

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(2016 年第 1 号)

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

二零一六年八月

本基金经 2015 年 10 月 30 日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）下发的《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》（证监许可[2015]2423 号文）准予募集注册。本基金基金合同于 2016 年 1 月 13 日正式生效。

重要提示

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或者保证。

投资有风险，投资人在认购（或申购）本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件，自主判断基金的投资价值，自主做出投资决策，自行承担投资风险。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

本基金的投资范围包括中小企业私募债券。中小企业私募债券存在因市场交易量不足而不能迅速、低成本地转变为现金的流动性风险，以及债券的发行人出现违约、无法支付到期本息的信用风险，可能影响基金资产变现能力，造成基金资产损失。本基金管理人将秉承稳健投资的原则，审慎参与中小企业私募债券的投资，严格控制中小企业私募债券的投资风险。

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。

投资人购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资人应当认真阅读基金合同、招募说明书等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。投资人在获得基金投资收益的同时，亦承担基金投资中出现的各类风险，可能包括：证券市场整体环境引发的系统性风险、个别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操作风险以及本基金特有风险等。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不预示其未来表现，基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在作出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本更新招募说明书所载内容截止日为 2016 年 7 月 12 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

目 录

第一部分 基金管理人	5
第二部分 基金托管人	13
第三部分 相关服务机构	18
第四部分 基金的名称	25
第五部分 基金的类型	25
第六部分 基金的投资目标	25
第七部分 基金的投资范围	25
第八部分 基金的投资策略	26
第九部分 基金的业绩比较基准	28
第十部分 基金的风险收益特征	29
第十一部分 基金投资组合报告	29
第十二部分 基金的业绩	34
第十三部分 基金的费用与税收	36

第一部分 基金管理人

一、基金管理人概况

- 1、名称：中欧基金管理有限公司
- 2、住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层
- 3、办公地址：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层、上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层
- 4、法定代表人：竇玉明
- 5、组织形式：有限责任公司
- 6、设立日期：2006 年 7 月 19 日
- 7、批准设立机关：中国证监会
- 8、批准设立文号：证监基金字[2006]102 号
- 9、存续期间：持续经营
- 10、电话：021-68609600
- 11、传真：021-33830351
- 12、联系人：袁维
- 13、客户服务热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）
- 14、注册资本：1.88 亿元人民币
- 15、股权结构：
意大利意联银行股份合作公司出资 6,580 万元人民币，占公司注册资本的 35%；
国都证券股份有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；
北京百骏投资有限公司出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；
上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）出资 3,760 万元人民币，占公司注册资本的 20%；
万盛基业投资有限责任公司出资 940 万元人民币，占公司注册资本的 5%。
上述五个股东共出资 18,800 万元人民币。

二、主要人员情况

1、基金管理人董事会成员

竇玉明先生，清华大学经济管理学院本科、硕士，美国杜兰大学 MBA，中国籍。

中欧基金管理有限公司董事长，上海盛立基金会理事会理事，国寿投资控股有限公司独立董事。曾任职于君安证券有限公司、大成基金管理有限公司。历任嘉实基金管理有限公司投资总监、总经理助理、副总经理兼基金经理，富国基金管理有限公司总经理。

Marco D' Este 先生，意大利籍。现任中欧基金管理有限公司副董事长。历任布雷西亚农业信贷银行（CAB）国际部总监，联合信贷银行（Unicredit）米兰总部客户业务部客户关系管理、跨国公司信用状况管理负责人，联合信贷银行东京分行资金部经理，意大利意联银行股份合作公司（UBI）机构银行业务部总监，并曾在 Credito Italiano（意大利信贷银行）圣雷莫分行、伦敦分行、纽约分行及米兰总部工作。

朱鹏举先生，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、国都证券股份有限公司投资银行总部业务董事、投资银行业务内核小组副组长，兼任国都景瑞投资有限公司副总经理。曾任职于联想集团有限公司、中关村证券股份有限公司，国都证券股份有限公司计划财务部高级经理、副总经理。

刘建平先生，北京大学法学硕士，中国籍。现任中欧基金管理有限公司董事、总经理。历任北京大学助教、副科长，中国证券监督管理委员会基金监管部副处长，上投摩根基金管理有限公司督察长。

David Youngson 先生，英国籍。现任 IFM（亚洲）有限公司创办者及合伙人，英国公认会计师特许公会-资深会员及香港会计师公会会员，中欧基金管理有限公司独立董事。历任安永（中国香港特别行政区及英国伯明翰，伦敦）审计经理、副总监，赛贝斯股份有限公司亚洲区域财务总监。

郭雳先生，北京大学法学博士（国际经济法），美国哈佛大学法学硕士（国际金融法），美国南美以美大学法学硕士（国际法/比较法），中国籍。现任北京大学法学院教授、院长助理，中欧基金管理有限公司独立董事。历任北京大学法学院讲师、副教授，美国康奈尔大学法学院客座教授。

戴国强先生，中国籍。上海财经大学金融专业硕士，复旦大学经济学院世界经济专业博士。现任中欧基金管理有限公司独立董事。历任上海财经大学金融学院常务副院长、院长、党委书记，上海财经大学 MBA 学院院长兼书记，上海财经大学商学院书记兼副院长。

2、基金管理人监事会成员

唐步先生，中欧基金管理有限公司监事会主席，中欧盛世资产管理（上海）有限公司董事长，中国籍。历任上海证券中央登记结算公司副总经理，上海证券交易所会员部总监、监察部总监，大通证券股份有限公司副总经理，国都证券有限责

任公司副总经理、总经理，中欧基金管理有限公司董事长。

廖海先生，中欧基金管理有限公司监事，上海源泰律师事务所合伙人，中国籍。武汉大学法学博士、复旦大学金融研究院博士后。历任深圳市深华工贸总公司法律顾问，广东钧天律师事务所合伙人，美国纽约州 Schulte Roth & Zabel LLP 律师事务所律师，北京市中伦金通律师事务所上海分所合伙人。

陆正芳女士，中欧基金管理有限公司交易总监，中国籍，上海财经大学证券期货系学士，13年以上证券及基金从业经验。历任申银万国证券股份有限公司中华路营业部经纪人。

李琛女士，中欧基金管理有限公司客户服务总监，中国籍，同济大学计算机应用专业学士，17年以上证券及基金从业经验。历任大连证券上海番禺路营业部系统管理员，大通证券上海番禺路营业部客户服务部主管。

3、基金管理人高级管理人员

窦玉明先生，中欧基金管理有限公司董事长，中国籍。简历同上。

刘建平先生，中欧基金管理有限公司总经理，中国籍。简历同上。

卢纯青女士，中欧基金管理有限公司分管投资副总经理，兼任中欧基金管理有限公司研究总监、事业部负责人，中国籍。加拿大圣玛丽大学金融学硕士，11年以上基金从业经验。历任北京毕马威华振会计师事务所审计，中信基金管理有限责任公司研究员，银华基金管理有限公司研究员、行业主管、研究总监助理、研究副总监。

许欣先生，中欧基金管理有限公司分管市场副总经理，中国籍。中国人民大学金融学硕士，15年以上基金从业经验。历任华安基金管理有限公司北京分公司销售经理，嘉实基金管理有限公司机构理财部总监，富国基金管理有限公司总经理助理。

卞玺云女士，中欧基金管理有限公司督察长，中国籍。中国人民大学注册会计师专业学士，8年以上证券及基金从业经验。历任毕马威会计师事务所助理审计经理，银华基金管理有限公司投资管理部副总监，中欧基金管理有限公司风控总监。

4、本基金基金经理

曲径女士，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金经理，中国籍。美国卡内基梅隆大学计算金融专业硕士，9年以上证券从业经验。历任千禧年基金量化基金经理，中信证券股份有限公司另类投资业务线高级副总裁。2015年4月加入中欧基金管理有限公司，现任事业部负责人、中欧沪深300指数增强型证券投资基金（LOF）基金经理（2015年5月18日起至今）、中欧数据挖掘多因

子灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2016年1月13日起至今）。

5、基金管理人投资决策委员会成员

投资决策委员会是公司进行基金投资管理的最高投资决策机构，由总经理刘建平、分管投资副总经理卢纯青、事业部负责人周蔚文、陆文俊、刁羽、刘明月、周玉雄、曲径、赵国英、曹名长、王健、王培组成。其中总经理刘建平任投资决策委员会主席。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金管理人的职责

- 1、依法募集资金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；
- 2、办理基金备案手续；
- 3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；
- 4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；
- 5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；
- 6、编制季度、半年度和年度基金报告；
- 7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；
- 8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；
- 9、按照规定召集基金份额持有人大会；
- 10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；
- 11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
- 12、法律、行政法规、中国证监会和基金合同规定的其他职责。

四、基金管理人的承诺

- 1、基金管理人承诺不从事违反《中华人民共和国证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《中华人民共和国证券法》行为的发生。
- 2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：
 - （1）将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
 - （2）不公平地对待管理的不同基金财产；
 - （3）利用基金财产或者职务之便为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
 - （4）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

- (5) 侵占、挪用基金财产；
- (6) 泄露因职务便利获取的未公开信息、利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；
- (7) 玩忽职守，不按照规定履行职责；
- (8) 法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

3、基金管理人承诺严格遵守基金合同，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反基金合同行为的发生。

4、基金管理人承诺加强人员管理，强化职业操守，督促和约束员工遵守国家有关法律法规及行业规范，诚实信用、勤勉尽责。

5、基金管理人承诺不从事其他法规规定禁止从事的行为。

6、基金经理承诺

(1) 依照有关法律、法规和基金合同的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；

(2) 不利用职务之便为自己及其代理人、受雇人或任何第三人牟取利益；

(3) 不违反现行有效的有关法律法规、基金合同和中国证监会的有关规定，不泄漏在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息，或利用该信息从事或者明示、暗示他人从事相关的交易活动；

(4) 不从事损害基金财产和基金份额持有人利益的证券交易及其他活动。

五、基金管理人的内部控制制度

1、内部控制的原则

(1) 健全性原则。内部控制应当包括公司的各项业务、各个部门或机构和各级人员，并涵盖到决策、执行、监督、反馈等各个环节。

(2) 有效性原则。通过科学的内控手段和方法，建立合理的内控程序，维护内控制度的有效执行。

(3) 独立性原则。公司各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。

(4) 相互制约原则。公司内部部门和岗位的设置应当权责分明、相互制衡。

(5) 成本效益原则。公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，以合理的控制成本达到最佳的内部控制效果。

2、内部控制的体系结构

公司的内部控制体系结构是一个分工明确、相互牵制的组织结构，各个业务部门负责本部门的风险评估和监控，监察稽核部负责监察公司的风险管理措施的执行。

具体而言，包括如下组成部分：

- （1）董事会：负责制定公司的内部控制政策，对内部控制负完全的和最终的责任。
- （2）监事会：对公司的经营情况进行检查，并对董事会和管理层履行职责的情况进行监督。
- （3）督察长：独立行使督察权利，直接对董事会负责；就内部控制制度和执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；向董事会和中国证监会进行定期、不定期报告。
- （4）投资决策委员会：负责指导基金财产的运作，对基金投资的所有重大问题进行决策。
- （5）风险控制委员会：协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项进行讨论和决策。
- （6）监察稽核部：独立于其他部门和业务活动，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈，使公司在良好的内部控制环境中实现业务目标。
- （7）业务部门：具体执行公司各项内部控制制度及政策，确保各项业务活动合法、合规进行。

3、内部控制的措施

- （1）部门及岗位设置体现了职责明确、相互制约原则。
各部门及岗位均设立明确的授权分工及工作职责，并编制详细的岗位说明书和业务流程；建立重要凭据传递及信息沟通制度，实现相关部门、相关岗位之间的监督制衡。
- （2）严格授权控制。
授权控制贯穿于公司经营活动的始终。公司建立了合理的授权标准和流程，确保授权制度的贯彻执行。重大业务的授权应采取书面形式，明确授权内容和实效，对已获授权的部门和人员应建立有效的评价和反馈机制。
- （3）实行恰当的岗位分离。
建立科学的岗位分离制度，各业务部门在适当授权的基础上实行恰当的岗位分离。重要业务和岗位进行物理隔离，投资与交易、交易与清算、基金会计与公司会计等重要岗位不得有人员重叠。
- （4）建立完善的资产分离制度。
建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算。
- （5）建立严密有效的风险管理系统。

风险管理系统包括两方面：一是公司主要业务的风险评估和检测办法、重要部门风险指标考核体系以及业务人员道德风险防范体系等；二是公司灵活有效的应急、应变措施和危机处理机制。通过严密有效的风险管理系统，对公司内外部风险进行识别、评估和分析，及时防范和化解风险。

(6) 建立完整的信息资料保全系统。

真实、全面、及时、准确地记载每一笔业务，及时准确地进行会计核算和业务记录，完整妥善地保管好会计、统计和各项业务资料档案，确保原始记录、合同契约、各种信息资料数据真实完整。

4、基金管理人关于内部控制制度的声明书

基金管理人确知建立内部控制系统、维持其有效性以及有效执行内部控制制度是基金管理人董事会及管理层的责任，董事会承担最终责任；本基金管理人特别声明以上关于内部控制制度和风险管理的披露真实、准确，并承诺根据市场的变化和基金管理人的发展不断完善风险管理和内部控制制度。

第二部分 基金托管人

一、基金托管人的情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：易会满

注册资本：人民币 35,640,625.71 万元

联系电话：010-66105799

联系人：洪渊

2、主要人员情况

截至 2016 年 3 月末，中国工商银行资产托管部共有员工 198 人，平均年龄 30 岁，95%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有研究生以上学历或高级技术职称。

3、基金托管业务经营情况

作为中国大陆托管服务的先行者，中国工商银行自 1998 年在国内首家提供托管服务以来，秉承“诚实信用、勤勉尽责”的宗旨，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的管理模式、先进的营运系统和专业的服务团队，严格履行资

产托管人职责，为境内外广大投资者、金融资产管理机构和企业客户提供安全、高效、专业的托管服务，展现优异的市场形象和影响力。建立了国内托管银行中最丰富、最成熟的产品线。拥有包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社会保障基金、企业年金基金、QFII 资产、QDII 资产、股权投资基金、证券公司集合资产管理计划、证券公司定向资产管理计划、商业银行信贷资产证券化、基金公司特定客户资产管理、QDII 专户资产、ESCROW 等门类齐全的托管产品体系，同时在国内率先开展绩效评估、风险管理等增值服务，可以为各类客户提供个性化的托管服务。截至 2016 年 3 月，中国工商银行共托管证券投资基金 555 只。自 2003 年以来，本行连续十一年获得香港《亚洲货币》、英国《全球托管人》、香港《财资》、美国《环球金融》、内地《证券时报》、《上海证券报》等境内外权威财经媒体评选的 49 项最佳托管银行大奖；是获得奖项最多的国内托管银行，优良的服务品质获得国内外金融领域的持续认可和广泛好评。

二、基金托管人的内部控制制度

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。继 2005、2007、2009、2010、2011、2012、2013、2014 年八次顺利通过评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的 SAS70（审计标准第 70 号）审阅后，2015 年中国工商银行资产托管部第九次通过 ISAE3402（原 SAS70）审阅获得无保留意见的控制及有效性报告，表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨，达到国际先进水平。目前，ISAE3402 审阅已经成为年度化、常规化的内控工作手段。

1、内部风险控制目标

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

2、内部风险控制组织结构

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务

处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

3、内部风险控制原则

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内部控制制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

4、内部风险控制措施实施

(1) 严格的隔离制度。资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) 高层检查。主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能管理部门改进。

(3) 人事控制。资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并

通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) 经营控制。资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) 内部风险管理。资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期地对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) 数据安全控制。我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) 应急准备与响应。资产托管业务建立专门的灾难恢复中心，制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案，并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战，资产托管部不断提高演练标准，从最初的按照预订时间演练发展到现在的“随机演练”。从演练结果看，资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工的共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部风险控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部

始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控制为托管业务生存和发展的生命线。

三、基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

根据《基金法》、基金合同、基金托管人与基金管理人签署的托管协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资监督和检查自基金合同生效之日开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、托管协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

第三部分 相关服务机构

一、基金份额发售机构

（一）直销机构：

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 333 号东方汇经大厦 5 层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路 66 号东亚银行金融大厦 8 层

联系人：袁维

电话：021-68609602

传真：021-68609601

客服热线：021-68609700，400-700-9700（免长途话费）

网址：www.zofund.com

（二）其他销售机构

（1）中国工商银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街 55 号
法定代表人:易会满
联系人:刘秀宇
电话: 010-6610860
传真: 010-66107571

客服热线:95588

网址:www.icbc.com.cn

(2) 招商银行股份有限公司

住所:广东省深圳市福田区深南大道 7088 号
办公地址:广东省深圳市福田区深南大道 7088 号
法定代表人:李建红
联系人:邓炯鹏
电话: 0755-83198888
传真: 0755-83195109
客服热线: 95555

公司网站: www.cmbchina.com

(3) 中国建设银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街 25 号
办公地址:北京市西城区金融大街 25 号
法定代表人:王洪章
联系人:张静
电话: 010-66215533
传真: 010-66218888
客服热线: 95533

网址: www.ccb.com

(4) 交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路 188 号
办公地址:上海市浦东新区银城中路 188 号
法定代表人:牛锡明
联系人:张宏革

电话：021-58781234

传真：021-58408483

客服热线：95559

网址：www.bankcomm.com

（5）上海浦东发展银行股份有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：刘信义

联系人：唐苑

电话：021-61618888

传真：021-63604199

客服热线：95528

网址：www.spdb.com.cn

（6）国都证券股份有限公司

住所：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址：北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人：王少华

联系人：黄静

电话：010-84183389

传真：010-64482090

客服热线：400-818-8118

网址：www.guodu.com

（7）中信证券股份有限公司

住所：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场(二期)北座

办公地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦；北京市朝阳区

亮马桥路 48 号中信证券大厦

法定代表人：张佑君

联系人：侯艳红

电话：010-60836030；0755-23835383

传真：010-60836031；0755-23835525

客服热线：95558

网址：www.citics.com

（8）中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼 20 层
办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层
法定代表人：杨宝林
联系人：吴忠超
电话：0532-85022313
传真：0532-85022301
客服热线：0532-96577
网址：www.zxwt.com.cn

(9) 中信期货有限公司

住所：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
办公地址：深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座 13 层 1301-1305 室、14 层
法定代表人：张皓
联系人：洪城
电话：0755-23953913
客户热线：400-990-8826
网址：www.citicsf.com

(10) 上海好买基金销售有限公司

住所：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼
办公地址：上海市浦东新区浦东南路 1118 号鄂尔多斯国际大厦 9 楼
法定代表人：杨文斌
联系人：张茹
电话：021-20613999
客服热线：400-700-9665
网址：www.howbuy.com

(11) 杭州数米基金销售有限公司

住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路东 2 号
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道 3588 号恒生大厦 12 楼
法定代表人：陈柏青
联系人：徐映绯
电话：0571-28829790
传真：0571-26698533

客服热线：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(12) 上海天天基金销售有限公司

住所：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼

法定代表人：其实

联系人：李广宇

电话：021-54509998-7019

传真：021-64385308

客服热线：400-1818-188

网址：www.1234567.com.cn

(13) 浙江同花顺基金销售有限公司

住所：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

办公地址：浙江省杭州市文二西路一号元茂大厦 903

法定代表人：李晓涛

联系人：汪林林

电话：0571-88920810

传真：0571-86800423

客服热线：400-877-3772

网址：www.5ifund.com

(14) 上海陆金所资产管理有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

联系人：宁博宇

电话：021-20665952

传真：021-22066653

客户热线：400-821-9031

网址：www.lufunds.com

(15) 珠海盈米财富管理有限公司

住所：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼

B1201-1203

法定代表人：肖雯

联系人：黄敏嫦

电话：020-89629099

传真：020-89629011

客户热线：020-89629099

网址：www.yingmi.cn

(16) 中证金牛（北京）投资咨询有限公司

住所：北京市丰台区东管头1号2号楼2-45室

办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲1号新华社第三工作区5F

法定代表人：钱昊旻

联系人：孙雯

电话：010-59336519

传真：010-59336500

客服热线：4008909998

网址：www.jnlc.com

基金管理人可以根据情况变化、增加或者减少销售机构，并另行公告。销售机构可以根据情况变化、增加或者减少其销售城市、网点，并另行公告。各销售机构提供的基金销售服务可能有所差异，具体请咨询各销售机构。

二、登记机构

名称：中欧基金管理有限公司

住所：中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦5层

办公地址：上海市浦东新区花园石桥路66号东亚银行金融大厦8层

法定代表人：竇玉明

总经理：刘建平

成立日期：2006年7月19日

电话：021-68609600

传真：021-68609601

联系人：杨毅

三、出具法律意见书的律师事务所

名称：上海市通力律师事务所

住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人：俞卫锋

经办律师：黎明、陆奇

电话：021-31358666

传真：021-31358600

联系人：陆奇

四、审计基金财产的会计师事务所

会计师事务所名称：普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：李丹

电话：021-23238888

传真：021-23238800

联系人：俞伟敏

经办会计师：单峰 俞伟敏

第四部分 基金的名称

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

第五部分 基金的类型

契约型、开放式

第六部分 基金的投资目标

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

第七部分 基金的投资范围

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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。

第八部分 基金的投资策略

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。

1、大类资产配置策略

本基金运用自上而下和自下而上相结合的方法进行大类资产配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。综合考虑本基金的投资目标、市场发展趋势、风险控制要求等因素，制定本基金资产的大类资产配置比例。

2、股票投资策略

基金管理人在资产配置的框架下，将互联网大数据与公司量化团队开发的量化选股模型相结合，通过数据挖掘方法为主的多种量化策略，综合考虑基本面因子、动量因子，以及大数据因子，并利用量化手段优化各因子的权重，对个股的投资价值进行综合评分，精选具有较高投资价值的上市公司构建投资组合。

（1） 基本面因子

基金选取的基本面因子包括：市盈率、市净率、市销率、资产市值比等估值类因子；主营业务收入增长率、净利润增长率、EPS 增长率、总资产增长率等成长类因子。基金通过量化因子分析模型，分析每只个股的基本面因子得分。

（2） 动量因子

选取短期收益率、长期收益率、相对波动、交易量变化、自由流通市值、分析师一致预期、一致预期调整等，根据量化模型计算得到动量因子得分。

（3） 大数据因子

基金运用大数据研究方法，综合考察分析师观点、分析师覆盖度、研究报告关键语义、网络关注度、信息热度、信息传播速度、用户行为、业务扩张、商品价格变化等因子，并给予相关股票相应评分。

（4）综合评分

基金管理人将通过包含数据挖掘方法在内的多种量化手段，优化基本面因子得分、动量因子得分和大数据因子得分的权重，在此基础上获取个股最终的综合评分，并挑选其中具有较高投资价值的投资标的构建组合。

3、债券投资策略

本基金将采取久期偏离、期限结构配置、类属配置、个券选择等积极的投资策略，构建债券投资组合。

（1）久期偏离

本基金通过对宏观经济走势、货币政策和财政政策、市场结构变化等方面的定性分析和定量分析，预测利率的变化趋势，从而采取久期偏离策略，根据对利率水平的预期调整组合久期。

（2）期限结构配置

本基金将根据对利率走势、收益率曲线的变化情况的判断，适时采用哑铃型或梯型或子弹型投资策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以便最大限度的避免投资组合收益受债券利率变动的负面影响。

（3）类属配置

类属配置指债券组合中各债券种类间的配置，包括债券在国债、央行票据、金融债、企业债、可转换债券等债券品种间的分布，债券在浮动利率债券和固定利率债券间的分布。

（4）个券选择

个券选择是指通过比较个券的流动性、到期收益率、信用等级、税收因素，确定一定期限下的债券品种的过程。

4、股指期货投资策略

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。

5、资产支持证券投资策略

资产支持证券是指由金融机构作为发起机构，将信贷资产信托给受托机构，由受托机构向投资机构发行，以该财产所产生的现金支付其收益的证券。本基金通过对资产池结构和质量的跟踪考察、分析资产支持证券的发行条款、预估提前偿还

率变化对资产支持证券未来现金流的影响，谨慎投资资产支持证券。

6、股票期权投资策略

本基金将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，参与股票期权的投资。本基金将在有效控制风险的前提下，选择流动性好、交易活跃的期权合约进行投资。本基金将基于对证券市场的预判，并结合股指期权定价模型，选择估值合理的期权合约。

基金管理人将根据审慎原则，建立股票期权交易决策部门或小组，按照有关要求做好人员培训工作，确保投资、风控等核心岗位人员具备股票期权业务知识和相应的专业能力，同时授权特定的管理人员负责股票期权的投资审批事项，以防范期权投资的风险。

7、中小企业私募债投资策略

与传统的信用债券相比，中小企业私募债券由于以非公开方式发行和转让，普遍具有高风险和高收益的显著特点。本基金将运用基本面研究，结合公司财务分析方法对债券发行人信用风险进行分析和度量，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体为：①研究债券发行人的公司背景、产业发展趋势、行业政策、盈利状况、竞争地位、治理结构等基本面信息，分析企业的长期运作风险；②运用财务评价体系对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、成长能力、现金流水平等方面进行综合评价，评估发行人财务风险；③利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算私募债券发行人的违约率及违约损失率；④考察债券发行人的增信措施，如担保、抵押、质押、银行授信、偿债基金、有序偿债安排等；⑤综合上述分析结果，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择具有投资价值的品种进行投资。

8、权证投资策略

本基金的权证投资以控制风险和锁定收益为主要目的。在个券层面上，本基金通过对权证标的公司的基本面研究和未来走势预判，估算权证合理价值，同时还充分考虑个券的流动性，谨慎进行投资。

第九部分 基金的业绩比较基准

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%。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高、

流通市值大的主流股票，能够反映 A 股市场总体价格走势。中债综合指数是由中央国债登记结算有限公司编制的具有代表性的债券市场指数。根据本基金的投资范围和投资比例，选用上述业绩比较基准能够客观、合理地反映本基金的风险收益特征。

如果今后法律法规发生变化，或证券市场中有其他代表性更强或者更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，并报中国证监会备案，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应在调整实施前 2 个工作日在指定媒介上予以公告。

第十部分 基金的风险收益特征

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。

第十一部分 基金投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人根据基金合同规定，复核了本投资组合报告，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据取自本基金 2016 年第 2 季度报告，所载数据截至 2016 年 6 月 30 日，本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例 (%)

1 权益投资 203,635,793.47 64.79

其中：股票 203,635,793.47 64.79

2 基金投资 — —

3 固定收益投资 — —

其中：债券 — —

资产支持证券 — —

4 贵金属投资 — —

5 金融衍生品投资 — —
 6 买入返售金融资产 — —
 其中：买断式回购的买入返售金融资产 — —
 7 银行存款和结算备付金合计 92,569,877.98 29.45
 8 其他资产 18,109,310.39 5.76
 9 合计 314,314,981.84 100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

(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	8,957,310.88	2.90
B	采矿业	4,905,367.21	1.59
C	制造业	136,055,120.07	44.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,960,515.71	1.61
E	建筑业	7,361,076.74	2.39
F	批发和零售业	10,366,368.80	3.36
G	交通运输、仓储和邮政业	2,684,869.00	0.87
H	住宿和餐饮业	264,334.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,151,613.61	1.99
J	金融业	1,994,638.03	0.65
K	房地产业	7,859,096.81	2.55
L	租赁和商务服务业	4,307,637.75	1.40
M	科学研究和技术服务业	879,660.85	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	1,113,136.50	0.36
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	227,450.00	0.07
Q	卫生和社会工作	338,390.93	0.11
R	文化、体育和娱乐业	2,899,805.58	0.94
S	综合	2,309,401.00	0.75
	合计	203,635,793.47	66.00

(2) 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 数量（股） 公允价值（元） 占基金资产净值比例（%）

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

4 报告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。

5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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 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 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

(1) 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值(元) 公允价值变动(元) 风险说明

IC1612 中证 500 指数 24 27,149,760.00 2,986,760.00

IC1609 中证 500 指数 -16 -18,784,640.00 -771,080.00

公允价值变动总额合计(元) 2,215,680.00

股指期货投资本期收益(元) 1,427,851.05

股指期货投资本期公允价值变动(元) 1,007,680.95

(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。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

(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。

(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。

(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。

11 投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 6,075,508.52

2 应收证券清算款 11,979,528.73

3 应收股利 —

- 4 应收利息 19,458.47
- 5 应收申购款 34,814.67
- 6 其他应收款 —
- 7 待摊费用 —
- 8 其他 —
- 9 合计 18,109,310.39

(4) 报告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。

(5) 报告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。

(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。

第十二部分 基金的业绩

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。

本基金合同生效日 2016 年 1 月 13 日，基金业绩截止日 2016 年 6 月 30 日。

1. 本报告期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 净值增长率① 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

2016.1.13-2016.6.30 5.80% 1.22% -1.01% 0.94% 6.81% 0.28%

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

累计份额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-2016 年 6 月 30 日)

注：本基金基金合同生效日期为 2016 年 1 月 13 日，自基金合同生效日起到本报

告期末不满一年，按基金合同的规定，本基金自基金合同生效起六个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例应当符合基金合同的规定。

数据来源：中欧基金 wind

第十三部分 基金的费用与税收

一、基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后与基金相关的信息披露费用；
- 4、基金合同生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券/期货交易费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的相关账户的开户及维护费用；
- 9、按照国家有关规定和基金合同约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

二、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

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

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。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

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

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。

上述“一、基金费用的种类中第 3—9 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

3、证券账户开户费用：证券账户开户费经基金管理人与基金托管人核对无误后，自本基金成立一个月内由基金托管人从基金财产中划付，如基金财产余额不足支付该开户费用，由基金管理人于本基金成立一个月后的 5 个工作日内进行垫付，基金托管人不承担垫付开户费用义务。

三、不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、基金合同生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

四、费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可按照基金发展情况，并根据法律法规规定和基金合同约定调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。

基金管理人与基金托管人协商一致调低基金管理费率、基金托管费率等费率，无需召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须于新的费率实施日前在指定媒介上公告。

五、基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

第二十二部分 对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关规定，并依据本基金管理人在本基金合同生效后对本基金实施的投资经营活动，对本基金管理人于 2015 年 12 月刊登的《中欧数据挖掘多

因子灵活配置混合型证券投资基金基金招募说明书》进行了更新，主要更新内容如下：

一、“重要提示”部分

增加了“本更新招募说明书所载内容截止日为 2016 年 7 月 12 日（特别事项注明除外），有关财务数据和净值表现截止日为 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。”的描述。

二、“三、基金管理人”部分

更新了基金管理人住所、办公地址、董事会成员、公司高级管理人员、本基金基金经理的信息。

三、“四、基金托管人”部分

更新了托管人的相关信息。

四、“五、相关服务机构”部分

更新了直销机构、登记机构的信息。

五、“六、基金的募集”部分

1、增加了基金的募集信息。

2、删除了涉及募集期的描述。

六、“七、基金合同的生效”部分

1、增加了基金合同的生效日期。

2、删除了涉及基金合同生效和募集失败的描述。

七、“八、基金份额的申购与赎回”部分

增加了本基金开始办理申购、赎回业务的时间；

八、“九、基金的投资”部分

增加了“十、基金投资组合报告”的内容，数据截至 2016 年 6 月 30 日。

九、“十、基金的业绩”部分

增加了整章的信息，包括“本报告期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”和“基金累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，数据截至 2016 年 6 月 30 日。

十、“二十、基金托管协议的内容摘要”

更新了基金管理人的住所、办公地址。

十一、“二十二、其它应披露事项”部分

增加了整章的信息，包括自 2016 年 1 月 13 日至 2016 年 7 月 12 日涉及本基金的相关公告。

以下为本基金管理人自 2016 年 1 月 13 日至 2016 年 7 月 12 日刊登于《中国证券

报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的公告。

序号 公告事项 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基金合同生效公告
2016/1/14
- 2 中欧基金管理有限公司住所变更公告 2016/1/20
- 3 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“宝通科技”股票估值方法的公告 2016/1/27
- 4 中欧数据挖掘多因子混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告 2016/2/16
- 5 中欧基金管理有限公司代行督察长公告 2016/2/19
- 6 中欧基金管理有限公司关于中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告 2016/2/19
- 7 中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率优惠的公告
2016/2/25
- 8 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增同花顺为代销机构并参与费率优惠的公告 2016/3/18
- 9 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 2016/3/30
- 10 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增盈米财富为代销机构并参与费率优惠的公告 2016/3/30
- 11 中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长安汽车”股票估值方法的公告 2016/3/31
- 12 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金互相转换范围的公告 2016/4/15
- 13 中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告
2016/4/21
- 14 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 2016/4/28
- 15 中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告 2016/5/7
- 16 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与费率优惠活动的公告 2016/5/16
- 17 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行开通基金转换和定投业务的公告 2016/5/23
- 18 中欧基金管理有限公司关于新增浦发银行为旗下部分基金代销机构同步开通

转换和定投业务的公告 2016/5/25

19 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金定投业务并参与费率优惠的公告 2016/6/17

20 中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告 2016/6/28

21 中欧基金管理有限公司关于旗下基金 2016 年 6 月 30 日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值公告 2016/7/1

22 中欧基金管理有限公司关于新增数米基金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 2016/7/1

上述内容仅为摘要，须与本基金更新招募说明书（正文）所载之详细资料一并阅读。

中欧基金管理有限公司

2016 年 8 月 26 日