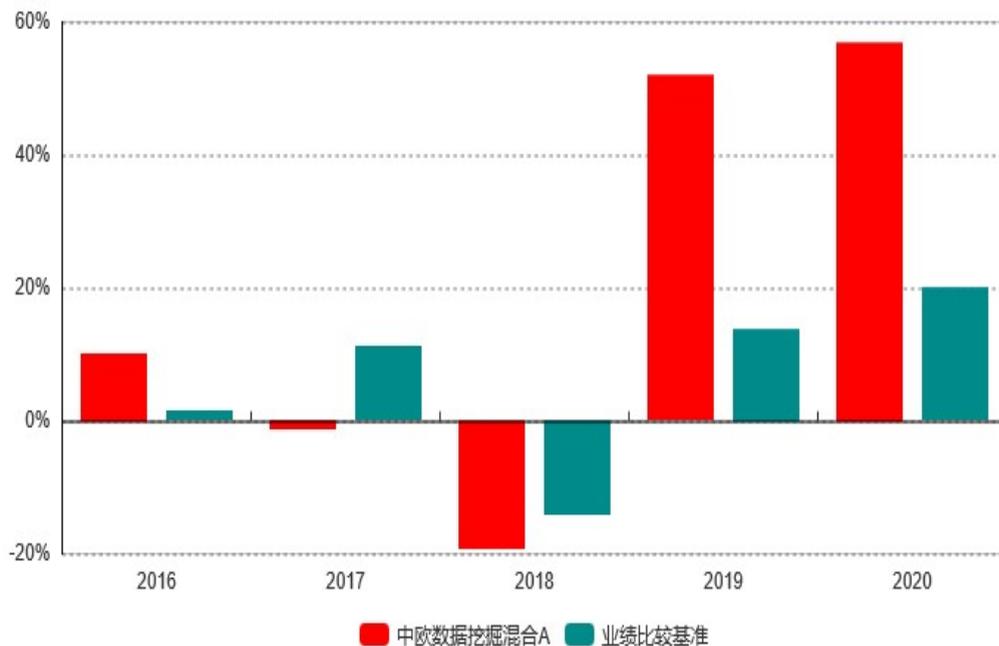
注：2019年4月26日组合业绩比较基准由沪深300指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%变更为中证500指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。

中欧数据挖掘混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

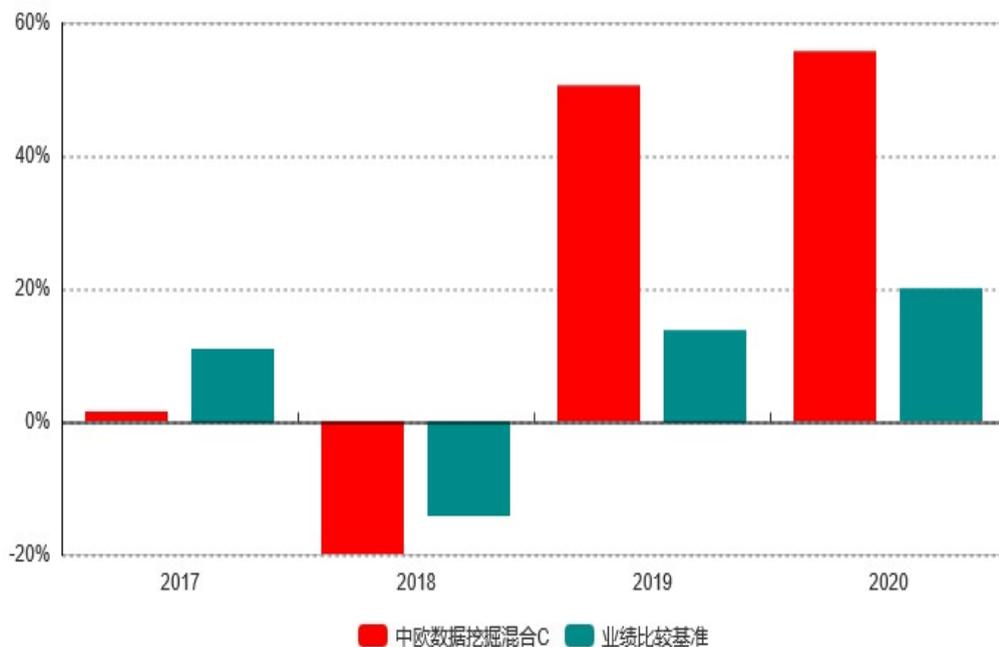


注：注：2019年4月26日组合业绩比较基准由沪深300指数收益率\*60%+中债综合指数收益率\*40%变更为中证500指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。自2017年1月19日起本基金增加C类份额，图示日期为2017年1月20日至2020年12月31日。

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



注 本基金合同生效日为 2016 年 1 月 13 日，2016 年度数据为 2016 年 1 月 13 日至 2016 年 12 月 31 日数据



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

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

中欧数据挖掘过去三年未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份有限公司、国都证券股份有限公司、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以及自然人股东，注册资本为2.20亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、上海中欧财富基金销售有限公司和中欧基金国际有限公司。截至2020年12月31日，本基金管理人共管理88只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
钱亚婷	基金经理助理	2019-04-23	-	4	2016/04/05加入中欧基金管理有限公司, 历任中欧基金管理有限公司分析师。
曲径	量化投资总监/基金经理/投资经理	2016-01-13	-	14	历任千禧年基金量化基金经理（2007.01-2010.06），博暄资产管理有限公司量化投资分析师、量化投资经理（2010.06-2011.06），中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁（2011.07-2015.03）2015/04/01加入中欧基金管理有限

					公司。
--	--	--	--	--	-----

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
曲径	公募基金	3	1,676,193,474.48	2015-05-18
	私募资产管理计划	1	29,075,659.88	2020-08-03
	其他组合	-	-	-
	合计	4	1,705,269,134.36	-

注：本报告期内兼任投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：产品类型：公募，离任数量：1只，离任时间：2020-12-30（产品清盘）。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

基金经理薪酬激励与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现不直接挂钩。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规，本基金管理人制定了《公平交易管理办法》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖公司旗下各类资产组合及投资顾问业务涉及的投资组合；涵盖了股票、债券等各类投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动的各个环节，以确保公司旗下管理的不同投资组合得到公平对待，保护投资者合法权益。具体控制措施包括：在研究分析环节，基金经理共享研究报告，投研体

系职权划分明确且互不干预，各基金持仓及交易信息进行有效隔离；在投资决策环节，基金经理公平对待管理的所有组合，尽可能同时同价下达投资指令；在交易执行环节，本基金管理人以系统控制和人工控制相结合的方式，严控反向交易和同向交易；在事后监控环节，本基金管理人设置日常异常交易分析机制，发现异常问题对基金经理进行提示，留存解释说明，并定期编制公平交易分析报告，逐级审核签署备查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照相关法规及制度等规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易公平执行。

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

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有2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

回顾2020年，疫情的突发叠加中美贸易战的恶化，在上半年引发了世界级的资本市场恐慌，为A股带来风险的同时，也提供了机遇。回头来看，两方面的强势因素推进了全年的结构化行情。一方面，在全球疫情动荡下，中国制造业维持了高质量稳定输出，

如工程机械，消费电子，一次性医用产品等；另一方面，国内消费驱动的食品饮料、医药生物、建材等版块，也在全年表现亮眼。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，A类份额净值收益率为56.92%，同期业绩比较基准收益率为19.92%；C类份额净值增长率为55.68%，同期业绩比较基准收益率为19.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为个股分化在2021年仍将持续，自下而上寻找业绩稳健或持续提升市场份额的优秀个股，会是Alpha的主要来源。在市场风格上，当前持仓集中度已经达到2007年以来的高点。经过研究历史上的“抱团市”，我们发现在市场风格变化后，反转因子均产生了超额收益，我们认为前期滞涨的中盘价值股及2021年业绩反转的行业值得关注。本基金采用以中证500指数的行业配置为锚定，叠加精选个股的投资策略，个股筛选以跑赢指数为目标。本基金的整体回报可以理解为中证500指数Beta收益，叠加个股选择的Alpha收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2020年，在公司业务全面发展的背景下，公司始终坚持保障基金份额持有人利益的原则，不断强化内部控制，并有效地组织开展监察稽核工作，具体包括以下方面：

##### （一）落实法律法规，培养合规文化

2020年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，公司在收到相关法规后第一时间内通过电子邮件向相关部门和员工传达了有关内容。监察稽核部负责将新颁布的法律法规及时维护至公司共享法律法规库，并以每周新规跟踪的形式，针对法律法规进行全员范围内的解读；同时，公司致力于积极推动公司合规文化建设，通过法规培训、风险案例研讨、员工合规测试等多种形式，提高员工合规及风控意识，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

##### （二）完善制度体系，提高运作效率

2020年，公司根据业务需要及新近出台或修订的法律法规，对规章制度体系进行了进一步完善，在兼顾合规、风险管理和效率的前提下，对一系列规章制度进行了补充和修订，以使得各项业务运作更为规范、顺畅和高效：公司全年共制订或修订制度流程22项，内容涵盖投资研究、合规管理、产品运作、基金销售及宣传推介、信息技术、反洗钱等各项内容。

##### （三）加强内部审计，强化风险管理

2020年，公司按照年初制定的监察稽核年度计划，进一步加强合规及内部稽核审计力度，全年除有序完成监管要求的法定审计工作及常规定期审计工作外，针对易发生风

险的各类业务循环开展多次专项稽核工作，使业务中存在的问题能够得到及时发现和纠正。通过内部稽核审计工作，切实保证基金运作和公司经营所涉及的各个环节均能按照各项法律法规和公司内部制度有效落实。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，投票成员包括主席、权益及固定收益研究总监、基金运营总监、监察稽核总监、风险管理总监，非投票成员（列席表达相关意见）包括公司高管、投资组合经理、中央交易室负责人、业务发展部负责人、主席指定的其他相关人士。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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合规守信、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2020年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第61362990_B21号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表，2020年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。我们认为，后附的中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和净值变动情况。

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

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

	的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊、许培菁
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2021-03-30

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	73,294,640.74	13,168,554.00
结算备付金		22,133,279.69	1,726,887.79
存出保证金		5,292,702.24	69,146.52
交易性金融资产	7.4.7.2	985,231,691.71	198,538,448.30
其中：股票投资		985,051,691.71	198,538,448.30
基金投资		-	-
债券投资		180,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		24,763,820.72	544,310.99
应收利息	7.4.7.5	13,932.72	5,351.36
应收股利		-	-
应收申购款		1,220,829.19	105,655.91

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,111,950,897.01	214,158,354.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		30,158,147.14	710,254.05
应付赎回款		1,759,867.97	47,330.81
应付管理人报酬		1,334,399.38	204,113.19
应付托管费		222,399.90	34,018.90
应付销售服务费		246,062.02	29,933.11
应付交易费用	7.4.7.7	2,543,134.40	620,272.32
应交税费		10,774.86	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	205,294.44	170,034.41
负债合计		36,480,080.11	1,815,956.79
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	560,977,859.55	172,946,148.75
未分配利润	7.4.7.10	514,492,957.35	39,396,249.33
所有者权益合计		1,075,470,816.90	212,342,398.08
负债和所有者权益总计		1,111,950,897.01	214,158,354.87

注：报告截止日2020年12月31日，基金份额总额为560,977,859.55份，其中下属A类基金份额净值为人民币1.9369元，份额总额为376,726,641.51份；下属C类基金份额净值为人民币1.8767元，份额总额为184,251,218.04份。

## 7.2 利润表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
一、收入		266,396,361.16	58,104,858.67
1. 利息收入		676,484.06	83,826.79
其中：存款利息收入	7.4.7.11	272,390.49	81,682.41
债券利息收入		258.42	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		403,835.15	2,144.38
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		215,146,723.29	47,278,505.71
其中：股票投资收益	7.4.7.12	202,099,945.89	45,870,426.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	273,671.11	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.	-	-
收益	3		
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	8,893,117.97	207,551.46
股利收益	7.4.7.15	3,879,988.32	1,200,527.88
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	49,797,766.21	10,610,384.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	775,387.60	132,141.27
<b>减：二、费用</b>		24,050,930.08	5,919,565.63
1. 管理人报酬		9,196,242.70	1,748,607.30
2. 托管费		1,532,707.16	291,434.58
3. 销售服务费		1,399,249.98	210,313.77
4. 交易费用	7.4.7.18	11,666,638.82	3,479,194.32
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		32,016.13	941.66
7. 其他费用	7.4.7.19	224,075.29	189,074.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		242,345,431.08	52,185,293.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		242,345,431.08	52,185,293.04

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	172,946,148.75	39,396,249.33	212,342,398.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	242,345,431.08	242,345,431.08
三、本期基金份额交易产生的基金	388,031,710.80	232,751,276.94	620,782,987.74

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	651,608,507.79	388,813,773.22	1,040,422,281.01
2. 基金赎回款	-263,576,796.99	-156,062,496.28	-419,639,293.27
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	560,977,859.55	514,492,957.35	1,075,470,816.90
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	127,976,913.21	-24,220,922.46	103,755,990.75
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,185,293.04	52,185,293.04
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）	44,969,235.54	11,431,878.75	56,401,114.29
其中：1. 基金申购款	159,310,065.81	17,936,227.29	177,246,293.10
2. 基金赎回款	-114,340,830.27	-6,504,348.54	-120,845,178.81
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）	172,946,148.75	39,396,249.33	212,342,398.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

刘建平

杨毅

王音然

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]2423号文《关于准予中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由中欧基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集506,108,438.33元。经向中国证监会备案，《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为506,409,681.98份基金份额，其中认购资金利息折合301,243.65基金份额。本基金的基金管理人与注册登记机构均为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货、股票期权等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不

低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或到期日在一年以内的政府债券。

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和中期报告〉》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产分类

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

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

#### (2) 金融负债分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

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

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

##### (1) 股票投资

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

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

##### (2) 债券投资

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

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

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

### （3）权证投资

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

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

### （4）股指/国债期货投资

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

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

### （5）分离交易可转债

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

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述（2）、（3）中相关原则进行计算；

### （6）回购协议

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

(3) 本基金同一类别的基金份额享有同等分配权；

(4) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

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

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

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

##### 2. 增值税

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

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

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

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

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

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

### 4. 企业所得税

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

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

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

## 5. 个人所得税

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

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

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	73,294,640.74	13,168,554.00
定期存款	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	73,294,640.74	13,168,554.00

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		928,177,396.18	985,051,691.71	56,874,295.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	180,000.00	180,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	180,000.00	180,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		928,357,396.18	985,231,691.71	56,874,295.53
项目		上年度末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		190,599,070.50	198,538,448.30	7,939,377.80
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		190,599,070.50	198,538,448.30	7,939,377.80

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-

权益衍生工具	35,395,271.52	-	-	-
股指期货	35,395,271.52	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	35,395,271.52	-	-	-
项目	上年度末2019年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
资产		负债		
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为人民币0元。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为人民币0元。具体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

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

上年度末 2019年12月31日					
代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	9,820.28	4,562.22
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	3,994.65	754.93
应收债券利息	10.65	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	107.14	34.21
合计	13,932.72	5,351.36

#### 7.4.7.6 其他资产

无。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	2,543,134.40	620,272.32
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	2,543,134.40	620,272.32

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	292.19	34.41
应付证券出借违约金	-	-
预提费用-审计费	85,000.00	50,000.00
预提费用-信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付转出费	2.25	-
合计	205,294.44	170,034.41

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合A)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	134,158,240.15	134,158,240.15
本期申购	391,660,287.95	391,660,287.95
本期赎回(以“-”号填列)	-149,091,886.59	-149,091,886.59
本期末	376,726,641.51	376,726,641.51

金额单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合C)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	38,787,908.60	38,787,908.60
本期申购	259,948,219.84	259,948,219.84
本期赎回(以“-”号填列)	-114,484,910.40	-114,484,910.40
本期末	184,251,218.04	184,251,218.04

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 中欧数据挖掘混合A

单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	30,542,125.66	885,106.51	31,427,232.17
本期利润	142,403,638.43	30,666,703.07	173,070,341.50
本期基金份额交易产生的变动数	112,054,630.97	36,404,612.58	148,459,243.55
其中：基金申购款	180,260,489.43	46,042,524.08	226,303,013.51
基金赎回款	-68,205,858.46	-9,637,911.50	-77,843,769.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	285,000,395.06	67,956,422.16	352,956,817.22

## 7.4.7.10.2 中欧数据挖掘混合C

单位：人民币元

项目 (中欧数据挖掘混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,739,300.53	229,716.63	7,969,017.16
本期利润	50,144,026.44	19,131,063.14	69,275,089.58
本期基金份额交易产生的变动数	71,429,861.04	12,862,172.35	84,292,033.39
其中：基金申购款	136,006,390.22	26,504,369.49	162,510,759.71
基金赎回款	-64,576,529.18	-13,642,197.14	-78,218,726.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	129,313,188.01	32,222,952.12	161,536,140.13

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	202,784.39	64,091.07
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	65,012.41	15,623.12
其他	4,593.69	1,968.22
合计	272,390.49	81,682.41

#### 7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	3,626,479,052.90	1,123,297,443.91
减：卖出股票成本总额	3,424,379,107.01	1,077,427,017.54
买卖股票差价收入	202,099,945.89	45,870,426.37

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	273,671.11	-
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	273,671.11	-

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月 31日

卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,367,726.39	-
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,093,800.00	-
减：应收利息总额	255.28	-
买卖债券差价收入	273,671.11	-

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

##### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间收益 金额 2019年01月01日至2019年12月31日
期货投资	9,159,911.52	216,112.00
减：期货投资差价收入增值税抵减	266,793.55	8,560.54
合计	8,893,117.97	207,551.46

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,879,988.32	1,200,527.88
其中：证券出借权益补偿收入	-	-

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,879,988.32	1,200,527.88

## 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	48,934,917.73	10,513,384.90
——股票投资	48,934,917.73	10,513,384.90
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	862,848.48	97,000.00
——权证投资	-	-
——期货投资	862,848.48	97,000.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	49,797,766.21	10,610,384.90

## 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	740,034.08	130,633.64
转换费收入	35,353.52	1,507.63
合计	775,387.60	132,141.27

## 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	11,632,257.01	3,472,135.94
银行间市场交易费用	-	-
期货市场交易费用	34,381.81	7,058.38
合计	11,666,638.82	3,479,194.32

## 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	85,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	1,075.29	1,074.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
合计	224,075.29	189,074.00

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构

中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司(“国都证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司(“万盛基业”)	基金管理人的股东
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
自然人股东	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司(“中欧盛世资 管”)	基金管理人的全资子公司
上海中欧财富基金销售有限公司(“中欧财富”)	基金管理人的控股子公司
中欧基金国际有限公司(“中欧国际”)	基金管理人的全资子公司

注 1、中欧基金管理有限公司旗下子公司中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司,自2020年4月24日起,将公司名称变更为“上海中欧财富基金销售有限公司”。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
国都证券	118,727,925.56	1.53%	18,000,641.34	0.79%

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与通过关联方交易单元进行债券回购交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	110,571.56	1.53%	110,571.56	4.35%
关联方名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国都证券	16,763.98	0.79%	16,763.98	2.70%

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,196,242.70	1,748,607.30

其中：支付销售机构的客户维护费	994,748.97	441,691.47
-----------------	------------	------------

注：基金管理费按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,532,707.16	291,434.58

注：基金托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。计算方法如下：

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

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧数据挖掘混合A	中欧数据挖掘混合C	合计
国都证券	0.00	0.08	0.08
中欧基金	0.00	741,204.33	741,204.33
合计	0.00	741,204.41	741,204.41
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2019年01月01日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧数据挖掘混合A	中欧数据挖掘混合C	合计
国都证券	0.00	0.00	0.00
中欧基金	0.00	197,648.89	197,648.89
合计	0.00	197,648.89	197,648.89

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

## 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

## 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

中欧数据挖掘混合A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.00%

中欧数据挖掘混合C

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	152,284.26	152,284.26
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	152,284.26	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	152,284.26
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.00%	0.39%

注 1、申购/买入总份额含红利再投、转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

2、基金管理人通过相关销售商渠道投资本基金，适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

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

份额单位：份

## 中欧数据挖掘混合A

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	1,017,119.98	0.27%	0.00	0.00%

## 中欧数据挖掘混合C

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
自然人股东	916.49	0.00%	0.00	0.00%

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

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

## 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	73,294,640.74	202,784.39	13,168,554.00	64,091.07

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

## 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有工商银行发行的同业存单。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2020年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688390	固德威	2020-08-27	2021-03-04	新股流通受限	37.93	221.72	2,585	98,049.05	573,146.20	-
688311	盟升电子	2020-07-24	2021-02-01	新股流通受限	41.58	115.36	4,182	173,887.56	482,435.52	-
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	新股流通受限	25.70	88.29	4,709	121,021.30	415,757.61	-
300863	卡倍亿	2020-08-11	2021-02-24	新股流通受限	18.79	103.22	3,421	64,280.59	353,115.62	-
688221	前沿生物	2020-10-20	2021-04-28	新股流通受限	20.50	17.15	16,148	331,034.00	276,938.20	-
688286	敏芯股份	2020-07-31	2021-02-10	新股流通受限	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-
6886	惠泰	2020	2021	新股	74.4	74.4	1,673	124,	124,	-

17	医疗	-12-30	-07-07	流通受限	6	6		571.58	571.58	
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	新股流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	新股流通受限	138.02	126.67	336	46,374.72	42,561.12	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	新股流通受限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300872	天阳科技	2020-08-14	2021-02-25	新股流通受限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300900	广联航空	2020-10-19	2021-04-29	新股流通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300877	金春股份	2020-08-17	2021-03-03	新股流通受限	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300894	火星人	2020-12-24	2021-06-30	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	新股流通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
3008	海晨	2020	2021	新股	30.7	41.3	484	14,8	19,9	-

73	股份	-08-14	-03-02	流通受限	2	2		68.48	98.88	
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	新股流通受限	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	新股流通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300898	熊猫乳品	2020-10-09	2021-04-16	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-30	新股流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	新股流通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼测试	2020-09-09	2021-03-16	新股流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	新股流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
3009	国安	2020	2021	新股	15.3	24.2	551	8,47	13,3	-

02	达	-10- 22	-04- 29	流通 受限	8	6		4.38	67.2 6	
3009 25	法本 信息	2020 -12- 21	2021 -06- 30	新股 流通 受限	20.0 8	37.3 3	353	7,08 8.24	13,1 77.4 9	-
3008 95	铜牛 信息	2020 -09- 17	2021 -03- 24	新股 流通 受限	12.6 5	45.3 0	283	3,57 9.95	12,8 19.9 0	-
3008 76	蒙泰 高新	2020 -08- 14	2021 -02- 25	新股 流通 受限	20.0 9	36.6 2	350	7,03 1.50	12,8 17.0 0	-
3009 07	康平 科技	2020 -11- 11	2021 -05- 18	新股 流通 受限	14.3 0	26.8 5	473	6,76 3.90	12,7 00.0 5	-
3008 79	大叶 股份	2020 -08- 25	2021 -03- 01	新股 流通 受限	10.5 8	27.1 2	466	4,93 0.28	12,6 37.9 2	-
3008 82	万胜 智能	2020 -08- 27	2021 -03- 10	新股 流通 受限	10.3 3	25.7 9	440	4,54 5.20	11,3 47.6 0	-
3009 11	亿田 智能	2020 -11- 24	2021 -06- 03	新股 流通 受限	24.3 5	33.0 6	309	7,52 4.15	10,2 15.5 4	-
3009 18	南山 智尚	2020 -12- 15	2021 -06- 22	新股 流通 受限	4.97	8.94	1,063	5,28 3.11	9,50 3.22	-
3008 81	盛德 鑫泰	2020 -08- 25	2021 -03- 05	新股 流通 受限	14.1 7	32.3 1	291	4,12 3.47	9,40 2.21	-
3009 22	天秦 装备	2020 -12- 18	2021 -06- 25	新股 流通 受限	16.0 5	31.5 8	287	4,60 6.35	9,06 3.46	-
6052	新亚	2020	2021	新股	16.9	16.9	507	8,59	8,59	-

77	电子	-12-25	-01-06	未上市	5	5		3.65	3.65	
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123091	长海转债	2020-12-23	2021-01-15	新债未上市	100.00	100.00	1,800	180,000.00	180,000.00	-

注：上述流通受限证券所披露可流通日，如晚于报告送出日期，则均为预计日期。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年12月31日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的融出证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的要求对基金投资进行定期、不定期检查，出具监察稽核报告，进而从合规层面对基金投资进行风险控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险

管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的10%。本基金的基金管理人管理的所有开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的15%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于2020年12月31日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金持有的资产主要为银行存款、股票及信用状况良好的固定收益类资产，其中银行存款主要为活期存款及可提前支取的定期存款，股票及固定收益类资产主要为在交易所及银行间公开发行的上市且可自由流通的品种。本基金持有的流通受限资产比例较低，未对组合流动性造成重大影响，附注7.4.12披露的流通受限资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

#### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	73,294,640.74	-	-	-	73,294,640.74
结算备付金	8,069,990.69	-	-	14,063,289.00	22,133,279.69
存出保证金	216,565.44	-	-	5,076,136.80	5,292,702.24
交易性金融资产	-	-	180,000.00	985,051,691.71	985,231,691.71
应收证券清算款	-	-	-	24,763,820.72	24,763,820.72
应收利息	-	-	-	13,932.72	13,932.72
应收申购款	-	-	-	1,220,829.19	1,220,829.19
资产总计	81,581,196.87	-	180,000.00	1,030,189,700.14	1,111,950,897.01
负债					
应付证券清算款	-	-	-	30,158,147.14	30,158,147.14
应付赎回款	-	-	-	1,759,867.97	1,759,867.97
应付管理人报酬	-	-	-	1,334,399.38	1,334,399.38
应付托管费	-	-	-	222,399.90	222,399.90
应付销售服务费	-	-	-	246,062.02	246,062.02
应付交易费用	-	-	-	2,543,134.40	2,543,134.40
应交税费	-	-	-	10,774.86	10,774.86
其他负债	-	-	-	205,294.44	205,294.44
负债总计	-	-	-	36,480,080.11	36,480,080.11

利率敏感度缺口	81,581,196.87	-	180,000.00	993,709,620.03	1,075,470,816.90
上年度末 2019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	13,168,554.00	-	-	-	13,168,554.00
结算备付金	1,726,887.79	-	-	-	1,726,887.79
存出保证金	69,146.52	-	-	-	69,146.52
交易性金融资产	-	-	-	198,538,448.30	198,538,448.30
应收证券清算款	-	-	-	544,310.99	544,310.99
应收利息	-	-	-	5,351.36	5,351.36
应收申购款	-	-	-	105,655.91	105,655.91
资产总计	14,964,588.31	-	-	199,193,766.56	214,158,354.87
负债					
应付证券清算款	-	-	-	710,254.05	710,254.05
应付赎回款	-	-	-	47,330.81	47,330.81
应付管理人报酬	-	-	-	204,113.19	204,113.19
应付托管费	-	-	-	34,018.90	34,018.90
应付销售服务费	-	-	-	29,933.11	29,933.11
应付交易费用	-	-	-	620,272.32	620,272.32
其他负债	-	-	-	170,034.41	170,034.41
负债总计	-	-	-	1,815,956.79	1,815,956.79
利率敏感度缺口	14,964,588.31	-	-	197,377,809.77	212,342,398.08

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年12月31日本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为0.02% (2019年12月31日:0.00%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2019年12月31日: 同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019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	985,051,691.71	91.59	198,538,448.30	93.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	985,051,691.71	91.59	198,538,448.30	93.50

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	53,634,113.29	9,570,344.96
	2. 业绩比较基准下降5%	-53,634,113.29	-9,570,344.96

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## 1. 公允价值

## 1.1 不以公允价值计量的金融工具

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

## 1.2 以公允价值计量的金融工具

## 1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币981,957,970.28元，属于第二层次的余额为人民币3,273,721.43元，无划分为第三层次的余额。（2019年12月31日：本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为人民币193,531,284.95元，属于第二层次的余额为人民币5,007,163.35元，无划分为第三层次的余额）。

## 1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

## 1.2.3 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具第三层次公允价值本期未发生变动。

## 2. 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

## 3. 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

## 4. 财务报表的批准

本财务报表已于2021年3月30日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

## 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	985,051,691.71	88.59
	其中：股票	985,051,691.71	88.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	180,000.00	0.02
	其中：债券	180,000.00	0.02
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	95,427,920.43	8.58
8	其他各项资产	31,291,284.87	2.81
9	合计	1,111,950,897.01	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

## 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,446,130.00	0.13
B	采矿业	28,376,903.00	2.64

C	制造业	688,596,027.30	64.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,785,255.00	1.19
E	建筑业	2,978,340.00	0.28
F	批发和零售业	11,347,558.72	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	27,602,900.88	2.57
H	住宿和餐饮业	1,671,754.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,055,644.21	6.51
J	金融业	57,192,875.00	5.32
K	房地产业	16,507,868.00	1.53
L	租赁和商务服务业	10,304,364.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	18,606,297.20	1.73
N	水利、环境和公共设施管理业	3,295,539.00	0.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,689,514.28	0.53
Q	卫生和社会工作	3,203,000.00	0.30
R	文化、体育和娱乐业	22,848,840.12	2.12
S	综合	2,542,881.00	0.24
	合计	985,051,691.71	91.59

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	204,100	17,752,618.00	1.65
2	000568	泸州老窖	73,400	16,600,144.00	1.54
3	600456	宝钛股份	265,600	13,835,104.00	1.29

4	002928	华夏航空	1,027,800	13,001,670.00	1.21
5	601636	旗滨集团	1,004,000	12,851,200.00	1.19
6	601168	西部矿业	948,300	11,739,954.00	1.09
7	600176	中国巨石	587,900	11,734,484.00	1.09
8	000002	万科A	408,700	11,729,690.00	1.09
9	601899	紫金矿业	1,247,700	11,591,133.00	1.08
10	300750	宁德时代	32,200	11,305,742.00	1.05
11	601966	玲珑轮胎	319,900	11,250,883.00	1.05
12	002241	歌尔股份	294,900	11,005,668.00	1.02
13	300363	博腾股份	282,400	10,313,248.00	0.96
14	002353	杰瑞股份	292,600	10,241,000.00	0.95
15	300059	东方财富	329,300	10,208,300.00	0.95
16	601601	中国太保	262,600	10,083,840.00	0.94
17	000547	航天发展	363,000	9,982,500.00	0.93
18	600900	长江电力	514,300	9,853,988.00	0.92
19	603799	华友钴业	123,900	9,825,270.00	0.91
20	002739	万达电影	538,500	9,736,080.00	0.91
21	601233	桐昆股份	462,500	9,522,875.00	0.89
22	300413	芒果超媒	131,200	9,512,000.00	0.88
23	601012	隆基股份	101,400	9,349,080.00	0.87
24	600276	恒瑞医药	82,596	9,206,150.16	0.86
25	600426	华鲁恒升	242,900	9,060,170.00	0.84
26	002555	三七互娱	290,100	9,059,823.00	0.84
27	600309	万华化学	98,300	8,949,232.00	0.83
28	002027	分众传媒	895,200	8,835,624.00	0.82
29	300357	我武生物	113,836	8,731,221.20	0.81
30	600519	贵州茅台	4,300	8,591,400.00	0.80
31	600019	宝钢股份	1,417,600	8,434,720.00	0.78
32	300496	中科创达	71,800	8,400,600.00	0.78
33	600660	福耀玻璃	169,300	8,134,865.00	0.76
34	000063	中兴通讯	239,500	8,059,175.00	0.75

35	002821	凯莱英	26,500	7,927,210.00	0.74
36	300274	阳光电源	109,100	7,885,748.00	0.73
37	601166	兴业银行	377,700	7,882,599.00	0.73
38	000661	长春高新	17,500	7,855,925.00	0.73
39	002601	龙蟠佰利	255,137	7,850,565.49	0.73
40	002600	领益智造	649,600	7,788,704.00	0.72
41	603939	益丰药房	85,700	7,729,283.00	0.72
42	300726	宏达电子	103,500	7,488,225.00	0.70
43	600031	三一重工	205,028	7,171,879.44	0.67
44	000651	格力电器	114,000	7,061,160.00	0.66
45	002179	中航光电	89,928	7,040,463.12	0.65
46	603906	龙蟠科技	206,800	6,958,820.00	0.65
47	300122	智飞生物	46,100	6,818,651.00	0.63
48	300454	深信服	27,200	6,745,872.00	0.63
49	688021	奥福环保	105,000	6,439,650.00	0.60
50	600703	三安光电	219,600	5,931,396.00	0.55
51	300034	钢研高纳	163,300	5,870,635.00	0.55
52	002156	通富微电	230,500	5,817,820.00	0.54
53	300232	洲明科技	605,800	5,700,578.00	0.53
54	002607	中公教育	161,956	5,689,514.28	0.53
55	603728	鸣志电器	354,900	5,529,342.00	0.51
56	600745	闻泰科技	55,785	5,522,715.00	0.51
57	688396	华润微	87,500	5,467,875.00	0.51
58	002240	盛新锂能	223,500	5,462,340.00	0.51
59	300627	华测导航	231,620	5,264,722.60	0.49
60	300760	迈瑞医疗	12,100	5,154,600.00	0.48
61	002568	百润股份	49,400	5,151,926.00	0.48
62	600406	国电南瑞	192,700	5,120,039.00	0.48
63	300690	双一科技	87,300	5,109,669.00	0.48
64	300737	科顺股份	237,600	5,098,896.00	0.47
65	601021	春秋航空	91,600	5,077,388.00	0.47

66	000725	京东方 A	831,400	4,988,400.00	0.46
67	300188	美亚柏科	229,577	4,945,088.58	0.46
68	002541	鸿路钢构	133,700	4,884,061.00	0.45
69	688202	美迪西	31,000	4,874,130.00	0.45
70	688356	键凯科技	44,000	4,832,080.00	0.45
71	000860	顺鑫农业	66,100	4,794,894.00	0.45
72	002791	坚朗五金	33,200	4,780,800.00	0.44
73	300443	金雷股份	143,300	4,767,591.00	0.44
74	002726	龙大肉食	372,300	4,765,440.00	0.44
75	002154	报喜鸟	1,407,100	4,685,643.00	0.44
76	600409	三友化工	448,600	4,598,150.00	0.43
77	688037	芯源微	43,900	4,523,895.00	0.42
78	600887	伊利股份	100,200	4,445,874.00	0.41
79	603259	药明康德	32,500	4,378,400.00	0.41
80	002641	永高股份	684,400	4,366,472.00	0.41
81	300215	电科院	605,300	4,346,054.00	0.40
82	002335	科华数据	194,100	4,336,194.00	0.40
83	002847	盐津铺子	38,900	4,287,558.00	0.40
84	688036	传音控股	28,000	4,259,920.00	0.40
85	000902	新洋丰	263,300	4,212,800.00	0.39
86	600066	宇通客车	245,800	4,158,936.00	0.39
87	300119	瑞普生物	219,200	4,138,496.00	0.38
88	000625	长安汽车	187,900	4,111,252.00	0.38
89	603187	海容冷链	67,900	4,074,000.00	0.38
90	600496	精工钢构	908,969	4,072,181.12	0.38
91	002352	顺丰控股	46,000	4,058,580.00	0.38
92	300012	华测检测	147,200	4,028,864.00	0.37
93	002139	拓邦股份	493,100	3,999,041.00	0.37
94	603056	德邦股份	314,600	3,992,274.00	0.37
95	601208	东材科技	382,200	3,990,168.00	0.37
96	603416	信捷电气	43,300	3,933,372.00	0.37

97	603605	珀莱雅	21,900	3,898,200.00	0.36
98	603208	江山欧派	37,000	3,894,250.00	0.36
99	601225	陕西煤业	414,900	3,875,166.00	0.36
100	000736	中交地产	577,700	3,859,036.00	0.36
101	300450	先导智能	45,800	3,846,742.00	0.36
102	688169	石头科技	3,700	3,833,200.00	0.36
103	300308	中际旭创	75,000	3,814,500.00	0.35
104	000932	华菱钢铁	788,400	3,768,552.00	0.35
105	300578	会畅通讯	93,200	3,733,592.00	0.35
106	002975	博杰股份	33,300	3,699,630.00	0.34
107	601138	工业富联	270,000	3,696,300.00	0.34
108	600926	杭州银行	246,400	3,676,288.00	0.34
109	002508	老板电器	90,100	3,674,278.00	0.34
110	603043	广州酒家	94,800	3,671,604.00	0.34
111	600761	安徽合力	252,000	3,578,400.00	0.33
112	300788	中信出版	83,900	3,558,199.00	0.33
113	002372	伟星新材	190,200	3,556,740.00	0.33
114	002251	步步高	418,100	3,532,945.00	0.33
115	603927	中科软	86,900	3,483,821.00	0.32
116	002677	浙江美大	218,500	3,480,705.00	0.32
117	300624	万兴科技	62,200	3,445,258.00	0.32
118	300196	长海股份	201,100	3,424,733.00	0.32
119	600760	中航沈飞	43,700	3,416,466.00	0.32
120	688208	道通科技	49,800	3,411,798.00	0.32
121	002318	久立特材	309,102	3,369,211.80	0.31
122	603359	东珠生态	206,100	3,295,539.00	0.31
123	603882	金域医学	25,000	3,203,000.00	0.30
124	300595	欧普康视	38,200	3,129,344.00	0.29
125	000708	中信特钢	137,800	3,002,662.00	0.28
126	002025	航天电器	45,900	2,991,762.00	0.28
127	002645	华宏科技	326,900	2,968,252.00	0.28

128	300451	创业慧康	218,800	2,960,364.00	0.28
129	300124	汇川技术	30,900	2,882,970.00	0.27
130	000157	中联重科	288,400	2,855,160.00	0.27
131	002643	万润股份	128,500	2,797,445.00	0.26
132	300037	新宙邦	25,500	2,585,700.00	0.24
133	603113	金能科技	157,900	2,581,665.00	0.24
134	000009	中国宝安	337,700	2,542,881.00	0.24
135	603818	曲美家居	301,600	2,539,472.00	0.24
136	000338	潍柴动力	140,200	2,213,758.00	0.21
137	603131	上海沪工	72,800	2,187,640.00	0.20
138	603881	数据港	36,200	2,175,982.00	0.20
139	300253	卫宁健康	118,400	2,072,000.00	0.19
140	002777	久远银海	86,200	2,011,908.00	0.19
141	601668	中国建筑	400,000	1,988,000.00	0.18
142	002291	星期六	121,900	1,969,904.00	0.18
143	603613	国联股份	15,300	1,959,624.00	0.18
144	000951	中国重汽	61,200	1,925,352.00	0.18
145	300601	康泰生物	11,000	1,919,500.00	0.18
146	300740	御家汇	105,600	1,911,360.00	0.18
147	300394	天孚通信	35,200	1,877,216.00	0.17
148	002756	永兴材料	34,400	1,865,168.00	0.17
149	300482	万孚生物	20,300	1,810,963.00	0.17
150	300782	卓胜微	3,120	1,780,084.80	0.17
151	002439	启明星辰	60,600	1,770,126.00	0.16
152	300896	爱美客	2,700	1,768,554.00	0.16
153	300751	迈为股份	2,500	1,692,525.00	0.16
154	002444	巨星科技	53,600	1,667,496.00	0.16
155	002410	广联达	20,600	1,622,044.00	0.15
156	300724	捷佳伟创	11,100	1,616,160.00	0.15
157	002056	横店东磁	105,600	1,604,064.00	0.15
158	600570	恒生电子	15,200	1,594,480.00	0.15

159	600845	宝信软件	23,000	1,586,540.00	0.15
160	688023	安恒信息	5,800	1,508,580.00	0.14
161	300566	激智科技	46,600	1,499,122.00	0.14
162	300285	国瓷材料	32,913	1,484,705.43	0.14
163	002459	晶澳科技	36,400	1,482,208.00	0.14
164	601888	中国中免	5,200	1,468,740.00	0.14
165	600809	山西汾酒	3,900	1,463,631.00	0.14
166	603899	晨光文具	16,500	1,461,240.00	0.14
167	300073	当升科技	22,500	1,459,125.00	0.14
168	601919	中远海控	119,000	1,452,990.00	0.14
169	002064	华峰化学	143,600	1,448,924.00	0.13
170	000998	隆平高科	73,000	1,446,130.00	0.13
171	000799	酒鬼酒	9,200	1,439,800.00	0.13
172	300677	英科医疗	8,450	1,420,867.50	0.13
173	600585	海螺水泥	27,100	1,398,902.00	0.13
174	300502	新易盛	24,860	1,379,232.80	0.13
175	600741	华域汽车	47,700	1,374,714.00	0.13
176	601633	长城汽车	36,300	1,372,503.00	0.13
177	688116	天奈科技	22,000	1,364,000.00	0.13
178	603313	梦百合	42,000	1,361,640.00	0.13
179	000858	五粮液	4,600	1,342,510.00	0.12
180	300769	德方纳米	8,000	1,337,600.00	0.12
181	002624	完美世界	45,200	1,333,400.00	0.12
182	603258	电魂网络	42,100	1,324,887.00	0.12
183	002304	洋河股份	5,600	1,321,544.00	0.12
184	600486	扬农化工	10,000	1,320,000.00	0.12
185	600036	招商银行	30,000	1,318,500.00	0.12
186	600893	航发动力	22,100	1,311,635.00	0.12
187	002230	科大讯飞	32,000	1,307,840.00	0.12
188	000001	平安银行	67,300	1,301,582.00	0.12
189	002724	海洋王	172,500	1,276,500.00	0.12

190	002838	道恩股份	49,400	1,271,556.00	0.12
191	002585	双星新材	126,000	1,267,560.00	0.12
192	300014	亿纬锂能	15,500	1,263,250.00	0.12
193	603528	多伦科技	138,000	1,253,040.00	0.12
194	600161	天坛生物	30,000	1,251,000.00	0.12
195	002709	天赐材料	11,900	1,235,220.00	0.11
196	601100	恒立液压	10,900	1,231,700.00	0.11
197	002594	比亚迪	6,300	1,224,090.00	0.11
198	600030	中信证券	41,000	1,205,400.00	0.11
199	002271	东方雨虹	30,750	1,193,100.00	0.11
200	603733	仙鹤股份	47,600	1,190,000.00	0.11
201	000807	云铝股份	157,700	1,187,481.00	0.11
202	601088	中国神华	65,000	1,170,650.00	0.11
203	002803	吉宏股份	36,064	1,162,703.36	0.11
204	600143	金发科技	67,500	1,156,950.00	0.11
205	002483	润邦股份	204,600	1,155,990.00	0.11
206	002891	中宠股份	20,100	1,155,549.00	0.11
207	300666	江丰电子	23,336	1,155,365.36	0.11
208	600330	天通股份	113,020	1,143,762.40	0.11
209	300763	锦浪科技	7,640	1,138,360.00	0.11
210	600690	海尔智家	38,900	1,136,269.00	0.11
211	300019	硅宝科技	65,500	1,132,495.00	0.11
212	601901	方正证券	109,200	1,132,404.00	0.11
213	601009	南京银行	140,000	1,131,200.00	0.11
214	001696	宗申动力	146,500	1,129,515.00	0.11
215	300777	中简科技	22,100	1,118,481.00	0.10
216	300200	高盟新材	103,300	1,115,640.00	0.10
217	002475	立讯精密	19,300	1,083,116.00	0.10
218	603855	华荣股份	65,400	1,055,556.00	0.10
219	002909	集泰股份	102,200	1,052,660.00	0.10
220	002940	昂利康	24,700	1,021,592.00	0.09

221	300095	华伍股份	99,100	1,015,775.00	0.09
222	002637	赞宇科技	80,800	1,015,656.00	0.09
223	600989	宝丰能源	85,000	994,500.00	0.09
224	000628	高新发展	117,200	990,340.00	0.09
225	300400	劲拓股份	78,100	980,155.00	0.09
226	002511	中顺洁柔	46,600	972,542.00	0.09
227	603606	东方电缆	38,804	968,159.80	0.09
228	300759	康龙化成	8,000	963,200.00	0.09
229	002142	宁波银行	27,100	957,714.00	0.09
230	300259	新天科技	191,200	950,264.00	0.09
231	300617	安靠智电	19,100	949,843.00	0.09
232	600754	锦江酒店	18,400	948,152.00	0.09
233	002705	新宝股份	22,400	946,400.00	0.09
234	300558	贝达药业	8,800	944,856.00	0.09
235	002896	中大力德	34,000	935,340.00	0.09
236	300607	拓斯达	26,620	925,045.00	0.09
237	600104	上汽集团	37,700	921,388.00	0.09
238	300453	三鑫医疗	52,309	919,592.22	0.09
239	600048	保利地产	58,100	919,142.00	0.09
240	002603	以岭药业	35,100	895,050.00	0.08
241	603378	亚士创能	20,900	892,639.00	0.08
242	603218	日月股份	29,200	883,300.00	0.08
243	002216	三全食品	33,900	879,705.00	0.08
244	603601	再升科技	64,200	876,330.00	0.08
245	300569	天能重工	54,100	865,059.00	0.08
246	002950	奥美医疗	41,700	846,927.00	0.08
247	002223	鱼跃医疗	28,600	806,806.00	0.08
248	002105	信隆健康	106,300	772,801.00	0.07
249	000600	建投能源	135,700	761,277.00	0.07
250	000400	许继电气	51,600	746,136.00	0.07
251	000513	丽珠集团	18,400	745,200.00	0.07

252	000690	宝新能源	101,600	741,680.00	0.07
253	600258	首旅酒店	34,100	723,602.00	0.07
254	002039	黔源电力	46,500	716,565.00	0.07
255	600008	首创股份	251,500	711,745.00	0.07
256	300696	爱乐达	12,500	683,125.00	0.06
257	002467	二六三	110,000	653,400.00	0.06
258	002452	长高集团	113,300	649,209.00	0.06
259	300403	汉宇集团	95,100	604,836.00	0.06
260	688390	固德威	2,585	573,146.20	0.05
261	601128	常熟银行	73,500	542,430.00	0.05
262	688311	盟升电子	4,182	482,435.52	0.04
263	600398	海澜之家	66,000	423,720.00	0.04
264	300999	金龙鱼	4,709	415,757.61	0.04
265	300863	卡倍亿	3,421	353,115.62	0.03
266	688221	前沿生物	16,148	276,938.20	0.03
267	603877	太平鸟	8,300	249,000.00	0.02
268	688286	敏芯股份	1,681	197,231.73	0.02
269	300185	通裕重工	38,500	149,380.00	0.01
270	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
271	600998	九州通	3,800	69,008.00	0.01
272	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
273	300860	锋尚文化	336	42,561.12	0.00
274	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
275	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
276	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
277	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
278	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
279	300877	金春股份	569	28,933.65	0.00
280	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
281	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
282	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00

283	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
284	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
285	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
286	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
287	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
288	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
289	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
290	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
291	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
292	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
293	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
294	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
295	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
296	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
297	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
298	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
299	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
300	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
301	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
302	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
303	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
304	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
305	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
306	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
307	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
308	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
309	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
310	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
311	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
312	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300759	康龙化成	41,488,736.65	19.54
2	603259	药明康德	31,307,395.05	14.74
3	600900	长江电力	30,514,778.09	14.37
4	601012	隆基股份	28,637,624.63	13.49
5	002027	分众传媒	28,152,834.50	13.26
6	002555	三七互娱	28,013,152.44	13.19
7	000725	京东方A	27,224,719.00	12.82
8	000661	长春高新	26,165,695.66	12.32
9	000002	万科A	25,326,584.31	11.93
10	601318	中国平安	24,865,646.60	11.71
11	300413	芒果超媒	24,422,433.42	11.50
12	300601	康泰生物	24,410,832.00	11.50
13	600426	华鲁恒升	23,636,625.42	11.13
14	600383	金地集团	23,503,351.50	11.07
15	300122	智飞生物	23,433,272.64	11.04
16	300059	东方财富	23,193,342.32	10.92
17	000063	中兴通讯	22,943,962.22	10.81
18	000568	泸州老窖	22,934,746.94	10.80
19	600031	三一重工	22,141,118.99	10.43
20	603393	新天然气	20,976,481.20	9.88
21	601633	长城汽车	20,251,623.21	9.54
22	000547	航天发展	19,999,711.21	9.42
23	002928	华夏航空	19,759,656.86	9.31
24	000338	潍柴动力	19,640,389.64	9.25
25	300630	普利制药	19,491,258.87	9.18
26	600745	闻泰科技	19,486,613.69	9.18

27	603881	数据港	19,369,826.72	9.12
28	603883	老百姓	19,249,905.62	9.07
29	600276	恒瑞医药	19,184,356.00	9.03
30	600309	万华化学	18,954,924.67	8.93
31	603520	司太立	18,822,217.80	8.86
32	600176	中国巨石	18,681,399.66	8.80
33	002475	立讯精密	18,419,015.03	8.67
34	300274	阳光电源	18,160,899.73	8.55
35	300454	深信服	18,045,918.44	8.50
36	603187	海容冷链	18,010,336.88	8.48
37	300037	新宙邦	17,633,345.99	8.30
38	603659	璞泰来	17,513,960.22	8.25
39	300502	新易盛	17,236,719.34	8.12
40	601021	春秋航空	16,639,935.68	7.84
41	600456	宝钛股份	16,621,243.55	7.83
42	601233	桐昆股份	16,439,228.64	7.74
43	600690	海尔智家	16,400,378.00	7.72
44	300196	长海股份	16,376,660.49	7.71
45	002709	天赐材料	16,359,764.14	7.70
46	601168	西部矿业	16,223,178.00	7.64
47	300357	我武生物	15,916,479.64	7.50
48	601688	华泰证券	15,832,485.00	7.46
49	600660	福耀玻璃	15,279,395.40	7.20
50	601966	玲珑轮胎	15,235,166.33	7.17
51	300725	药石科技	15,172,730.02	7.15
52	300782	卓胜微	15,123,083.60	7.12
53	300073	当升科技	14,690,591.69	6.92
54	002415	海康威视	14,570,790.74	6.86
55	002739	万达电影	14,384,607.70	6.77
56	601899	紫金矿业	14,148,731.00	6.66
57	002353	杰瑞股份	14,045,207.93	6.61

58	300709	精研科技	14,010,647.70	6.60
59	600030	中信证券	13,771,415.57	6.49
60	002821	凯莱英	13,756,470.40	6.48
61	300124	汇川技术	13,608,292.88	6.41
62	603707	健友股份	13,408,690.60	6.31
63	600570	恒生电子	13,325,233.13	6.28
64	600406	国电南瑞	13,119,656.60	6.18
65	603613	国联股份	13,057,924.03	6.15
66	300674	宇信科技	13,001,114.00	6.12
67	002410	广联达	12,962,958.57	6.10
68	002352	顺丰控股	12,710,136.07	5.99
69	601166	兴业银行	12,666,128.76	5.96
70	600588	用友网络	12,496,808.25	5.89
71	603737	三棵树	12,348,790.92	5.82
72	002601	龙蟠佰利	12,267,849.05	5.78
73	300595	欧普康视	12,212,894.43	5.75
74	603208	江山欧派	12,077,696.57	5.69
75	300168	万达信息	12,076,065.34	5.69
76	002371	北方华创	11,980,669.56	5.64
77	002241	歌尔股份	11,904,461.20	5.61
78	603596	伯特利	11,817,758.89	5.57
79	300567	精测电子	11,780,263.10	5.55
80	600585	海螺水泥	11,755,052.00	5.54
81	601636	旗滨集团	11,686,074.75	5.50
82	002251	步步高	11,602,077.03	5.46
83	002847	盐津铺子	11,548,257.60	5.44
84	600887	伊利股份	11,107,488.61	5.23
85	000157	中联重科	11,043,792.25	5.20
86	002791	坚朗五金	10,959,658.75	5.16
87	300740	御家汇	10,926,615.90	5.15
88	300451	创业慧康	10,800,366.35	5.09

89	002607	中公教育	10,744,396.18	5.06
90	300750	宁德时代	10,728,205.72	5.05
91	300760	迈瑞医疗	10,698,561.00	5.04
92	600703	三安光电	10,692,895.16	5.04
93	688396	华润微	10,642,539.26	5.01
94	300070	碧水源	10,597,038.04	4.99
95	603799	华友钴业	10,340,145.71	4.87
96	002236	大华股份	10,339,306.00	4.87
97	300363	博腾股份	10,334,705.76	4.87
98	601689	拓普集团	10,302,640.14	4.85
99	601601	中国太保	10,266,079.00	4.83
100	603986	兆易创新	10,255,513.00	4.83
101	600519	贵州茅台	10,226,110.00	4.82
102	300188	美亚柏科	10,225,091.30	4.82
103	002726	龙大肉食	10,211,945.70	4.81
104	300604	长川科技	10,133,842.82	4.77
105	601139	深圳燃气	10,126,699.27	4.77
106	002756	永兴材料	10,115,991.03	4.76
107	000625	长安汽车	10,072,024.89	4.74
108	300476	胜宏科技	10,008,885.34	4.71
109	300315	掌趣科技	9,996,903.62	4.71
110	002938	鹏鼎控股	9,975,074.00	4.70
111	300232	洲明科技	9,972,840.17	4.70
112	600009	上海机场	9,935,328.25	4.68
113	600867	通化东宝	9,883,958.60	4.65
114	000860	顺鑫农业	9,873,576.00	4.65
115	002318	久立特材	9,831,275.23	4.63
116	603939	益丰药房	9,828,120.39	4.63
117	300433	蓝思科技	9,815,668.91	4.62
118	600064	南京高科	9,791,096.74	4.61
119	002001	新 和 成	9,747,255.84	4.59

120	002271	东方雨虹	9,655,667.27	4.55
121	002156	通富微电	9,525,895.81	4.49
122	300119	瑞普生物	9,421,382.00	4.44
123	002541	鸿路钢构	9,238,069.50	4.35
124	688021	奥福环保	9,133,926.71	4.30
125	002600	领益智造	9,085,089.15	4.28
126	688202	美迪西	9,057,550.05	4.27
127	600711	盛屯矿业	9,004,991.00	4.24
128	000708	中信特钢	8,910,056.90	4.20
129	000876	新希望	8,868,859.02	4.18
130	002311	海大集团	8,827,723.00	4.16
131	600741	华域汽车	8,826,917.62	4.16
132	600019	宝钢股份	8,810,123.60	4.15
133	002645	华宏科技	8,795,270.89	4.14
134	603236	移远通信	8,762,930.40	4.13
135	300729	乐歌股份	8,741,360.40	4.12
136	002568	百润股份	8,646,508.48	4.07
137	603338	浙江鼎力	8,515,113.77	4.01
138	601668	中国建筑	8,513,854.60	4.01
139	300253	卫宁健康	8,482,827.86	3.99
140	300496	中科创达	8,462,647.00	3.99
141	002714	牧原股份	8,459,328.00	3.98
142	603225	新凤鸣	8,449,896.82	3.98
143	002583	海能达	8,362,522.22	3.94
144	002851	麦格米特	8,275,800.68	3.90
145	002643	万润股份	8,265,707.00	3.89
146	000651	格力电器	8,211,104.00	3.87
147	603606	东方电缆	8,082,407.28	3.81
148	002797	第一创业	8,080,995.00	3.81
149	002405	四维图新	8,077,963.00	3.80
150	603181	皇马科技	7,985,886.80	3.76

151	002439	启明星辰	7,954,859.65	3.75
152	600496	精工钢构	7,939,904.41	3.74
153	603906	龙蟠科技	7,871,250.36	3.71
154	300394	天孚通信	7,799,744.35	3.67
155	688088	虹软科技	7,754,414.92	3.65
156	600886	国投电力	7,627,897.66	3.59
157	002128	露天煤业	7,626,043.00	3.59
158	600438	通威股份	7,619,026.48	3.59
159	002372	伟星新材	7,591,031.54	3.57
160	300559	佳发教育	7,422,504.25	3.50
161	603516	淳中科技	7,344,166.67	3.46
162	603833	欧派家居	7,310,251.68	3.44
163	603825	华扬联众	7,302,639.36	3.44
164	603697	有友食品	7,300,415.00	3.44
165	300673	佩蒂股份	7,280,482.80	3.43
166	600415	小商品城	7,269,628.00	3.42
167	002461	珠江啤酒	7,207,593.00	3.39
168	603006	黎明股份	7,203,703.97	3.39
169	002081	金螳螂	7,191,360.00	3.39
170	603019	中科曙光	6,998,283.60	3.30
171	300738	奥飞数据	6,968,089.70	3.28
172	002661	克明面业	6,956,997.00	3.28
173	300003	乐普医疗	6,944,750.00	3.27
174	002080	中材科技	6,896,073.79	3.25
175	600048	保利地产	6,878,108.00	3.24
176	600812	华北制药	6,874,695.98	3.24
177	002304	洋河股份	6,870,233.36	3.24
178	002641	永高股份	6,800,981.64	3.20
179	002463	沪电股份	6,786,659.41	3.20
180	300438	鹏辉能源	6,688,082.18	3.15
181	600926	杭州银行	6,653,181.72	3.13

182	601666	平煤股份	6,644,127.54	3.13
183	300666	江丰电子	6,625,649.32	3.12
184	300206	理邦仪器	6,597,694.00	3.11
185	002677	浙江美大	6,570,096.40	3.09
186	002812	恩捷股份	6,555,415.56	3.09
187	300659	中孚信息	6,549,996.09	3.08
188	300347	泰格医药	6,538,450.08	3.08
189	600298	安琪酵母	6,526,907.00	3.07
190	603658	安图生物	6,499,558.00	3.06
191	002153	石基信息	6,494,362.02	3.06
192	300215	电科院	6,488,372.00	3.06
193	002384	东山精密	6,468,195.00	3.05
194	300308	中际旭创	6,456,330.00	3.04
195	600847	万里股份	6,422,843.58	3.02
196	002419	天虹股份	6,420,535.00	3.02
197	600161	天坛生物	6,402,641.00	3.02
198	000333	美的集团	6,350,828.86	2.99
199	601816	京沪高铁	6,319,848.88	2.98
200	002896	中大力德	6,277,847.00	2.96
201	688208	道通科技	6,260,851.56	2.95
202	002291	星期六	6,230,945.10	2.93
203	300677	英科医疗	6,221,706.95	2.93
204	000001	平安银行	6,199,690.00	2.92
205	300322	硕贝德	6,171,790.94	2.91
206	603501	韦尔股份	6,157,284.00	2.90
207	300529	健帆生物	6,156,027.68	2.90
208	603168	莎普爱思	6,123,802.14	2.88
209	002127	南极电商	6,115,954.00	2.88
210	600323	瀚蓝环境	6,113,560.00	2.88
211	601138	工业富联	6,112,175.00	2.88
212	600038	中直股份	6,064,980.00	2.86

213	000786	北新建材	6,034,709.00	2.84
214	300737	科顺股份	6,013,298.53	2.83
215	002216	三全食品	5,981,712.53	2.82
216	603826	坤彩科技	5,954,790.00	2.80
217	300627	华测导航	5,858,279.80	2.76
218	603416	信捷电气	5,826,812.00	2.74
219	002508	老板电器	5,759,653.61	2.71
220	000605	渤海股份	5,720,950.50	2.69
221	002179	中航光电	5,718,785.73	2.69
222	002869	金溢科技	5,708,024.37	2.69
223	601888	中国中免	5,695,183.00	2.68
224	000858	五粮液	5,679,004.00	2.67
225	002007	华兰生物	5,673,822.04	2.67
226	300034	钢研高纳	5,667,373.91	2.67
227	600845	宝信软件	5,649,459.00	2.66
228	601225	陕西煤业	5,649,368.00	2.66
229	600547	山东黄金	5,617,634.00	2.65
230	600966	博汇纸业	5,609,961.83	2.64
231	600885	宏发股份	5,604,629.92	2.64
232	002139	拓邦股份	5,598,379.51	2.64
233	603728	鸣志电器	5,592,408.50	2.63
234	300578	会畅通讯	5,588,822.20	2.63
235	603360	百傲化学	5,582,511.73	2.63
236	000951	中国重汽	5,563,288.85	2.62
237	603568	伟明环保	5,533,908.11	2.61
238	002493	荣盛石化	5,529,967.75	2.60
239	300497	富祥药业	5,480,338.00	2.58
240	002511	中顺洁柔	5,478,337.00	2.58
241	000932	华菱钢铁	5,428,382.00	2.56
242	000656	金科股份	5,405,131.00	2.55
243	300671	富满电子	5,375,350.00	2.53

244	000066	中国长城	5,359,764.00	2.52
245	000739	普洛药业	5,352,717.00	2.52
246	688002	睿创微纳	5,324,430.13	2.51
247	300558	贝达药业	5,311,759.32	2.50
248	603605	珀莱雅	5,307,518.00	2.50
249	000977	浪潮信息	5,298,809.60	2.50
250	688169	石头科技	5,298,492.65	2.50
251	002154	报喜鸟	5,238,926.00	2.47
252	300470	中密控股	5,234,052.00	2.46
253	600862	中航高科	5,182,825.00	2.44
254	600452	涪陵电力	5,167,878.31	2.43
255	603056	德邦股份	5,160,003.00	2.43
256	000681	视觉中国	5,141,969.27	2.42
257	300726	宏达电子	5,132,906.32	2.42
258	603165	荣晟环保	5,107,728.59	2.41
259	300400	劲拓股份	5,101,078.00	2.40
260	601799	星宇股份	5,099,793.00	2.40
261	601128	常熟银行	5,091,324.00	2.40
262	300770	新媒股份	5,087,797.00	2.40
263	603317	天味食品	5,071,816.68	2.39
264	000809	铁岭新城	5,057,759.00	2.38
265	300171	东富龙	5,030,211.00	2.37
266	002489	浙江永强	5,025,799.75	2.37
267	000401	冀东水泥	5,006,481.00	2.36
268	603378	亚士创能	4,986,710.00	2.35
269	001696	宗申动力	4,971,325.00	2.34
270	002028	思源电气	4,959,126.00	2.34
271	300450	先导智能	4,946,943.62	2.33
272	300618	寒锐钴业	4,927,238.00	2.32
273	603708	家家悦	4,910,272.86	2.31
274	002705	新宝股份	4,889,548.72	2.30

275	600036	招商银行	4,880,976.00	2.30
276	002803	吉宏股份	4,862,677.40	2.29
277	002078	太阳纸业	4,830,376.07	2.27
278	600546	山煤国际	4,818,402.00	2.27
279	300607	拓斯达	4,811,514.34	2.27
280	300443	金雷股份	4,785,864.00	2.25
281	300690	双一科技	4,773,022.00	2.25
282	300557	理工光科	4,765,279.00	2.24
283	600859	王府井	4,762,128.00	2.24
284	002237	恒邦股份	4,722,695.57	2.22
285	603369	今世缘	4,721,762.01	2.22
286	600202	哈空调	4,701,226.00	2.21
287	000802	北京文化	4,660,842.00	2.19
288	300250	初灵信息	4,652,561.63	2.19
289	603043	广州酒家	4,651,551.00	2.19
290	002594	比亚迪	4,631,734.52	2.18
291	688037	芯源微	4,630,301.60	2.18
292	600809	山西汾酒	4,613,288.00	2.17
293	300278	华昌达	4,606,256.00	2.17
294	300129	泰胜风能	4,602,911.00	2.17
295	000581	威孚高科	4,601,145.00	2.17
296	002959	小熊电器	4,585,381.90	2.16
297	688356	键凯科技	4,576,251.22	2.16
298	002669	康达新材	4,566,788.00	2.15
299	603116	红蜻蜓	4,560,494.20	2.15
300	002171	楚江新材	4,538,674.00	2.14
301	600760	中航沈飞	4,522,389.00	2.13
302	002624	完美世界	4,508,726.54	2.12
303	300624	万兴科技	4,505,283.80	2.12
304	002760	凤形股份	4,473,231.00	2.11
305	603113	金能科技	4,441,083.02	2.09

306	002142	宁波银行	4,437,404.44	2.09
307	000513	丽珠集团	4,420,514.10	2.08
308	002820	桂发祥	4,419,214.60	2.08
309	300418	昆仑万维	4,411,041.00	2.08
310	300179	四方达	4,383,284.00	2.06
311	600379	宝光股份	4,363,757.58	2.06
312	000715	中兴商业	4,344,515.65	2.05
313	300015	爱尔眼科	4,343,936.62	2.05
314	002557	洽洽食品	4,336,238.17	2.04
315	603258	电魂网络	4,324,931.41	2.04
316	000895	双汇发展	4,318,686.15	2.03
317	600066	宇通客车	4,315,561.00	2.03
318	000711	京蓝科技	4,307,692.60	2.03
319	600104	上汽集团	4,287,806.80	2.02
320	603899	晨光文具	4,287,052.57	2.02

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300759	康龙化成	43,852,136.45	20.65
2	603259	药明康德	31,297,133.28	14.74
3	000725	京东方A	29,635,608.00	13.96
4	601633	长城汽车	27,677,280.62	13.03
5	603659	璞泰来	26,424,708.00	12.44
6	601012	隆基股份	25,194,725.92	11.87
7	600383	金地集团	24,812,526.00	11.69
8	000661	长春高新	23,005,343.10	10.83
9	002027	分众传媒	22,968,408.37	10.82
10	300274	阳光电源	21,787,683.44	10.26

11	600900	长江电力	20,779,697.21	9.79
12	300122	智飞生物	20,658,933.76	9.73
13	600031	三一重工	19,833,705.67	9.34
14	603393	新天然气	19,822,710.56	9.34
15	300630	普利制药	19,520,202.79	9.19
16	002555	三七互娱	19,454,083.26	9.16
17	603883	老百姓	19,439,269.36	9.15
18	603520	司太立	19,335,889.44	9.11
19	601688	华泰证券	19,181,555.60	9.03
20	300196	长海股份	18,644,249.00	8.78
21	300601	康泰生物	18,234,414.97	8.59
22	603881	数据港	17,125,983.51	8.07
23	300037	新宙邦	16,905,944.71	7.96
24	000002	万科A	16,729,343.00	7.88
25	600426	华鲁恒升	16,714,651.21	7.87
26	300124	汇川技术	16,580,014.89	7.81
27	300502	新易盛	16,455,199.69	7.75
28	000338	潍柴动力	16,440,954.31	7.74
29	600309	万华化学	16,440,359.86	7.74
30	300413	芒果超媒	16,232,112.75	7.64
31	300059	东方财富	16,005,117.13	7.54
32	300725	药石科技	15,984,719.85	7.53
33	600690	海尔智家	15,779,328.83	7.43
34	002415	海康威视	15,562,844.56	7.33
35	002475	立讯精密	15,487,044.63	7.29
36	002709	天赐材料	15,282,530.00	7.20
37	603187	海容冷链	15,150,612.20	7.13
38	300454	深信服	14,686,028.00	6.92
39	002371	北方华创	14,457,443.16	6.81
40	600570	恒生电子	14,390,881.27	6.78
41	300073	当升科技	14,284,752.71	6.73

42	002311	海大集团	14,251,202.42	6.71
43	300709	精研科技	14,026,547.60	6.61
44	601689	拓普集团	13,882,368.09	6.54
45	000547	航天发展	13,718,829.48	6.46
46	600588	用友网络	13,702,581.01	6.45
47	300782	卓胜微	13,602,257.20	6.41
48	300729	乐歌股份	12,783,767.72	6.02
49	002410	广联达	12,679,855.45	5.97
50	600276	恒瑞医药	12,670,346.64	5.97
51	000063	中兴通讯	12,645,306.08	5.96
52	603596	伯特利	12,440,276.32	5.86
53	603613	国联股份	12,374,839.39	5.83
54	603737	三棵树	12,280,063.52	5.78
55	601021	春秋航空	12,106,402.18	5.70
56	603707	健友股份	12,088,037.46	5.69
57	300168	万达信息	12,077,672.06	5.69
58	603986	兆易创新	11,900,398.00	5.60
59	300567	精测电子	11,551,966.00	5.44
60	600030	中信证券	11,478,351.80	5.41
61	300674	宇信科技	11,453,412.12	5.39
62	600009	上海机场	11,252,934.11	5.30
63	002271	东方雨虹	11,101,409.40	5.23
64	300604	长川科技	11,077,221.80	5.22
65	000568	泸州老窖	11,049,034.84	5.20
66	002624	完美世界	11,046,485.61	5.20
67	688981	中芯国际-U	10,970,831.08	5.17
68	002938	鹏鼎控股	10,964,746.80	5.16
69	002352	顺丰控股	10,876,593.78	5.12
70	600812	华北制药	10,755,556.81	5.07
71	600064	南京高科	10,703,308.00	5.04

72	300070	碧水源	10,629,487.20	5.01
73	600660	福耀玻璃	10,538,280.41	4.96
74	600885	宏发股份	10,479,402.39	4.94
75	300433	蓝思科技	10,464,771.75	4.93
76	600745	闻泰科技	10,321,238.46	4.86
77	002001	新和成	10,272,736.90	4.84
78	600038	中直股份	10,261,152.00	4.83
79	603338	浙江鼎力	10,233,233.00	4.82
80	300595	欧普康视	10,139,704.00	4.78
81	300476	胜宏科技	9,973,725.92	4.70
82	601318	中国平安	9,963,552.47	4.69
83	600438	通威股份	9,834,989.64	4.63
84	601139	深圳燃气	9,791,174.60	4.61
85	600585	海螺水泥	9,703,221.78	4.57
86	002791	坚朗五金	9,642,166.50	4.54
87	601233	桐昆股份	9,340,488.00	4.40
88	600867	通化东宝	9,317,510.65	4.39
89	600176	中国巨石	9,265,748.26	4.36
90	002756	永兴材料	9,203,054.00	4.33
91	002236	大华股份	9,153,609.05	4.31
92	300003	乐普医疗	9,148,435.24	4.31
93	300659	中孚信息	9,072,680.06	4.27
94	603208	江山欧派	8,988,017.90	4.23
95	000157	中联重科	8,814,544.67	4.15
96	002318	久立特材	8,791,885.00	4.14
97	600406	国电南瑞	8,722,410.63	4.11
98	002851	麦格米特	8,717,137.75	4.11
99	603236	移远通信	8,699,023.00	4.10
100	002812	恩捷股份	8,680,282.00	4.09
101	600886	国投电力	8,611,029.87	4.06
102	603225	新风鸣	8,575,856.72	4.04

103	300253	卫宁健康	8,512,101.86	4.01
104	000625	长安汽车	8,417,012.50	3.96
105	300673	佩蒂股份	8,395,937.80	3.95
106	600711	盛屯矿业	8,394,294.06	3.95
107	002583	海能达	8,321,045.10	3.92
108	002714	牧原股份	8,301,462.57	3.91
109	300315	掌趣科技	8,284,628.00	3.90
110	002797	第一创业	8,246,437.08	3.88
111	603606	东方电缆	8,244,180.59	3.88
112	300129	泰胜风能	8,228,723.89	3.88
113	601816	京沪高铁	8,219,697.79	3.87
114	300740	御家汇	8,154,848.00	3.84
115	002128	露天煤业	8,003,795.00	3.77
116	300438	鹏辉能源	7,857,129.02	3.70
117	300760	迈瑞医疗	7,743,605.44	3.65
118	002007	华兰生物	7,713,706.54	3.63
119	002847	盐津铺子	7,654,855.00	3.60
120	603825	华扬联众	7,602,835.80	3.58
121	600741	华域汽车	7,530,530.31	3.55
122	603501	韦尔股份	7,489,348.93	3.53
123	600887	伊利股份	7,475,185.00	3.52
124	300451	创业慧康	7,466,522.50	3.52
125	002251	步步高	7,385,543.36	3.48
126	300347	泰格医药	7,377,706.55	3.47
127	601799	星宇股份	7,372,887.00	3.47
128	603833	欧派家居	7,367,998.24	3.47
129	603019	中科曙光	7,362,343.20	3.47
130	688396	华润微	7,345,417.74	3.46
131	000333	美的集团	7,290,935.41	3.43
132	002821	凯莱英	7,267,653.76	3.42
133	002568	百润股份	7,260,789.22	3.42

134	002405	四维图新	7,259,689.34	3.42
135	603181	皇马科技	7,234,443.60	3.41
136	000876	新希望	7,205,812.78	3.39
137	688088	虹软科技	7,197,105.18	3.39
138	300738	奥飞数据	7,134,157.50	3.36
139	300357	我武生物	7,123,613.00	3.35
140	603006	黎明股份	7,105,703.00	3.35
141	002081	金螳螂	7,042,372.00	3.32
142	000708	中信特钢	7,037,293.35	3.31
143	603826	坤彩科技	7,030,049.90	3.31
144	300394	天孚通信	6,981,413.40	3.29
145	002463	沪电股份	6,950,268.60	3.27
146	000977	浪潮信息	6,895,533.40	3.25
147	603658	安图生物	6,895,287.10	3.25
148	002661	克明面业	6,888,460.00	3.24
149	002384	东山精密	6,873,236.56	3.24
150	601666	平煤股份	6,792,147.25	3.20
151	603809	豪能股份	6,786,568.00	3.20
152	002304	洋河股份	6,776,687.00	3.19
153	300559	佳发教育	6,770,932.00	3.19
154	600847	万里股份	6,734,007.49	3.17
155	002080	中材科技	6,715,976.31	3.16
156	002461	珠江啤酒	6,701,156.00	3.16
157	002697	红旗连锁	6,683,372.97	3.15
158	600415	小商品城	6,630,964.00	3.12
159	300529	健帆生物	6,607,237.54	3.11
160	603516	淳中科技	6,506,989.08	3.06
161	002493	荣盛石化	6,490,132.00	3.06
162	002928	华夏航空	6,462,929.47	3.04
163	002216	三全食品	6,457,715.76	3.04
164	000786	北新建材	6,412,315.98	3.02

165	300677	英科医疗	6,366,751.56	3.00
166	600298	安琪酵母	6,321,423.00	2.98
167	300206	理邦仪器	6,296,121.00	2.97
168	600547	山东黄金	6,205,944.85	2.92
169	300015	爱尔眼科	6,189,660.00	2.91
170	601668	中国建筑	6,180,922.00	2.91
171	002127	南极电商	6,151,305.03	2.90
172	603168	莎普爱思	6,120,666.70	2.88
173	600323	瀚蓝环境	6,110,510.02	2.88
174	688002	睿创微纳	6,101,913.62	2.87
175	603708	家家悦	6,013,779.00	2.83
176	300322	硕贝德	6,001,314.00	2.83
177	603360	百傲化学	5,967,797.79	2.81
178	002153	石基信息	5,955,578.00	2.80
179	002643	万润股份	5,930,907.00	2.79
180	002439	启明星辰	5,926,571.91	2.79
181	601336	新华保险	5,902,294.52	2.78
182	600966	博汇纸业	5,889,036.32	2.77
183	600048	保利地产	5,851,933.46	2.76
184	000001	平安银行	5,845,429.00	2.75
185	002419	天虹股份	5,798,252.98	2.73
186	300470	中密控股	5,797,345.20	2.73
187	601166	兴业银行	5,797,294.00	2.73
188	300770	新媒股份	5,730,684.41	2.70
189	603317	天味食品	5,707,179.86	2.69
190	002959	小熊电器	5,670,865.00	2.67
191	000605	渤海股份	5,633,876.40	2.65
192	000066	中国长城	5,613,850.00	2.64
193	000739	普洛药业	5,594,800.63	2.63
194	600452	涪陵电力	5,592,366.34	2.63
195	002896	中大力德	5,576,022.00	2.63

196	300497	富祥药业	5,542,582.00	2.61
197	688139	海尔生物	5,490,659.87	2.59
198	603369	今世缘	5,485,936.21	2.58
199	002028	思源电气	5,480,006.65	2.58
200	601128	常熟银行	5,472,687.09	2.58
201	603799	华友钴业	5,471,927.26	2.58
202	002726	龙大肉食	5,455,958.00	2.57
203	600546	山煤国际	5,438,898.56	2.56
204	603165	荣晟环保	5,424,319.46	2.55
205	688202	美迪西	5,352,910.72	2.52
206	300119	瑞普生物	5,339,570.00	2.51
207	000858	五粮液	5,333,602.99	2.51
208	002648	卫星石化	5,327,921.49	2.51
209	300671	富满电子	5,309,082.00	2.50
210	600862	中航高科	5,300,430.00	2.50
211	603568	伟明环保	5,266,539.85	2.48
212	600456	宝钛股份	5,194,730.76	2.45
213	000809	铁岭新城	5,189,167.00	2.44
214	002705	新宝股份	5,188,009.26	2.44
215	688169	石头科技	5,177,678.76	2.44
216	000895	双汇发展	5,166,697.90	2.43
217	601168	西部矿业	5,157,752.00	2.43
218	002601	龙蟠佰利	5,154,086.00	2.43
219	000656	金科股份	5,147,081.00	2.42
220	300618	寒锐钴业	5,129,266.00	2.42
221	601966	玲珑轮胎	5,073,394.93	2.39
222	603697	有友食品	5,064,435.00	2.39
223	600161	天坛生物	5,056,551.18	2.38
224	601888	中国中免	5,028,428.02	2.37
225	300418	昆仑万维	4,991,856.00	2.35
226	002920	德赛西威	4,973,009.00	2.34

227	300558	贝达药业	4,967,686.00	2.34
228	603686	龙马环卫	4,921,754.00	2.32
229	300188	美亚柏科	4,920,954.00	2.32
230	002171	楚江新材	4,912,989.00	2.31
231	300278	华昌达	4,889,298.96	2.30
232	002645	华宏科技	4,889,240.92	2.30
233	002078	太阳纸业	4,872,521.00	2.29
234	002489	浙江永强	4,865,579.00	2.29
235	002869	金溢科技	4,856,593.30	2.29
236	000681	视觉中国	4,802,943.00	2.26
237	300666	江丰电子	4,793,448.09	2.26
238	002237	恒邦股份	4,780,564.95	2.25
239	002682	龙洲股份	4,758,579.16	2.24
240	300171	东富龙	4,709,454.00	2.22
241	000860	顺鑫农业	4,701,068.40	2.21
242	300557	理工光科	4,689,877.00	2.21
243	603116	红蜻蜓	4,666,837.47	2.20
244	002043	兔宝宝	4,665,580.47	2.20
245	002607	中公教育	4,651,756.00	2.19
246	600379	宝光股份	4,610,957.71	2.17
247	002398	垒知集团	4,607,452.00	2.17
248	002803	吉宏股份	4,598,210.00	2.17
249	002511	中顺洁柔	4,591,977.44	2.16
250	000711	京蓝科技	4,587,245.80	2.16
251	000401	冀东水泥	4,560,913.61	2.15
252	600809	山西汾酒	4,505,786.00	2.12
253	002669	康达新材	4,501,934.00	2.12
254	300308	中际旭创	4,478,192.00	2.11
255	603233	大参林	4,462,817.40	2.10
256	002739	万达电影	4,454,021.80	2.10
257	000715	中兴商业	4,437,007.49	2.09

258	000596	古井贡酒	4,436,326.00	2.09
259	300763	锦浪科技	4,436,020.00	2.09
260	000921	海信家电	4,431,013.00	2.09
261	600703	三安光电	4,408,226.00	2.08
262	000581	威孚高科	4,407,939.40	2.08
263	002385	大北农	4,406,558.50	2.08
264	600202	哈空调	4,390,364.00	2.07
265	300607	拓斯达	4,374,044.28	2.06
266	002760	凤形股份	4,357,204.10	2.05
267	603186	华正新材	4,337,234.37	2.04
268	600985	淮北矿业	4,335,961.52	2.04
269	002820	桂发祥	4,312,946.77	2.03
270	002273	水晶光电	4,311,598.23	2.03
271	603916	苏博特	4,269,751.40	2.01

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,161,957,432.69
卖出股票收入（成交）总额	3,626,479,052.90

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-

6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	180,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	180,000.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123091	长海转债	1,800	180,000.00	0.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC2103	IC2103	29	36,258,120.00	862,848.48	套保
公允价值变动总额合计（元）					862,848.48
股指期货投资本期收益（元）					9,159,911.52

股指期货投资本期公允价值变动（元）

862,848.48

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

### 8.12 投资组合报告附注

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

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

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,292,702.24
2	应收证券清算款	24,763,820.72
3	应收股利	-
4	应收利息	13,932.72
5	应收申购款	1,220,829.19
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	31,291,284.87
---	----	---------------

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧数据挖掘混合A	2,959	127,315.53	318,727,089.45	84.60%	57,999,552.06	15.40%
中欧数据挖掘混合C	64,753	2,845.45	128,283,836.29	69.62%	55,967,381.75	30.38%
合计	67,712	8,284.76	447,010,925.74	79.68%	113,966,933.81	20.32%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数	占基金总份额比
----	------	--------	---------

		(份)	例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧数据挖掘混合A	1,481,798.67	0.39%
	中欧数据挖掘混合C	18,168.37	0.01%
	合计	1,499,967.04	0.27%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	中欧数据挖掘混合A	>100
	中欧数据挖掘混合C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中欧数据挖掘混合A	0
	中欧数据挖掘混合C	0
	合计	0

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

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间 (万份)
曲径	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中欧数据挖掘混合A	中欧数据挖掘混合C
--	-----------	-----------

基金合同生效日(2016年01月13日)基金份额总额	506,409,681.98	-
本报告期期初基金份额总额	134,158,240.15	38,787,908.60
本报告期基金总申购份额	391,660,287.95	259,948,219.84
减:本报告期基金总赎回份额	149,091,886.59	114,484,910.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	376,726,641.51	184,251,218.04

注:总申购份额含红利再投、转换入份额,总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

#### 11.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内,基金管理人无重大人事变动。

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为85,000.00元人民币。截至本报告期末,该事务所已向本基金提供4年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

海通 证券	1	-	-	-	-	-
华泰 证券	1	-	-	-	-	-
平安 证券	1	-	-	-	-	-
申万 宏源	1	4,465,048,988.31	57.58%	4,158,312.09	57.58%	-
天风 证券	1	40,249,434.51	0.52%	37,483.75	0.52%	-
西部 证券	1	3,085,729,032.24	39.79%	2,873,743.88	39.79%	-
西南 证券	1	-	-	-	-	-
兴业 证券	1	45,411,388.77	0.59%	42,291.96	0.59%	-
浙商 证券	1	-	-	-	-	-
中信 建投	1	-	-	-	-	-
中信 证券	1	-	-	-	-	-
中信 证券 (华南)	1	-	-	-	-	-
国都 证券	2	118,727,925.56	1.53%	110,571.56	1.53%	-
中泰 证券	2	-	-	-	-	-

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，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

3. 广州证券于2020年4月更名为中信证券（华南）。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	576,035.49	42.12%	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	791,690.90	57.88%	2,966,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券(华南)	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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

2. 本报告期内，本基金无新增或减少租用证券公司交易单元的情况。

3. 广州证券于2020年4月更名为中信证券（华南）。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2019年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2020-01-18
2	中欧基金管理有限公司关于延长2020年春节假期对旗下	中国证监会指定媒介	2020-01-30

	基金业务影响的提示性公告		
3	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金产品在中欧钱滚滚电子交易平台开展费率优惠活动及调整交易限额的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-08
4	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金产品在中欧钱滚滚电子交易平台开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-18
5	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-18
6	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金产品在中欧钱滚滚电子交易平台延长费率优惠时间的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-06
7	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“闻泰科技”股票估值方法的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-17
8	中欧基金管理有限公司关于调整旗下基金在部分销售机构定投业务起点金额的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
9	中欧基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
10	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2019年年度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-01
11	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-22

12	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资的公告	中国证监会指定媒介	2020-05-27
13	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资的公告	中国证监会指定媒介	2020-07-08
14	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2020-07-21
15	中欧基金管理有限公司关于调整中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金大额申购、转换转入和定期定额投资限额的公告	中国证监会指定媒介	2020-08-13
16	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年中期报告	中国证监会指定媒介	2020-08-31
17	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年资料概要更新	中国证监会指定媒介	2020-08-31
18	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在中欧钱滚滚电子交易平台单笔最低申购、定投金额的公告	中国证监会指定媒介	2020-09-29
19	中欧基金管理有限公司关于调整中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金大额申购、转换转入和定期定额投资限额的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-13
20	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2020年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2020-10-28

21	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金修改基金合同和托管协议的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-31
22	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）	中国证监会指定媒介	2020-10-31
23	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（修订）	中国证监会指定媒介	2020-10-31
24	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（2020年11月）	中国证监会指定媒介	2020-11-04
25	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会指定媒介	2020-11-04
26	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-11-13
27	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（2020年12月）	中国证监会指定媒介	2020-12-31

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2020年2月14日至2020年3月4日；2020年3月10日至2020年3月10日；2020年4月20日至2020年5月2	22,454,863.92	59,988,245.26	0.00	82,443,109.18	14.70%

		8日;2020年6月4日至2020年6月14日;2020年6月16日至2020年7月7日					
产品特有风险							
<p>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。</p>							

注: 申购份额含红利再投、转换入份额, 赎回份额含转换出份额。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金相关批准文件
- 2、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
- 4、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本报告期内在中国证监会指定媒介上公开披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司:

客户服务中心电话: 021-68609700, 400-700-9700

中欧基金管理有限公司  
二〇二一年三月三十一日