

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

2016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：2017年3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2017年3月29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2016年1月13日起至2016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 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 .....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	13
§5 托管人报告 .....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 .....	13
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 .....	13
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 .....	14
§6 审计报告 .....	14
6.1 审计报告基本信息 .....	14
6.2 审计报告的基本内容 .....	14
§7 年度财务报表 .....	15
7.1 资产负债表 .....	15
7.2 利润表 .....	17
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	19
§8 投资组合报告 .....	45
8.1 期末基金资产组合情况 .....	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	45
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 .....	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 投资组合报告附注 .....	56
§9 基金份额持有人信息 .....	57
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57

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 .....	57
§10 开放式基金份额变动 .....	57
§11 重大事件揭示 .....	58
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	58
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 .....	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
11.4 基金投资策略的改变 .....	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
11.8 其他重大事件 .....	61
§12 备查文件目录 .....	67
12.1 备查文件目录 .....	67
12.2 存放地点 .....	67
12.3 查阅方式 .....	67

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中欧数据挖掘混合
基金主代码	001990
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2016年1月13日
基金管理人	中欧基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	396,481,150.92
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资组合风险的前提下，通过积极主动的资产配置，力争获得超越业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金力争通过合理判断市场走势，配置股票、股指期货、债券等投资工具的比例，通过定量与定性相结合的方法精选个股，并适当运用股指期货对冲系统性风险，注重风险与收益的平衡，力争实现基金资产长期稳健增值。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金，属于较高预期收益和预期风险水平的投资品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人		基金托管人
名称	中欧基金管理有限公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露负责	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	010-66105799

人	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		窦玉明	易会满

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金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、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中欧基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路333号东方汇经大厦五层

## § 3 主要财务指标、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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	2016年1月13日-2016年12月31日
本期已实现收益	35,738,572.97
本期利润	33,748,037.28
加权平均基金份额本期利润	0.0953
本期加权平均净值利润率	9.33%
本期基金份额净值增长率	10.05%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年末
期末可供分配利润	5,238,389.04
期末可供分配基金份额利润	0.0132
期末基金资产净值	401,719,539.96
期末基金份额净值	1.013
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年末
基金份额累计净值增长率	10.05%

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

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

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

4、本基金合同于2016年1月13日生效，故无上年可比区间，下同。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

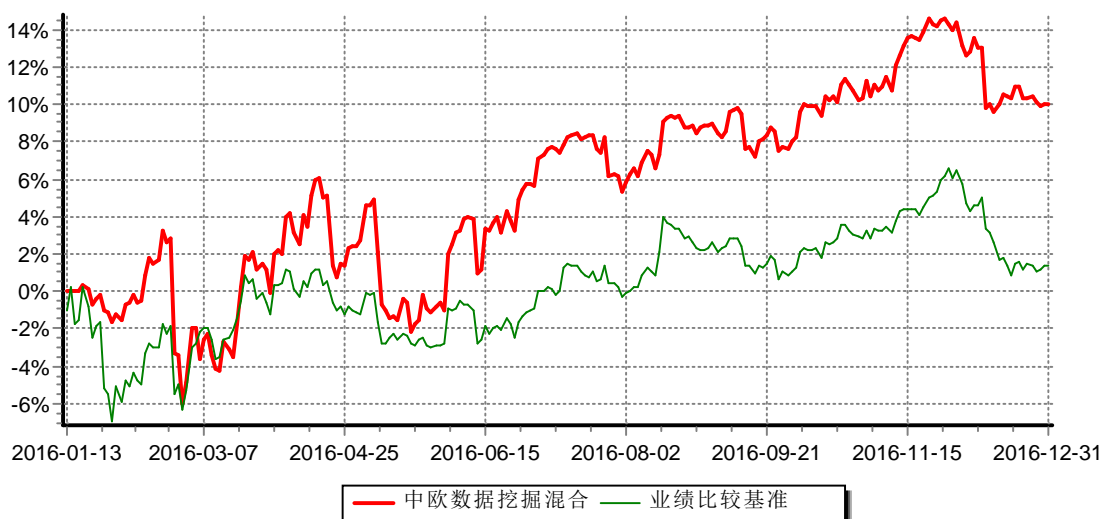
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.64%	0.58%	0.13%	0.45%	1.51%	0.13%
过去六个月	4.02%	0.58%	2.44%	0.47%	1.58%	0.11%
自基金合同生效日起至今	10.05%	0.94%	1.40%	0.73%	8.65%	0.21%

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

交易日进行一次再平衡，每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡，使大类资产比例保持恒定。

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

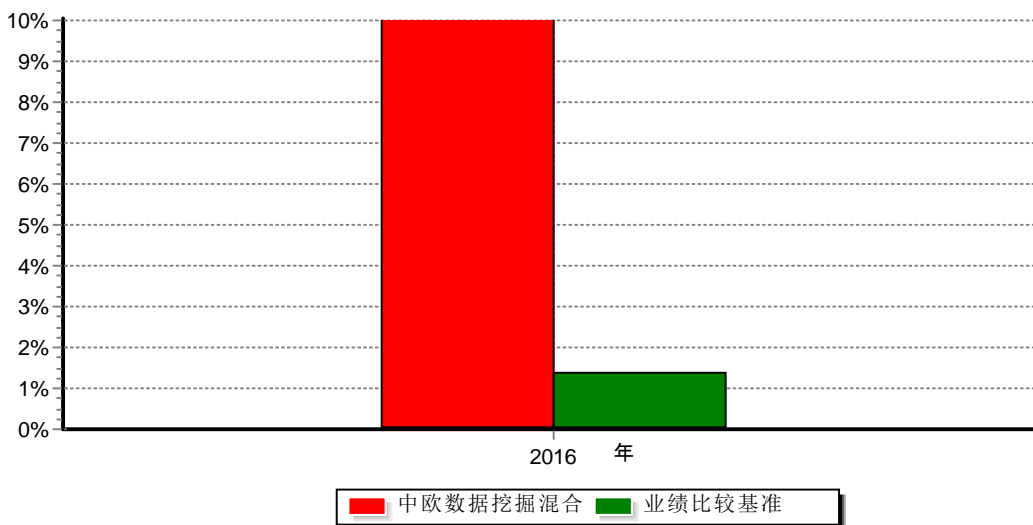
中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2016年1月13日-2016年12月31日)



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已达到基金合同的规定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	0.880	18,320,664.19	5,679,381.50	24,000,045.69	
合计	0.880	18,320,664.19	5,679,381.50	24,000,045.69	

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102号文）批准，于2006年7月19日正式成立。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、万盛基业投资有限责任公司，注册资本为1.88亿元人民币，旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理（上海）有限公司、钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司。截至2016年12月31日，本基金管理人共管理50只开放式基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助	证券从	说明
----	----	-------------	-----	----

		理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
曲径	基金经 理,事业 部负责 人	2016年1月 13日	—	10年	历任千禧年基金量化基金 经理, 中信证券股份有限 公司另类投资业务线高级 副总裁。2015年4月加入中 欧基金管理有限公司, 现 任事业部负责人, 中欧沪 深300指数增强型证券投 资基金(LOF)基金经理, 中欧数据挖掘多因子灵活 配置混合型证券投资基金 基金经理、中欧睿诚定期 开放混合型证券投资基金 基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

根据相关法律法规, 公司制订了《公平交易管理办法》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。在投资决策方面, 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等均能有效隔离; 在交易执行方面, 以系统控制和人工审阅相结合的方式, 严控反向交易和同向交易; 另外, 中央交易室在交易执行过程中对公平交易实施一线监控, 监察稽核部也会就投资交易行为进行分析和评估, 定期进行公平交易的内部审计工作。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度市场经历了A股市场经历了熔断暴跌，底部振荡，和小幅反弹三个阶段；二季度大盘筑底企稳，整体波动率明显下降，不同行业收益分化较大，业绩好成长性预期强的行业，如新能源车产业链等板块有结构化行情；三季度，市场整体波动率又创新低，市场的预期风险不高，同时成长股业绩普遍超预期，业绩驱动的行情有利于量化方法甄选个股；四季度，全球黑天鹅事件集中爆发，境外事件包括美国加息以及川普意外当选总统；国内中央经济工作会议明确提出“谨慎中性”的货币政策，市场流动性收紧，债市整体大幅回调；流动性紧缩也传到至股票市场，体现为小盘股风险大幅释放，业绩蓝筹股和创业板的剪刀差效应十分明显，整体市场呈现震荡行情，波动率明显加大。基金成立于1月份，我们依据量化模型的预测逐步建仓；在2016年的结构化行情中，利用量化模型主要配置了热点板块及其价值洼地，在窄幅振荡的市场中获得了稳定的超额收益；此外定向增发等事件套利，也为基金收益做出了贡献；同时数据挖掘积极参与了新股申购，在2016年网下新股申购门槛较高的情况下，公募基金打新优势比较明显。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金份额净值增长率为10.05%，同期业绩比较基准增长率为1.40%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为在楼市全面调控，央行维持谨慎中性的情况下，资本市场仍以震荡为主。量化模型在震荡市中优势较大，未来我们仍将维持2016年的操作方式，利用量化择时模

型判断仓位，采纳量化选股模块进行具体热点板块和相关个股的配置；同时，在条件允许的情况下，积极参与风险较低的新股申购等策略，以增厚收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016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

2016年，监管机构相继颁布了一系列法律法规，涵盖港股通、FOF基金、债券交易、融资融券、基金公司子公司管理、营改增、反洗钱、投资者适当性等多项内容，公司在收到以上文件后第一时间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

2016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十余项，内容涵盖信息披露、员工投资管理、信息管制、内部审计、母子公司风控合作、估值委员会议事规则、反洗钱、客户风险等级管理、文件报备、市场中台工作规范等各项内容。

##### （三）加强内部审计，强化风险管理

2016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公司分管运营副总经理，成员包括总经理、督察长、投资总监，基金运营部总监，监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允、合理，防止估值被歪曲进而对基金持有人产

生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金向全体份额持有人进行利润分配。第一次分红权益登记日为2016年7月18日，每10份基金份额派发红利0.33元，合计发放红利 7,062,728.82 元，其中现金分红5,021,274.67 元。第二次分红权益登记日为2016年8月29日，每10份基金份额派发红利0.24元，合计发放红利6,519,740.92 元，其中现金分红为4,895,057.71 元。第三次分红权益登记日为2016年11月28日，每10份基金份额派发红利0.31元，合计发放红利10,417,575.95 元，其中现金分红为8,404,331.81 元。

本基金本年度收益分配满足法律法规的规定及基金合同的约定。

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

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的管理人——中欧基

金管理有限公司在中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金对基金份额持有人进行了三次利润分配，分配金额为24,000,045.69元。

### 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2016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	普华永道中天审字(2017)第21383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：
引言段	我们审计了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(以下简称“中欧数据挖掘多因子基金”)的财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表、2016年1月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中欧数据挖掘多因子基金的基金管理人中欧基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使

	<p>其实现公允反映；</p> <p>(2) 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。</p>
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>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。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述中欧数据挖掘多因子基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了中欧数据挖掘多因子基金2016年12月31日的财务状况以及2016年1月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	单峰、俞伟敏
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2017-03-28

## § 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：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	89,248,656.97
结算备付金		3,628,538.76
存出保证金		5,959,211.71
交易性金融资产	7.4.7.2	143,780,148.56
其中：股票投资		143,780,148.56
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	200,000,000.00
应收证券清算款		5,198,449.95
应收利息	7.4.7.5	227,373.66
应收股利		—
应收申购款		306,819.94
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		448,349,199.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016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		44,203,351.90
应付赎回款		516,921.91



应付管理人报酬		451,704.97
应付托管费		75,284.18
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	1,015,456.44
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	366,940.19
负债合计		46,629,659.59
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	396,481,150.92
未分配利润	7.4.7.10	5,238,389.04
所有者权益合计		401,719,539.96
负债和所有者权益总计		448,349,199.55

注：1.报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.013元，基金份额总额396,481,150.92份。

2.本基金合同于2016年1月13日生效，故无上年度可比期间数据。

## 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：2016年1月13日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016年1月13日至2016年12月31日
一、收入		47,394,773.93
1.利息收入		2,303,139.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	705,244.15
债券利息收入		—
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收		1,597,895.41

入		
其他利息收入		—
2.投资收益（损失以“-”填列）		45,975,083.43
其中：股票投资收益	7.4.7.12	37,717,255.90
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益		—
衍生工具收益	7.4.7.14	7,328,808.42
股利收益	7.4.7.15	929,019.11
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,990,535.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,107,086.63
<b>减：二、费用</b>		13,646,736.65
1. 管理人报酬		5,242,016.99
2. 托管费		873,669.58
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.18	7,064,950.08
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.19	466,100.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		33,748,037.28
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		33,748,037.28

注：本基金合同于2016年1月13日生效，故无上年度可比期间数据，下同。

### 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：2016年1月13日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月13日至2016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)	506,409,681.98	—	506,409,681.98
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	33,748,037.28	33,748,037.28
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)	-109,928,531.06	-4,509,602.55	-114,438,133.61
其中：1.基金申购款	297,519,958.08	13,557,665.89	311,077,623.97
2.基金赎回款	-407,448,489.14	-18,067,268.44	-425,515,757.58
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)	—	-24,000,045.69	-24,000,045.69
五、期末所有者权益(基金净值)	396,481,150.92	5,238,389.04	401,719,539.96

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，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2016)第57号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2016年1月13日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为506,409,681.98份基金份额，其中认购资金利息折合301,243.65基金份额。本基金的基金管理人为中欧基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会批准发行上市的股票）、固定收益类资产（国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、资产支持证券、质押及买断式债券回购、银行存款及现金等）、衍生工具（权证、股指期货、股票期权等）以及经中国证监会批准允许基金投资的其他金融工具（但需符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为0%-95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%；每个交易日日终，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

本财务报表由本基金的基金管理人中欧基金管理有限公司于2017年3月31日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年1月13日(基金合同生效日)至2016年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1)金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

###### (2)金融负债的分类

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

##### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债

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

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余

额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

### 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

无。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进



一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

#### 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 2016年12月31日
活期存款	89,248,656.97
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	89,248,656.97

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
----	-----------------

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		146,519,067.83	143,780,148.56	-2,738,919.27
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		146,519,067.83	143,780,148.56	-2,738,919.27

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

项目	本期末 2016年12月31日			
	合同/名义	公允价值		备注
	金额	资产	负债	(投资成本)
利率衍生工具				
一无	-	-	-	-
货币衍生工具				
一外汇期货	-	-	-	-
权益衍生工具	27,589,920.00			
一股指期货	27,589,920.00	-	-	-
一指数期权	-	-	-	-
一股票期权	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	27,589,920.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。具

体投资情况详见下表（买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示）：

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动(元)	风险说明
IC1703	中证500期货 1703合约	11	13,376,880.00	867,031.58	
IC1706	中证500期货 1706合约	3	3,535,680.00	-31,240.00	
IF1703	沪深300期货 1703合约	4	3,900,960.00	132,672.00	
IH1703	上证50期货 1703合约	10	6,776,400.00	-220,080.00	
公允价值变动总额合计(元)					748,383.58
股指期货投资本期收益(元)					7,328,808.42
股指期货投资本期公允价值变动(元)					748,383.58

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	160,000,000.00	—
银行间市场	40,000,000.00	—
合计	200,000,000.00	—

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日

应收活期存款利息	12,098.99
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	1,417.57
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	212,775.27
应收申购款利息	999.99
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	81.84
合计	227,373.66

#### 7.4.7.6 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,015,456.44
银行间市场应付交易费用	—
合计	1,015,456.44

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,940.19
预提信息披露费	300,000.00
预提审计费	65,000.00
合计	366,940.19

### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月13日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	506,409,681.98	506,409,681.98
本期申购	297,519,958.08	297,519,958.08
本期赎回（以“-”号填列）	-407,448,489.14	-407,448,489.14
本期末	396,481,150.92	396,481,150.92

注：1、申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2、本基金自2015年12月16日至2016年1月11日止期间公开发售，共募集有效净认购资金506,108,438.33元。根据《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入301,243.65元在本基金成立后，折算为301,243.65份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》的相关规定，本基金于2016年1月13日（基金合同生效日）起至2016年2月18日止的期间，暂不向投资人开放基金交易，日常申购、赎回和转换业务均从2016年2月19日起开始办理。

### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	35,738,572.97	-1,990,535.69	33,748,037.28
本期基金份额交易产生的变动数	1,670,738.70	-6,180,341.25	-4,509,602.55
其中：基金申购款	12,759,942.13	797,723.76	13,557,665.89
基金赎回款	-11,089,203.43	-6,978,065.01	-18,067,268.44
本期已分配利润	-24,000,045.69	—	-24,000,045.69
本期末	13,409,265.98	-8,170,876.94	5,238,389.04

### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日至2016年12月31日
活期存款利息收入	624,304.66
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	72,616.11
其他	8,323.38
合计	705,244.15

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日至2016年12月31日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	37,717,255.90
股票投资收益——赎回差价 收入	—
股票投资收益——申购差价 收入	—
合计	37,717,255.90

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	2,282,883,641.16
减：卖出股票成本总额	2,245,166,385.26
买卖股票差价收入	37,717,255.90

#### 7.4.7.13 债券投资收益

无余额。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

无余额。

#### 7.4.7.14.1 衍生工具收益——其他投资收益

金额单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2016年1月13日至2016年12月31日
期货	7,328,808.42

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	929,019.11
基金投资产生的股利收益	—
合计	929,019.11

#### 7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年1月13日至2016年12月31日
1.交易性金融资产	-2,738,919.27
——股票投资	-2,738,919.27
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	748,383.58
——权证投资	—
——期货投资	748,383.58
3.其他	—

合计	-1,990,535.69
----	---------------

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月13日至2016年12月31日
基金赎回费收入	1,101,466.77
转换费收入	5,619.86
合计	1,107,086.63

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月13日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	7,046,406.40
银行间市场交易费用	—
期货市场交易费用	18,543.68
合计	7,064,950.08

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月13日至2016年12月31日
审计费用	65,000.00
信息披露费	400,000.00
开户费	400.00
汇划手续费	700.00
合计	466,100.00

#### 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，本基金并无须作披露的或有事项。



### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

1. 财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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》(财税[2016]140号), 要求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, 自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号), 2017年7月1日(含)以后, 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, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

2. 根据本基金管理人中欧基金管理有限公司2017年1月19日《关于旗下部分开放式基金增加C类份额、提高净值精确度并相应修改基金合同的公告》的规定, 经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案, 自2017年1月19日起对本基金增加C类份额并相应修改基金合同。原份额更名为A类份额。A类份额在投资者申购时收取申购费用, 但不从本类别基金资产中计提销售服务费, C类份额在投资者申购时不收取费用, 而是从本类别基金资产中计提销售服务费。

### 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("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
万盛基业投资有限责任公司("万盛基业")	基金管理人的股东
北京百骏投资有限公司("北京百骏")	基金管理人的股东
Unione di Banche Italiane S.p.a ("意大利意联银行")	基金管理人的股东
上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙) ("上海睦亿合伙")	基金管理人的股东
中欧盛世资产管理(上海)有限公司 ("中	基金管理人的控股子公司

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

注: 下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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 2016年1月13日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国都证券	1,564,778,289.60	33.51%

注: 本基金2016年1月13日成立, 无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

无。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位: 人民币元

关联方名称	本期 2016年1月13日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
国都证券	535,000,000.00	8.31%

注: 本基金2016年1月13日成立, 无上年度可比期间数据。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

无。

##### 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 2016年1月13日至2016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	1,457,279.08	33.51%	160,906.09	15.85%

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。

3. 本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

## 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 2016年1月13日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,242,016.99
其中：支付销售机构的客户维护费	3,221,893.93

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 1.50% / 当年天数。

2.本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月13日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	873,669.58

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

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

2.本基金2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

### 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

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金管理人本报告期内未持有本基金。

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

除基金管理人之外的其他关联方本报告期内均未持有本基金。

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月13日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行 活期存款	89,248,656.97	624,304.66

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

2、本基金合同于2016年1月13日成立，无上年度可比期间数据。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日	每10份基金 份额分红数	现金形 式 发放	再投资形式 发放	利润分 配 合计	备注
	2016-07 -18	2016-07-18	0.330	5,021,27 4.67	2,041,454.1 5	7,062,72 8.82	
	2016-08 -29	2016-08-29	0.240	4,895,05 7.71	1,624,683.2 1	6,519,74 0.92	
	2016-11 -28	2016-11-28	0.310	8,404,33 1.81	2,013,244.1 4	10,417,5 75.95	

合计			0.880	18,320,664.19	5,679,381.50	24,000,045.69	
----	--	--	-------	---------------	--------------	---------------	--

注：资产负债表日之后，年度报告批准报出日之前的利润分配参见资产负债表日后事项(附注：7.4.8.2)。

## 7.4.12 期末（2016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
601375	中原证券	2016-12-20	2017-01-03	新股未上市	4.00	4.00	26,695	106,780.00	106,780.00
603877	太平鸟	2016-12-29	2017-01-09	新股未上市	21.30	21.30	3,180	67,734.00	67,734.00
300583	赛托生物	2016-12-29	2017-01-06	新股未上市	40.29	40.29	1,582	63,738.78	63,738.78
603689	皖天然气	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	7.87	7.87	4,818	37,917.66	37,917.66
603228	景旺电子	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	23.16	23.16	1,455	33,697.80	33,697.80
603035	常熟汽饰	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	10.44	10.44	2,316	24,179.04	24,179.04
603266	天龙股份	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	14.63	14.63	1,562	22,852.06	22,852.06
300587	天铁股份	2016-12-28	2017-01-05	新股未上市	14.11	14.11	1,438	20,290.18	20,290.18
002840	华统股份	2016-12-29	2017-01-10	新股未上市	6.55	6.55	1,814	11,881.70	11,881.70
002838	道恩股份	2016-12-28	2017-01-06	新股未上市	15.28	15.28	682	10,420.96	10,420.96
603186	华正新材	2016-12-26	2017-01-03	新股未上市	5.37	5.37	1,874	10,063.38	10,063.38
603032	德新交运	2016-12-27	2017-01-05	新股未上市	5.81	5.81	1,628	9,458.68	9,458.68
300586	美联新材	2016-12-26	2017-01-04	新股未上市	9.30	9.30	1,006	9,355.80	9,355.80
300591	万里马	2016-12-30	2017-01-10	新股未上市	3.07	3.07	2,396	7,355.72	7,355.72
30058	熙菱	2016-12-27	2017-	新股未上	4.94	4.94	1,380	6,817.20	6,817.20

8	信息		01-05	市					
---	----	--	-------	---	--	--	--	--	--

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位: 股)	期末 成本总额	期末 估值总额
600090	同济堂	2016-12-26	重大事项未公告	11.75	2017-01-10	12.93	241,261	3,008,162.28	2,834,816.75
000987	越秀金控	2016-08-29	重大资产重组	14.49	2017-01-09	15.94	101,900	1,573,990.50	1,476,531.00
300450	先导智能	2016-11-15	重大资产重组	33.99	2017-02-08	33.00	22,900	782,572.00	778,371.00
000821	京山轻机	2016-12-05	重大资产重组	16.24		—	23,000	346,612.70	373,520.00
002440	闰土股份	2016-10-21	重大资产重组	16.34	2017-01-12	15.22	22,000	338,630.04	359,480.00
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	13.79		—	23,200	334,507.44	319,928.00
300047	天源迪科	2016-08-15	重大资产重组	19.90	2017-01-06	19.00	16,000	319,900.52	318,400.00
000697	炼石有色	2016-11-17	重大资产重组	23.51		—	10,900	257,131.00	256,259.00
002635	安洁科技	2016-11-08	重大资产重组	36.40	2017-02-08	33.50	6,300	199,138.68	229,320.00
000727	华东科技	2016-11-17	重大资产重组	3.37	2017-02-15	3.47	67,600	227,872.00	227,812.00
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项	11.28		—	17,200	220,020.00	194,016.00
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大资产重组	25.94	2017-02-15	23.99	7,100	171,533.00	184,174.00
300098	高新兴	2016-11-17	重大资产重组	15.84	2017-01-23	14.26	10,900	158,426.09	172,656.00
002492	恒基达鑫	2016-02-24	重大资产重组	12.66		—	12,700	148,845.34	160,782.00
600859	王府井	2016-09-27	重大资产重组	16.28		—	9,600	158,240.13	156,288.00
600855	航天长峰	2016-11-08	重大资产重组	28.89		—	5,300	156,526.00	153,117.00
300535	达威股份	2016-12-12	重大资产重组	90.29		—	1,100	105,036.00	99,319.00
60065	豫园	2016-	重大事项	11.42		—	8,400	94,062.00	95,928.00

5	商城	12-20	未公告						
002798	帝王洁具	2016-11-02	重大资产重组	67.00	2017-01-17	60.34	1,400	87,845.00	93,800.00
300473	德尔股份	2016-11-01	重大资产重组	78.12	2017-02-10	71.00	1,200	85,380.00	93,744.00
600875	东方电气	2016-12-09	重大事项	10.79	2017-03-28	10.90	8,600	93,658.00	92,794.00
300179	四方达	2016-07-04	重大资产重组	7.70	2017-02-07	8.08	11,500	85,102.19	88,550.00
300513	恒泰实达	2016-10-31	重大资产重组	95.36	2017-02-24	86.18	900	83,745.00	85,824.00
300518	盛讯达	2016-12-13	重大资产重组	113.46		—	700	92,103.00	79,422.00
000803	金宇车城	2016-06-23	重大资产重组	21.24	2017-01-23	23.36	3,700	88,444.59	78,588.00
002239	奥特佳	2016-10-18	重大资产重组	15.69	2017-02-07	14.12	4,300	68,898.00	67,467.00
300496	中科创达	2016-10-11	重大资产重组	52.28	2017-01-06	47.49	1,100	61,274.00	57,508.00
300537	广信材料	2016-10-12	重大资产重组	48.79	2017-01-13	43.91	1,024	9,410.56	49,960.96
603111	康尼机电	2016-12-26	重大事项未公告	14.70		—	2,600	38,264.43	38,220.00
002491	通鼎互联	2016-12-22	重大事项	15.54	2017-01-03	15.89	2,300	37,718.56	35,742.00
300100	双林股份	2016-11-07	重大资产重组	34.00	2017-01-25	30.60	800	28,372.00	27,200.00
000050	深天马A	2016-09-12	重大资产重组	18.82	2017-03-23	20.70	1,300	25,042.00	24,466.00

注：本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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

于本报告期末，本基金无银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于本报告期末，本基金无交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、风险管理部、监察稽核部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。风险控制委员会负责协助确立公司风险控制的原则、目标和策略，并就风险控制重要事项提出意见和建议。督察长负责组织和指导公司的监察稽核工作。监察稽核部独立于公司各业务部门开展监察稽核工作，根据监管机构及公司内部控制的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约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

#### **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公司的证券不得超过该证券的10%。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2016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。

#### 7.4.13.4 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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及买入返售金融资产等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	89,248,656.97	—	—	—	89,248,656.97
结算备付金	3,628,538.76	—	—	—	3,628,538.76
存出保证金	5,959,211.71	—	—	—	5,959,211.71
交易性金融资产	—	—	—	143,780,148.56	143,780,148.56
买入返售金融资产	200,000,000.00	—	—	—	200,000,000.00
应收证券清算款	—	—	—	5,198,449.95	5,198,449.95
应收利息	—	—	—	227,373.66	227,373.66
应收申购款	—	—	—	306,819.94	306,819.94
资产总计	298,836,407.44	—	—	149,512,792.11	448,349,199.55
负债					
应付证券清算款	—	—	—	44,203,351.90	44,203,351.90
应付赎回款	—	—	—	516,921.91	516,921.91
应付管理人报酬	—	—	—	451,704.97	451,704.97
应付托管费	—	—	—	75,284.18	75,284.18
应付交易费用	—	—	—	1,015,456.44	1,015,456.44
其他负债	—	—	—	366,940.19	366,940.19
负债总计	—	—	—	46,629,659.59	46,629,659.59
利率敏感度缺口	298,836,407.44	—	—	102,883,132.52	401,719,539.96

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 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 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	143,780,148.56	35.79
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	143,780,148.56	35.79

##### 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(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变
----	-------------------------------

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）
		本期末(2016年12月31日)
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	2,025.16
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-2,025.16

#### 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

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于2016年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134,033,601.89元，属于第二层次的余额为9,746,546.67元，无属于第三层次的余额。

##### (ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	143,780,148.56	32.07
	其中：股票	143,780,148.56	32.07
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	200,000,000.00	44.61
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	92,877,195.73	20.72
7	其他各项资产	11,691,855.26	2.61
8	合计	448,349,199.55	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	—	—
B	采矿业	4,296,226.42	1.07
C	制造业	90,046,078.57	22.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,977,916.66	1.74
E	建筑业	815,324.83	0.20
F	批发和零售业	10,252,638.87	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	6,165,216.12	1.53
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,803,055.55	1.94
J	金融业	6,756,550.00	1.68
K	房地产业	5,761,877.54	1.43
L	租赁和商务服务业	319,928.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	3,572,800.00	0.89
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	1,012,536.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	143,780,148.56	35.79

### 8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有沪港通股票。

### 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：

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	300187	永清环保	290,000	3,572,800.00	0.89
2	600891	秋林集团	351,200	3,273,184.00	0.81
3	601997	贵阳银行	200,900	3,170,202.00	0.79
4	002683	宏大爆破	353,483	3,138,929.04	0.78

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

5	600127	金健米业	441,254	2,934,339.10	0.73
6	600090	同济堂	241,261	2,834,816.75	0.71
7	600780	通宝能源	481,500	2,662,695.00	0.66
8	300261	雅本化学	263,350	2,546,594.50	0.63
9	600688	上海石化	385,200	2,480,688.00	0.62
10	600773	西藏城投	207,200	2,471,896.00	0.62
11	002175	东方网络	142,300	2,170,075.00	0.54
12	300305	裕兴股份	168,168	2,169,367.20	0.54
13	600787	中储股份	237,700	2,155,939.00	0.54
14	300329	海伦钢琴	130,000	2,093,000.00	0.52
15	603822	嘉澳环保	33,300	2,029,302.00	0.51
16	000568	泸州老窖	60,700	2,003,100.00	0.50
17	600180	瑞茂通	143,478	1,942,692.12	0.48
18	000703	恒逸石化	128,600	1,932,858.00	0.48
19	600233	大杨创世	74,500	1,899,005.00	0.47
20	002751	易尚展示	40,600	1,885,464.00	0.47
21	002322	理工环科	77,800	1,856,308.00	0.46
22	600515	海航基础	159,990	1,855,884.00	0.46
23	002235	安妮股份	113,038	1,799,564.96	0.45
24	000863	三湘印象	209,900	1,782,051.00	0.44
25	300151	昌红科技	153,600	1,761,792.00	0.44
26	002195	二三四五	152,974	1,731,665.68	0.43
27	600201	生物股份	54,800	1,731,132.00	0.43
28	002341	新纶科技	81,100	1,710,399.00	0.43
29	600602	云赛智联	179,239	1,708,147.67	0.43
30	600004	白云机场	118,000	1,662,620.00	0.41
31	002355	兴民智通	120,200	1,633,518.00	0.41
32	000521	美菱电器	230,900	1,597,828.00	0.40
33	603968	醋化股份	65,000	1,576,900.00	0.39
34	000895	双汇发展	72,900	1,525,797.00	0.38

35	600990	四创电子	20,938	1,522,192.60	0.38
36	002768	国恩股份	61,000	1,515,240.00	0.38
37	002084	海鸥卫浴	140,900	1,514,675.00	0.38
38	002627	宜昌交运	60,356	1,493,207.44	0.37
39	603678	火炬电子	19,700	1,490,305.00	0.37
40	000987	越秀金控	101,900	1,476,531.00	0.37
41	000026	飞亚达 A	105,800	1,449,460.00	0.36
42	000059	华锦股份	120,000	1,428,000.00	0.36
43	601127	小康股份	51,800	1,385,132.00	0.34
44	002654	万润科技	124,000	1,368,960.00	0.34
45	000790	泰合健康	103,600	1,364,412.00	0.34
46	002096	南岭民爆	90,000	1,300,500.00	0.32
47	300447	全信股份	23,300	1,292,684.00	0.32
48	603601	再升科技	80,000	1,287,200.00	0.32
49	002615	哈尔斯	71,300	1,251,315.00	0.31
50	600066	宇通客车	63,742	1,248,705.78	0.31
51	603012	创力集团	119,904	1,243,404.48	0.31
52	300503	昊志机电	17,200	1,170,976.00	0.29
53	300398	飞凯材料	20,100	1,170,624.00	0.29
54	600761	安徽合力	91,358	1,162,073.76	0.29
55	300456	耐威科技	22,800	1,161,204.00	0.29
56	002653	海思科	70,300	1,098,789.00	0.27
57	002690	美亚光电	50,000	1,058,000.00	0.26
58	600589	广东榕泰	119,940	1,049,475.00	0.26
59	000768	中航飞机	49,100	1,043,866.00	0.26
60	600643	爱建集团	83,100	1,031,271.00	0.26
61	000150	宜华健康	32,800	1,012,536.00	0.25
62	600426	华鲁恒升	75,671	1,002,640.75	0.25
63	002703	浙江世宝	31,100	958,502.00	0.24
64	000921	海信科龙	91,900	938,299.00	0.23



65	600748	上实发展	105,366	862,947.54	0.21
66	601169	北京银行	88,400	862,784.00	0.21
67	002055	得润电子	35,200	834,592.00	0.21
68	000815	美利云	40,200	826,110.00	0.21
69	600900	长江电力	63,300	801,378.00	0.20
70	300300	汉鼎宇佑	38,000	796,480.00	0.20
71	300450	先导智能	22,900	778,371.00	0.19
72	601139	深圳燃气	85,000	772,650.00	0.19
73	300318	博晖创新	81,410	737,574.60	0.18
74	002392	北京利尔	126,900	730,944.00	0.18
75	000333	美的集团	23,300	656,361.00	0.16
76	600660	福耀玻璃	34,780	647,951.40	0.16
77	002304	洋河股份	8,700	614,220.00	0.15
78	300222	科大智能	28,000	560,000.00	0.14
79	600642	申能股份	91,600	537,692.00	0.13
80	300341	麦迪电气	48,500	528,650.00	0.13
81	600795	国电电力	166,000	526,220.00	0.13
82	300415	伊之密	26,000	523,380.00	0.13
83	300441	鲍斯股份	20,800	485,680.00	0.12
84	600000	浦发银行	29,700	481,437.00	0.12
85	600741	华域汽车	28,900	460,955.00	0.11
86	600583	海油工程	62,200	459,036.00	0.11
87	600398	海澜之家	40,500	436,995.00	0.11
88	002083	孚日股份	60,100	424,907.00	0.11
89	000561	烽火电子	34,300	418,117.00	0.10
90	600170	上海建工	87,220	412,550.60	0.10
91	300138	晨光生物	21,948	400,112.04	0.10
92	601006	大秦铁路	56,500	400,020.00	0.10
93	002202	金风科技	23,100	395,241.00	0.10
94	001979	招商蛇口	24,100	394,999.00	0.10

95	000937	冀中能源	58,537	394,539.38	0.10
96	000539	粤电力A	73,500	391,020.00	0.10
97	601668	中国建筑	43,700	387,182.00	0.10
98	600104	上汽集团	16,400	384,580.00	0.10
99	600886	国投电力	57,500	383,525.00	0.10
100	000726	鲁 泰 A	29,400	376,614.00	0.09
101	000821	京山轻机	23,000	373,520.00	0.09
102	300377	赢时胜	10,000	373,300.00	0.09
103	000876	新 希 望	46,000	370,300.00	0.09
104	002440	闰土股份	22,000	359,480.00	0.09
105	000625	长安汽车	24,000	358,560.00	0.09
106	000543	皖能电力	46,500	353,865.00	0.09
107	601998	中信银行	54,600	349,986.00	0.09
108	000651	格力电器	14,200	349,604.00	0.09
109	601818	光大银行	88,300	345,253.00	0.09
110	601991	大唐发电	89,700	342,654.00	0.09
111	002242	九阳股份	18,200	328,146.00	0.08
112	601601	中国太保	11,700	324,909.00	0.08
113	002400	省广股份	23,200	319,928.00	0.08
114	300047	天源迪科	16,000	318,400.00	0.08
115	000910	大亚圣象	16,400	313,240.00	0.08
116	000488	晨鸣纸业	30,100	311,836.00	0.08
117	300036	超图软件	17,400	302,760.00	0.08
118	600664	哈药股份	34,500	296,010.00	0.07
119	300230	永利股份	9,633	293,613.84	0.07
120	000021	深科技	31,100	293,273.00	0.07
121	600269	赣粤高速	56,300	283,189.00	0.07
122	600872	中炬高新	20,000	281,600.00	0.07
123	000915	山大华特	6,300	265,419.00	0.07
124	000697	炼石有色	10,900	256,259.00	0.06

125	300438	鹏辉能源	8,000	252,000.00	0.06
126	000981	银亿股份	25,200	249,984.00	0.06
127	000705	浙江震元	18,900	247,023.00	0.06
128	002635	安洁科技	6,300	229,320.00	0.06
129	000727	华东科技	67,600	227,812.00	0.06
130	002511	中顺洁柔	10,000	199,000.00	0.05
131	000829	天音控股	17,200	194,016.00	0.05
132	000887	中鼎股份	7,100	184,174.00	0.05
133	600796	钱江生化	14,200	176,506.00	0.04
134	300098	高新兴	10,900	172,656.00	0.04
135	600027	华电国际	34,000	168,300.00	0.04
136	002492	恒基达鑫	12,700	160,782.00	0.04
137	600859	王府井	9,600	156,288.00	0.04
138	600855	航天长峰	5,300	153,117.00	0.04
139	603823	百合花	3,762	123,167.88	0.03
140	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.03
141	300535	达威股份	1,100	99,319.00	0.02
142	600655	豫园商城	8,400	95,928.00	0.02
143	002798	帝王洁具	1,400	93,800.00	0.02
144	300473	德尔股份	1,200	93,744.00	0.02
145	600875	东方电气	8,600	92,794.00	0.02
146	300179	四方达	11,500	88,550.00	0.02
147	300513	恒泰实达	900	85,824.00	0.02
148	601166	兴业银行	5,200	83,928.00	0.02
149	300518	盛讯达	700	79,422.00	0.02
150	000803	金宇车城	3,700	78,588.00	0.02
151	002832	比音勒芬	1,158	70,290.60	0.02
152	603577	汇金通	2,460	69,642.60	0.02
153	603218	日月股份	1,652	68,805.80	0.02
154	600419	天润乳业	1,200	68,412.00	0.02

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年年度报告

155	603877	太平鸟	3,180	67,734.00	0.02
156	002239	奥特佳	4,300	67,467.00	0.02
157	300583	赛托生物	1,582	63,738.78	0.02
158	300496	中科创达	1,100	57,508.00	0.01
159	603416	信捷电气	1,076	53,886.08	0.01
160	300537	广信材料	1,024	49,960.96	0.01
161	002833	弘亚数控	2,743	48,331.66	0.01
162	600547	山东黄金	1,300	47,463.00	0.01
163	603058	永吉股份	3,869	42,675.07	0.01
164	603111	康尼机电	2,600	38,220.00	0.01
165	603689	皖天然气	4,818	37,917.66	0.01
166	603886	元祖股份	2,023	35,807.10	0.01
167	002491	通鼎互联	2,300	35,742.00	0.01
168	300582	英飞特	1,359	35,157.33	0.01
169	603228	景旺电子	1,455	33,697.80	0.01
170	603239	浙江仙通	924	29,059.80	0.01
171	300100	双林股份	800	27,200.00	0.01
172	000050	深天马 A	1,300	24,466.00	0.01
173	002835	同为股份	1,126	24,220.26	0.01
174	603035	常熟汽饰	2,316	24,179.04	0.01
175	603266	天龙股份	1,562	22,852.06	0.01
176	300587	天铁股份	1,438	20,290.18	0.01
177	603929	亚翔集成	2,193	15,592.23	0.00
178	002840	华统股份	1,814	11,881.70	0.00
179	002838	道恩股份	682	10,420.96	0.00
180	603186	华正新材	1,874	10,063.38	0.00
181	603032	德新交运	1,628	9,458.68	0.00
182	300586	美联新材	1,006	9,355.80	0.00
183	300591	万里马	2,396	7,355.72	0.00
184	300588	熙菱信息	1,380	6,817.20	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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002195	二三四五	15,573,259.94	3.88
2	002235	安妮股份	12,954,063.79	3.22
3	002024	苏宁云商	11,347,381.38	2.82
4	002643	万润股份	11,235,524.50	2.80
5	002048	宁波华翔	9,889,026.15	2.46
6	002094	青岛金王	9,832,928.26	2.45
7	000878	云南铜业	9,774,932.56	2.43
8	000060	中金岭南	9,592,811.12	2.39
9	000807	云铝股份	9,080,353.60	2.26
10	600515	海航基础	9,049,465.23	2.25
11	000158	常山股份	9,040,355.67	2.25
12	300228	富瑞特装	8,459,285.90	2.11
13	002299	圣农发展	8,242,203.00	2.05
14	600066	宇通客车	8,159,650.90	2.03
15	603012	创力集团	8,026,424.70	2.00
16	600666	奥瑞德	7,900,457.47	1.97
17	002151	北斗星通	7,875,868.25	1.96
18	002548	金新农	7,858,886.07	1.96
19	000977	浪潮信息	7,795,322.33	1.94
20	000860	顺鑫农业	7,741,702.00	1.93

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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	002195	二三四五	13,200,437.80	3.29
2	002024	苏宁云商	11,958,533.14	2.98
3	002643	万润股份	11,873,638.70	2.96
4	002235	安妮股份	11,470,535.80	2.86
5	002094	青岛金王	11,335,165.49	2.82
6	002048	宁波华翔	10,200,521.32	2.54
7	300073	当升科技	10,012,888.80	2.49
8	000060	中金岭南	9,857,127.50	2.45
9	000807	云铝股份	9,528,036.97	2.37
10	000158	常山股份	9,174,561.22	2.28
11	000878	云南铜业	9,036,456.48	2.25
12	002548	金新农	8,896,006.94	2.21
13	002299	圣农发展	8,552,345.48	2.13
14	002151	北斗星通	8,230,260.04	2.05
15	000860	顺鑫农业	8,121,433.58	2.02
16	300228	富瑞特装	8,113,411.00	2.02
17	000977	浪潮信息	7,936,289.96	1.98
18	600666	奥瑞德	7,668,191.50	1.91
19	600350	山东高速	7,646,079.64	1.90
20	601928	凤凰传媒	7,511,157.01	1.87

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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,391,685,453.09
卖出股票的收入（成交）总额	2,282,883,641.16

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1703	中证500期货 1703合约	11	13,376,880.00	867,031.58	
IC1706	中证500期货 1706合约	3	3,535,680.00	-31,240.00	
IF1703	沪深300期货 1703合约	4	3,900,960.00	132,672.00	
IH1703	上证50期货 1703合约	10	6,776,400.00	-220,080.00	
公允价值变动总额合计(元)					748,383.58
股指期货投资本期收益(元)					7,328,808.42
股指期货投资本期公允价值变动(元)					748,383.58

### 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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,959,211.71
2	应收证券清算款	5,198,449.95
3	应收股利	—
4	应收利息	227,373.66
5	应收申购款	306,819.94
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	11,691,855.26

### 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



金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600090	同济堂	2,834,816.75	0.71	停牌

注：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

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
2,754	143,965.56	217,047,486.84	54.74%	179,433,664.08	45.26%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	1,498,814.69	0.38%

### 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	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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2016年1月13日)基金份额总额	506,409,681.98
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	297,519,958.08
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	407,448,489.14
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	396,481,150.92

注：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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

#### 11.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自合同生效日起聘请普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内本基金未改聘会计师事务所。本年度应支付给所聘任的会计师事务所审计费用为65,000.00元人民币。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国都证券	2	1,564,778,289.60	33.51%	1,457,279.08	33.51%	
国金证券	1	701,370,324.08	15.02%	653,187.27	15.02%	
国信证券	1	609,608,167.13	13.05%	567,728.77	13.05%	
东北证券	1	345,615,393.49	7.40%	321,872.28	7.40%	
中信证券	1	303,520,683.44	6.50%	282,670.01	6.50%	
华泰证券	1	285,914,961.83	6.12%	266,273.55	6.12%	
广发证券	2	231,093,202.73	4.95%	215,216.17	4.95%	
东方证券	1	217,916,451.10	4.67%	202,945.39	4.67%	
海通证券	1	160,941,026.33	3.45%	149,885.00	3.45%	
中泰证券	1	70,045,414.79	1.50%	65,233.61	1.50%	
西南证券	1	62,763,476.25	1.34%	58,452.35	1.34%	
国泰君安	1	53,117,024.13	1.14%	49,467.98	1.14%	
安信证券	1	21,126,331.01	0.45%	19,675.25	0.45%	

申银万国	1	20,015,590.29	0.43%	18,640.55	0.43%	
兴业证券	1	14,832,591.55	0.32%	13,813.70	0.32%	
东吴证券	1	7,389,669.18	0.16%	6,882.04	0.16%	
中信建投	1		—	—	—	
光大证券	1		—	—	—	
平安证券	1		—	—	—	
东兴证券	1		—	—	—	
申万宏源西部证券	1		—	—	—	
中投证券	1		—	—	—	
广州证券	1		—	—	—	
浙商证券	1		—	—	—	

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

2.本报告期内所有交易单元均为本报告期新增。

### 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	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
国都证券		—	535,000,000.00	8.31%		—
国金证券		—		—		—
国信证券		—	4,538,700,000.00	70.53%		—
东北证券		—		—		—
中信证券		—	445,000,000.00	6.92%		—

华泰证券		—		—		—
广发证券		—	140,000,000.00	2.18%		—
东方证券		—	776,000,000.00	12.06%		—
海通证券		—		—		—
中泰证券		—		—		—
西南证券		—		—		—
国泰君安		—		—		—
安信证券		—		—		—
申银万国		—		—		—
兴业证券		—		—		—
东吴证券		—		—		—
中信建投		—		—		—
光大证券		—		—		—
平安证券		—		—		—
东兴证券		—		—		—
申万宏源西部证券		—		—		—
中投证券		—		—		—
广州证券		—		—		—
浙商证券		—		—		—

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司督察长离任公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-05
2	中欧基金管理有限公司关于中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金提前结束募集时间的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-11
3	中欧数据挖掘多因子灵活配置混	中国证监会指定报刊及网	2016-01-14

	合型证券投资基金基金合同生效公告	站	
4	中欧基金管理有限公司住所变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-20
5	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“宝通科技”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-01-27
6	中欧数据挖掘多因子混合型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-16
7	中欧基金管理有限公司代行督察长公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-19
8	中欧基金管理有限公司关于中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金参与部分代销机构费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-19
9	中欧基金管理有限公司关于旗下部分开放式基金实施特定申购费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-02-25
10	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增同花顺为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-18
11	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行开展的申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-30
12	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金新增盈米财富为代销机构并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-30
13	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“长安汽车”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-03-31
14	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金互相转换范围的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-15

15	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-21
16	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-04-28
17	中欧基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-07
18	中欧基金管理有限公司关于新增金牛理财为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-16
19	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在工商银行开通基金转换和定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-23
20	中欧基金管理有限公司关于新增浦发银行为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-05-25
21	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在陆金所资管开通基金定投业务并参与费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-17
22	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行开展的网上银行、手机银行申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-06-28
23	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	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-01
24	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	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-01

	构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告		
25	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“南极电商”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-13
26	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-14
27	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2季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-19
28	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“东土科技”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-07-27
29	中欧基金管理有限公司关于调整旗下部分基金持有“安妮股份”股票估值方法的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-02
30	中欧基金管理有限公司关于新增诺亚正行为旗下部分基金代销机构同步开通定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-17
31	中欧基金管理有限公司关于新增利得基金为旗下部分基金代销机构并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-17
32	中欧基金管理有限公司关于新增联泰资产为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-23
33	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-24
34	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-24



35	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-25
36	中欧基金管理有限公司关于新增蛋卷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	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-25
37	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（2016年第1号）	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-26
38	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）	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-26
39	中欧基金管理有限公司关于对通过旗下理财交易及客户服务平台申购旗下基金开展费率优惠活动的补充公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-08-26
40	中欧基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新已过期身份证件或身份证明文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-07
41	中欧基金管理有限公司部分部门办公地址变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-14
42	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过工商银行代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-19
43	中欧基金管理有限公司关于子公司办公地址变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-20
44	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-20
45	中欧基金管理有限公司关于新增平安证券为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-23

46	中欧基金管理有限公司关于新增国美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	中国证监会指定报刊及网站	2016-09-29
47	中欧基金管理有限公司关于新增广源达信为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-10-10
48	中欧基金管理有限公司关于新增万得投顾为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-10-25
49	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3季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2016-10-26
50	中欧基金管理有限公司关于新增新浪仓石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	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-14
51	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金在国都证券开通定期定额投资业务并参加定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-21
52	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金分红公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-24
53	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过国美基金代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-25
54	中欧基金管理有限公司关于新增云湾投资为旗下部分基金代销机构同步开通转换和定投业务并参与费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-11-25
55	中欧基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定报刊及网	2016-11-29

	部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	站	
56	中欧基金管理有限公司关于调整旗下通过蛋卷基金代销基金定投最低申购金额的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-12-15
57	中欧基金管理有限公司关于旗下部分基金参与交通银行手机银行申购和定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-12-22
58	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定期定额投资申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定报刊及网站	2016-12-29

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700