

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券  
投资基金  
2024 年年度报告

2024 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：2025 年 03 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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 2025 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
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	10
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>18</b>
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>52</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	53
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 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	70
8.12 投资组合报告附注 .....	70
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>71</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
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 .....	71
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 .....	72
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>72</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>72</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
11.4 基金投资策略的改变 .....	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	73
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 .....	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
11.8 其他重大事件 .....	77
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>78</b>
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 .....	78
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	79
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>79</b>
13.1 备查文件目录 .....	79
13.2 存放地点 .....	79
13.3 查阅方式 .....	79

## § 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	218,779,679.50 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	148,884,540.64 份	69,895,138.86 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
	联系电话	021-68609600
	电子邮箱	liyihai@zofund.com
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 479 号 8 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 479 号上海中心大厦 8、	北京市西城区复兴门内大街 55 号

	10、16 层	
邮政编码	200120	100140
法定代表人	窦玉明	廖林

## 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	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
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 479 号上海中心大厦 8、10、16 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	2024 年		2023 年		2022 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	33,463,024.05	-2,041,968.48	-20,524,495.12	-25,497,277.04	-383,946,968.07	-157,566,534.44
本期利润	20,449,201.90	8,842,706.82	-8,196,224.90	-22,502,115.88	-455,975,529.16	-184,380,673.21
加权平均基金份额本期利润	0.1271	0.0666	-0.0444	-0.1241	-0.7933	-0.9323
本期加权平均净值利润率	8.68%	4.92%	-2.82%	-8.32%	-46.76%	-57.00%
本期基金份额净值增长率	12.09%	11.16%	-3.85%	-4.61%	-23.76%	-24.37%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	76,302,249.60	28,780,914.33	41,553,576.21	25,635,901.52	71,806,129.36	36,192,384.81
期末可供分配基金份额利润	0.5125	0.4118	0.2283	0.1570	0.3410	0.2758

期末基金资产净值	247,870,177.99	109,179,354.94	270,360,526.82	229,410,795.25	325,216,947.13	193,289,473.96
期末基金份额净值	1.6648	1.5620	1.4852	1.4052	1.5446	1.4731
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金份额累计净值增长率	112.48%	86.27%	89.55%	67.57%	97.13%	75.67%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、上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	6.11%	1.90%	-0.12%	1.93%	6.23%	-0.03%
过去六个月	18.21%	1.83%	15.27%	1.91%	2.94%	-0.08%
过去一年	12.09%	1.64%	5.64%	1.73%	6.45%	-0.09%
过去三年	-17.83%	1.30%	-20.65%	1.33%	2.82%	-0.03%
过去五年	58.45%	1.34%	9.37%	1.31%	49.08%	0.03%
自基金合同生效起至今	112.48%	1.26%	20.65%	1.12%	91.83%	0.14%

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

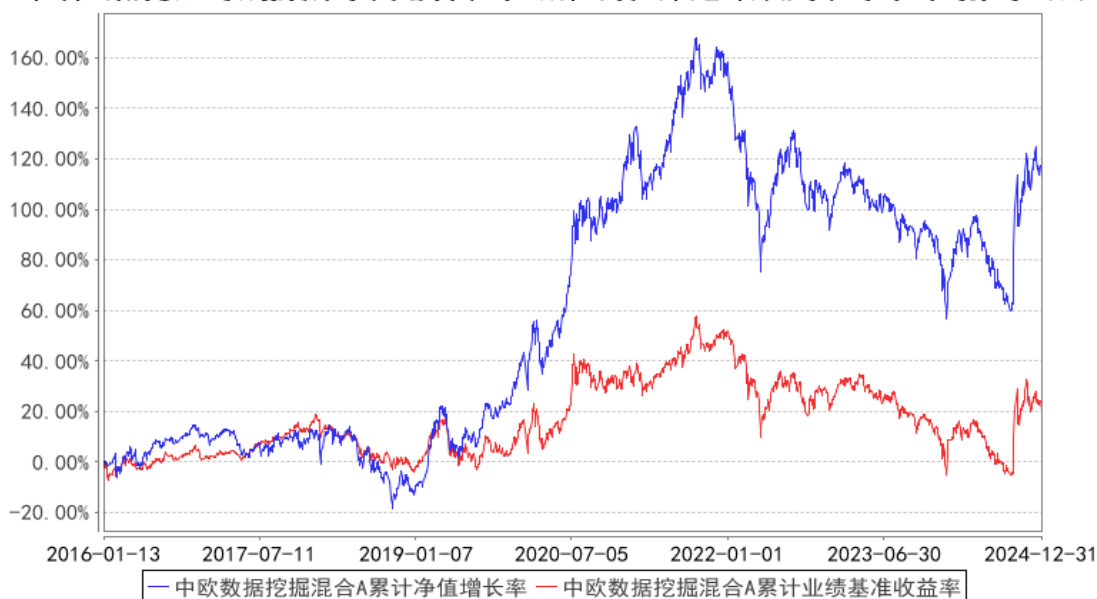
阶段	份额净值	份额净值增	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	------	-------	------	-------	-----	-----

	增长率①	长率标准差 ②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去三个月	5.85%	1.90%	-0.12%	1.93%	5.97%	-0.03%
过去六个月	17.68%	1.83%	15.27%	1.91%	2.41%	-0.08%
过去一年	11.16%	1.64%	5.64%	1.73%	5.52%	-0.09%
过去三年	-19.81%	1.30%	-20.65%	1.33%	0.84%	-0.03%
过去五年	52.20%	1.34%	9.37%	1.31%	42.83%	0.03%
自基金份额起始 运作日至今	86.27%	1.30%	18.74%	1.16%	67.53%	0.14%

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

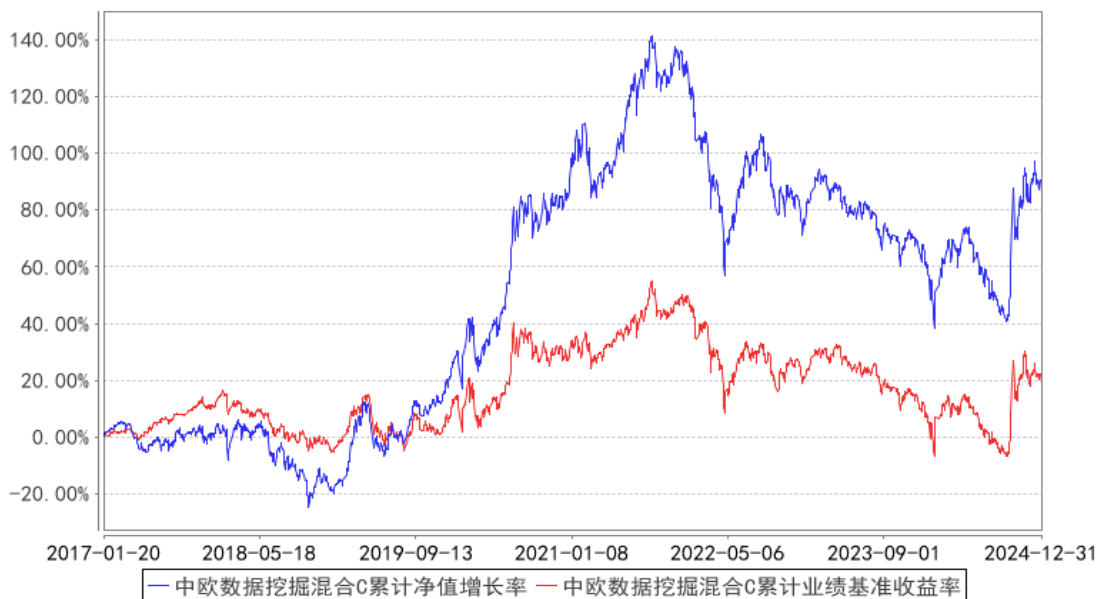
中欧数据挖掘混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：“2019 年 4 月 26 日组合业绩比较基准变更为中证 500 指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。”



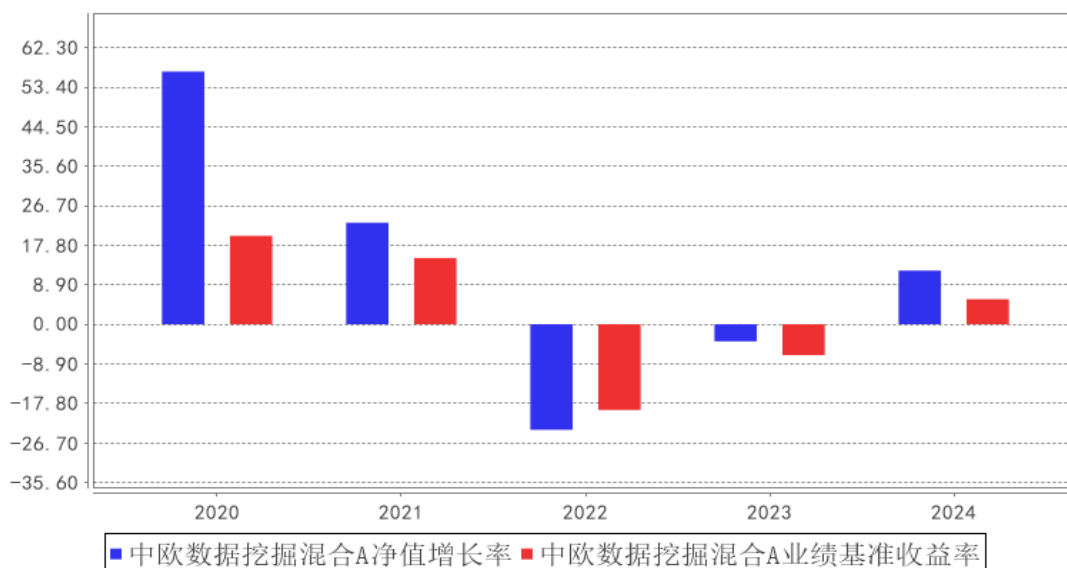
中欧数据挖掘混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



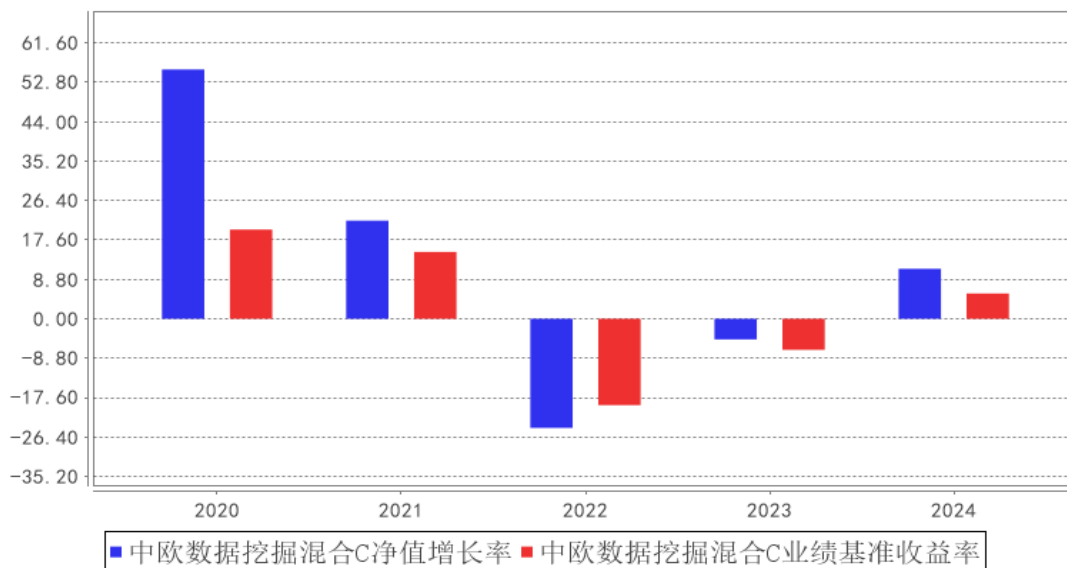
注：2019年4月26日组合业绩比较基准变更为中证500指数收益率\*95%+中债综合指数收益率\*5%。  
自2017年1月19日起本基金增加C类份额，图示日期为2017年1月20日至2024年12月31日。

### 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

中欧数据挖掘混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



中欧数据挖掘混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金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 WP Asia Pacific Asset Management LLC（华平亚太资产管理有限公司）、国都证券股份有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业（有限合伙）、上海穆延投资管理合伙企业（有限合伙）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、深圳分公司、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、中欧基金国际有限公司和中欧私募基金管理（上海）有限公司。截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 194 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		
赵子衡	基金经理助理	2024-04-23	-	3 年	2021-07-16 加入中欧基金管理有限公司，历任研究助理、研究员。
曲径	权益投决会委员 / 权益专户	2016-01-13	-	17 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。2015-04-01 加入中欧基金管理有限公司。

	投决会委员 / 量化投资总监 / 基金经理 / 投资经理				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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》等相关规定。

#### 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	8	2,528,820,550.43	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,762,360,765.87	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	4,291,181,316.30	-

注：1、“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

2、本报告期内兼任私募资产管理计划投资人员有产品离任情况，曲径离任产品情况：

①产品类型：公募，离任数量：1只，离任时间：2024-05-31；

②产品类型：私募资产管理计划，离任数量：0只，离任时间：无。

#### 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，研究成果与全体投资人员共享，投研体系职权划明确且互不干预，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，相同投资策略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，严格管理同向交易和反向交易，公平执行投资指令；在事后监控环节，本基金管理人设置每日异常交易分析机制，发现异常事项对基金经理进行提示，留存解释说明，并每季度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，并结合同向交易占优比、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 31 次，其中 30 次为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，1 次为不同经理管理的组合因投资策略不同发生的反向交易，公司内部风控对上述交易均履行相应控制程序。

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

2024 年市场走势呈现显著的“回升”特征。前三季度，由于宏观经济弱复苏、微观主体预期偏谨慎等多重因素影响，市场情绪持续承压。具体而言，社会消费品零售总额增速放缓，反映出消费端复苏动能不足；制造业 PMI 长期徘徊于荣枯线下方，企业资本开支意愿明显收缩。在此背景下，具备稳定现金流和较高股息率的红利资产备受资金青睐。9 月中旬成为市场的重要转折点，内外部因素共振驱动市场情绪迎来修复。外部因素方面，全球流动性拐点得以确认，美联储超预期降息 50 个基点，正式开启宽松周期。人民币汇率的贬值压力有效缓解，吸引部分结汇资金回流境内，市场流动性显著改善。汇率压力缓解为国内政策调控打开了空间，政策重心转向“加强逆周期调节”。9 月 24 日，国务院新闻办发布会上，央行宣布了一系列超预期的宽松政策组合拳，包括降低存款准备金率，以及下调存量房贷利率，统一房贷最低首付比例等措施，旨在降低实体经济融资成本，稳定房地产市场。此外，央行还创设了新的货币政策工具，以支持股票市场稳定发展。12 月召开的中央政治局会议为 2025 年经济工作定下了积极基调，强调“实施更加积极有为的宏观政策，加强超常规逆周期调节”，并明确提出实施“更加积极”的财政政策和“适度宽松”的货币政策。随后的中央经济工作会议进一步明确了“超常规逆周期调节”的思路，提出提高财政赤字率、适时降准降息等举措，这些政策信号为经济复苏注入强心剂。在报告期内，本基金以中证 500 指数的行业配置为锚定，保持了均衡的风格和行业配置，对于基准的跟踪误差控制在合理范围内，整体表现为中盘平衡风格。操作上，高配部分模型预测的景气行业，在行业内采用基本面因子结合量价因子的多维度综合打分，对个股进行配置，构成基金投资组合，力争获取超越基准的回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 12.09%，同期业绩比较基准收益率为 5.64%；基金 C 类份额净值增长率为 11.16%，同期业绩比较基准收益率为 5.64%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，我国经济运行主要受内生因素主导，需要重点跟踪宏观政策的传导效率及其对各行业基本面的持续性改善程度。从政策组合来看，货币环境为估值扩张提供了良好基础，但市场能否持续向好的关键在于财政政策的有效接力。只有财政端发力，才能更好地提振企业的盈利能力，夯实市场上行基础。12 月政治局会议和中央经济工作会议对明年政策定调积极，强调实施“更加积极”的财政政策和“适度宽松”的货币政策，有效提振了经济增长预期与市场风险偏好。从市场节奏研判，A 股能否开启持续性反弹行情，核心要素在于关注后续财政政策的落地节奏和实

施力度。我们会持续跟踪市场风格因子特征，争取控制组合风险因子暴露，力争让量化组合的超额收益更为平稳。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 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

2024 年，监管机构颁布了多部法律法规，公司在收到相关法规后以公众号“新规速递”的方式及时向部门和员工进行推送。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，对于重要法规或通知，公司从制度建立、流程改造、系统更新等方面安排专项落地与跟进，并配套相应检查。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、监管案例速递、员工合规测试、合规宣传月等多种形式，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

2024 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：公司全年制定或修订多项制度流程，内容涵盖投资研究交易、基金运作、合规管理、信息技术等各项内容。

##### （三）加强内部审计，强化风险管理

2024 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。

##### （四）提升反洗钱管理水平，推进反洗钱系统建设

2024 年，公司严格参照法律法规的要求落实公司反洗钱管理，优化洗钱风险和制裁风险管控的治理架构和管理体系，从制度流程、风险评估、培训宣传等层面，进一步提升和完善反洗钱管理工作。公司在今年牵头各部门加强自身反洗钱工作履职能力，并积极推进反洗钱新一代系统建设，结合最新的监管要求及业务发展需要，优化了反洗钱系统的各功能模块，从客户洗钱风险评估、客户尽职调查、可疑交易监测及分析等方面实现反洗钱工作系统化建设。

#### 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、战略规划及业务发展部负责人、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

本基金本报告期末未进行利润分配，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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他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，本基金的管理人——中欧基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 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本基金 2024 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（2025）审字第 70028871_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 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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	不适用
其他事项	不适用
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。





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
审计报告日期	2025 年 3 月 27 日

## § 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	49,579,707.33	60,445,722.84
结算备付金		6,605,389.90	3,974,178.49
存出保证金		3,173,809.93	1,759,416.11
交易性金融资产	7.4.7.2	303,804,236.53	448,012,484.24
其中：股票投资		302,079,653.60	448,012,484.24
基金投资		-	-
债券投资		1,724,582.93	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		342,640.50	80,056.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		363,505,784.19	514,271,858.12
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	-

应付清算款		4,573,499.06	12,140,134.05
应付赎回款		119,771.26	675,524.59
应付管理人报酬		366,822.15	505,847.92
应付托管费		61,137.03	84,307.98
应付销售服务费		75,566.77	156,176.16
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,259,454.99	938,545.35
负债合计		6,456,251.26	14,500,536.05
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	218,779,679.50	345,291,217.76
未分配利润	7.4.7.8	138,269,853.43	154,480,104.31
净资产合计		357,049,532.93	499,771,322.07
负债和净资产总计		363,505,784.19	514,271,858.12

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 218,779,679.50 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.6648 元，基金份额总额 148,884,540.64 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.5620 元，基金份额总额 69,895,138.86 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		36,783,146.64	-19,415,950.90
1. 利息收入		207,998.58	687,151.08
其中：存款利息收入	7.4.7.9	207,742.46	304,307.80
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		256.12	382,843.28
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		38,572,026.25	-35,662,938.11
其中：股票投资收益	7.4.7.10	29,312,928.31	-39,088,961.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	8,581.97	75,758.08
资产支持证券投资		-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-246,020.88	-2,469,745.52
股利收益	7.4.7.14	9,496,536.85	5,820,010.90
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-2,129,146.85	15,323,431.38
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	132,268.66	236,404.75
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,491,237.92</b>	<b>11,282,389.88</b>
1. 管理人报酬		5,011,575.64	7,654,237.70
2. 托管费		835,262.53	1,275,706.34
3. 销售服务费		1,454,255.19	2,154,134.27
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	6,474.03
其中：卖出回购金融资产支出		-	6,474.03
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		364.51	2,160.54
8. 其他费用	7.4.7.18	189,780.05	189,677.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>29,291,908.72</b>	<b>-30,698,340.78</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>29,291,908.72</b>	<b>-30,698,340.78</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>29,291,908.72</b>	<b>-30,698,340.78</b>

### 7.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	345,291,217.76	-	154,480,104.31	499,771,322.07

二、本期期初净资产	345,291,217.76	-	154,480,104.31	499,771,322.07
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-126,511,538.26	-	-16,210,250.88	-142,721,789.14
(一)、综合收益总额	-	-	29,291,908.72	29,291,908.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-126,511,538.26	-	-45,502,159.60	-172,013,697.86
其中：1. 基金申购款	125,919,098.42	-	68,287,000.77	194,206,099.19
2. 基金赎回款	-252,430,636.68	-	-113,789,160.37	-366,219,797.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	218,779,679.50	-	138,269,853.43	357,049,532.93
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	341,756,881.67	-	176,749,539.42	518,506,421.09
二、本期期初净资产	341,756,881.67	-	176,749,539.42	518,506,421.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,534,336.09	-	-22,269,435.11	-18,735,099.02
(一)、综合收益总额	-	-	-30,698,340.78	-30,698,340.78
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	3,534,336.09	-	8,428,905.67	11,963,241.76
其中：1. 基金申购款	240,635,672.43	-	141,974,047.60	382,609,720.03

2. 基金赎回款	-237,101,336.34	-	-133,545,141.93	-370,646,478.27
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	345,291,217.76	-	154,480,104.31	499,771,322.07

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：

<u>刘建平</u>	<u>王音然</u>	<u>李宝林</u>
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)。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(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 $\times$ 95%+中债综合指数收益率 $\times$ 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 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

##### 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根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的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、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，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；划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的



无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的相关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

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；

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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 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。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债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) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益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；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的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。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

## 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%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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。

### 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征增值税试点的通知》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，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金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，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金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法》、《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[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[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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	49,579,707.33	60,445,722.84
等于：本金	49,574,735.59	60,440,345.08
加：应计利息	4,971.74	5,377.76
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	49,579,707.33	60,445,722.84

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	311,163,047.53	-	302,079,653.60	-9,083,393.93	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	1,717,000.00	10,132.93	1,724,582.93	-2,550.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,717,000.00	10,132.93	1,724,582.93	-2,550.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	

合计	312,880,047.53	10,132.93	303,804,236.53	-9,085,943.93
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	455,653,761.32	-	448,012,484.24	-7,641,277.08
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	455,653,761.32	-	448,012,484.24	-7,641,277.08

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	25,832,720.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	25,832,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,832,720.00	-	-	-
项目	上年度末 2023 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	13,330,680.00	-	-	-

其中：股指期货投资	13,330,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,330,680.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2501	IC2501	3.00	3,431,760.00	-100,640.00
IC2503	IC2503	17.00	19,296,360.00	-534,120.00
IM2503	IM2503	2.00	2,352,560.00	-117,280.00
合计				-752,040.00
减：可抵销期货暂收款				-752,040.00
净额				0.00

注：1、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。

2、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示

#### 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

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

无。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	141.89	103.25
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,209,313.10	888,442.10
其中：交易所市场	1,209,313.10	888,442.10
银行间市场	-	-
应付利息	-	-



预提费用-审计费	50,000.00	50,000.00
合计	1,259,454.99	938,545.35

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

##### 中欧数据挖掘混合 A

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	182,038,349.26	182,038,349.26
本期申购	72,597,511.30	72,597,511.30
本期赎回（以“-”号填列）	-105,751,319.92	-105,751,319.92
本期末	148,884,540.64	148,884,540.64

##### 中欧数据挖掘混合 C

项目	本期	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,252,868.50	163,252,868.50
本期申购	53,321,587.12	53,321,587.12
本期赎回（以“-”号填列）	-146,679,316.76	-146,679,316.76
本期末	69,895,138.86	69,895,138.86

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。

#### 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

##### 中欧数据挖掘混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	41,553,576.21	46,768,601.35	88,322,177.56
本期期初	41,553,576.21	46,768,601.35	88,322,177.56
本期利润	33,463,024.05	-13,013,822.15	20,449,201.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,285,649.34	-11,071,391.45	-9,785,742.11
其中：基金申购款	22,041,564.01	19,290,803.37	41,332,367.38
基金赎回款	-20,755,914.67	-30,362,194.82	-51,118,109.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,302,249.60	22,683,387.75	98,985,637.35

##### 中欧数据挖掘混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	25,635,901.52	40,522,025.23	66,157,926.75
本期期初	25,635,901.52	40,522,025.23	66,157,926.75
本期利润	-2,041,968.48	10,884,675.30	8,842,706.82
本期基金份额交易产生的变动数	5,186,981.29	-40,903,398.78	-35,716,417.49
其中：基金申购款	13,871,669.73	13,082,963.66	26,954,633.39

基金赎回款	-8,684,688.44	-53,986,362.44	-62,671,050.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,780,914.33	10,503,301.75	39,284,216.08

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	124,326.23	165,435.05
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	80,997.27	135,325.80
其他	2,418.96	3,546.95
合计	207,742.46	304,307.80

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	5,207,658,505.52	3,970,583,763.27
减：卖出股票成本总额	5,170,059,178.92	4,000,489,462.61
减：交易费用	8,286,398.29	9,183,262.23
买卖股票差价收入	29,312,928.31	-39,088,961.57

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	8,581.97	17,178.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	58,580.00
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	8,581.97	75,758.08

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	40,827,193.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	39,942,720.00
减：应计利息总额	-	825,693.15
减：交易费用	-	200.00
买卖债券差价收入	-	58,580.00

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

##### 7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
股指期货投资收益	-246,020.88	-2,469,745.52

#### 7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
股票投资产生的股利收益	9,496,536.85	5,820,010.90
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	9,496,536.85	5,820,010.90

#### 7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,444,666.85	15,390,991.38
股票投资	-1,442,116.85	15,448,271.38
债券投资	-2,550.00	-57,280.00
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-684,480.00	-67,560.00
权证投资	-	-
期货投资	-684,480.00	-67,560.00
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	-2,129,146.85	15,323,431.38

#### 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
基金赎回费收入	132,136.57	221,960.57
基金转换费收入	132.09	14,444.18
合计	132,268.66	236,404.75

#### 7.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	50,000.00	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	1,310.00	1,677.00
账户维护费	18,000.00	18,000.00
开户费	400.00	-

存托服务费	70.05	-
合计	189,780.05	189,677.00

#### 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

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作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（“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
WP Asia Pacific Asset Management LLC（“华平亚太资管”）	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
上海穆延投资管理合伙企业(有限合伙)（“上海穆延合伙”）	基金管理人的股东
自然人股东	基金管理人的股东
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、基金销售机构
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
中欧基金国际有限公司（“中欧基金国际”）	基金管理人的全资子公司
中欧私募基金管理(上海)有限公司（“中欧私募”）	基金管理人的全资子公司

注：1、自 2024 年 4 月 9 日起，我司正式受让中欧私募基金管理(上海)有限公司全部股权，新增关联方为中欧私募基金管理(上海)有限公司。

2、以下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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	364,478,480.53	3.56	477,939,291.88	6.04
------	----------------	------	----------------	------

#### 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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
国都证券	-	-	254,100,000.00	6.60

#### 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 2024年1月1日至2024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	198,977.37	3.96	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	285,407.47	5.41	188,730.81	21.24

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

#### 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 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,011,575.64	7,654,237.70
其中：应支付销售机构的客户维护	890,042.39	1,480,932.16

费		
应支付基金管理人的净管理费	4, 121, 533. 25	6, 173, 305. 54

注：1、基金管理费按前一日基金资产净值的 1.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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、根据本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》的公告，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金管理费由 1.5%/年调低至 1.2%/年。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	835, 262. 53	1, 275, 706. 34

注：1、基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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。

2、根据本基金管理人于 2023 年 7 月 8 日发布的《中欧基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》的公告，经与基金托管人协商一致并报中国证监会备案，自 2023 年 7 月 10 日起，本基金托管费率由 0.25%/年调低至 0.2%/年。

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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
工商银行	0.00	156.60	156.60
中欧财富	0.00	37,540.97	37,540.97
中欧基金	0.00	961,716.23	961,716.23
合计	0.00	999,413.80	999,413.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
工商银行	0.00	2.78	2.78
中欧财富	0.00	49,089.01	49,089.01
中欧基金	0.00	1,443,126.57	1,443,126.57
合计	0.00	1,492,218.36	1,492,218.36

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

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

无。

#### 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

本报告期及上年度可比期间，基金管理人均未运用自有资金投资本基金各类基金份额。

##### 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 2024年12月31日		上年度末 2023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	1,450,628.30	0.97%	1,450,628.30	0.80%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金各类基金份额的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

2、本报告期期末及上年度可比期期末，除基金管理人之外的其他关联方均未持有本基金 C 类基金份额。

##### 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 2024年1月1日至2024年12月 31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	49,579,707.33	124,326.23	60,445,722.84	165,435.05

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

无。

##### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

##### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

##### 7.4.12 期末（2024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	受限期	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
001279	强邦新材	2024年9月27日	6个月	新股流通受限	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
001391	国货航	2024年12月23日	6个月	新股流通受限	2.30	6.80	2,587	5,950.10	17,591.60	-
301522	上大股份	2024年10月9日	6个月	新股流通受限	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
301551	无线传媒	2024年9月19日	6个月	新股流通受限	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
301552	科力装备	2024年7月15日	6个月	新股流通受限	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云农	2024年10月10日	6个月	新股流通受限	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天成	2024年8月14日	6个月	新股流通受限	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301585	蓝宇股份	2024年12月10日	6个月	新股流通受限	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
301586	佳力奇	2024年8月21日	6个月	新股流通受限	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
301603	乔锋智能	2024年7月3日	6个月	新股流通受限	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿	2024	6个月	新股	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-

	联科技	年7月17日		流通受限						
301607	富特科技	2024年8月28日	6个月	新股流通受限	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
301608	博实结	2024年7月25日	6个月	新股流通受限	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科技	2024年8月7日	6个月	新股流通受限	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
301613	新铝时代	2024年10月18日	6个月	新股流通受限	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301617	博苑股份	2024年12月3日	6个月	新股流通受限	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301622	英思特	2024年11月26日	6个月	新股流通受限	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301626	苏州天脉	2024年10月17日	6个月	新股流通受限	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
301631	壹连科技	2024年11月12日	6个月	新股流通受限	72.99	101.96	105	7,663.95	10,705.80	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	1个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
603072	天和磁材	2024年12月24日	6个月	新股流通受限	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-
603091	众鑫	2024年9月	6个月	新股流通	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-

	股份	10 日		受限						
603194	中力股份	2024 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	20.32	28.13	262	5,323.84	7,370.06	-
603207	小方制药	2024 年 8 月 19 日	6 个月	新股流通受限	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通受限	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024 年 8 月 7 日	6 个月	新股流通受限	17.39	17.95	234	4,069.26	4,200.30	-
603391	力聚热能	2024 年 7 月 24 日	6 个月	新股流通受限	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603395	红四方	2024 年 11 月 19 日	6 个月	新股流通受限	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
688449	联芸科技	2024 年 11 月 20 日	6 个月	新股流通受限	11.25	29.44	1,089	12,251.25	32,060.16	-
688605	先锋精科	2024 年 12 月 4 日	6 个月	新股流通受限	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688615	合合信息	2024 年 9 月 19 日	6 个月	新股流通受限	55.18	165.78	256	14,126.08	42,439.68	-
688708	佳驰科技	2024 年 11 月 27 日	6 个月	新股流通受限	27.08	48.95	468	12,673.44	22,908.60	-
688710	益诺	2024 年 8 月	6 个月	新股流通	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-

	思	27 日		受限						
688721	龙图光罩	2024 年 7 月 30 日	6 个月	新股流通受限	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024 年 10 月 22 日	6 个月	新股流通受限	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-
688750	金天钛业	2024 年 11 月 12 日	6 个月	新股流通受限	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔生物	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	35.20	2025 年 1 月 7 日	30.60	14,500	499,288.79	510,400.00	-

#### 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 2024 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 2024 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。本基金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，督察长、监察稽核部、风险管理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进行审议和决策。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，负责监察公司的风险管理措施的执行，对内部控制制度的执行情况进行全面及专项检查 and 反馈。风险管理部负责公司层面金融工具投资的风险评估、风险监测以及风险管理措施的执行。相关业务部门负责本部门的风险评估和监控。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票不得超过该上市公司可流通股票的 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 2024 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约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(净资产)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 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	49,579,707.33	-	-	-	49,579,707.33
结算备付金	6,605,389.90	-	-	-	6,605,389.90
存出保证金	164,128.33	-	-	3,009,681.60	3,173,809.93
交易性金融资产	1,724,582.93	-	-	302,079,653.60	303,804,236.53
应收申购款	-	-	-	342,640.50	342,640.50
资产总计	58,073,808.49	-	-	305,431,975.70	363,505,784.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	119,771.26	119,771.26
应付管理人报酬	-	-	-	366,822.15	366,822.15
应付托管费	-	-	-	61,137.03	61,137.03
应付清算款	-	-	-	4,573,499.06	4,573,499.06
应付销售服务费	-	-	-	75,566.77	75,566.77
其他负债	-	-	-	1,259,454.99	1,259,454.99
负债总计	-	-	-	6,456,251.26	6,456,251.26
利率敏感度缺口	58,073,808.49	-	-	-298,975,724.44	357,049,532.93
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	60,445,722.84	-	-	-	60,445,722.84
结算备付金	3,974,178.49	-	-	-	3,974,178.49
存出保证金	167,841.71	-	-	1,591,574.40	1,759,416.11
交易性金融资产	-	-	-	448,012,484.24	448,012,484.24
应收申购款	-	-	-	80,056.44	80,056.44
资产总计	64,587,743.04	-	-	449,684,115.08	514,271,858.12
负债					
应付赎回款	-	-	-	675,524.59	675,524.59
应付管理人报酬	-	-	-	505,847.92	505,847.92
应付托管费	-	-	-	84,307.98	84,307.98
应付清算款	-	-	-	12,140,134.05	12,140,134.05
应付销售服务费	-	-	-	156,176.16	156,176.16
其他负债	-	-	-	938,545.35	938,545.35
负债总计	-	-	-	14,500,536.05	14,500,536.05
利率敏感度缺口	64,587,743.04	-	-	-435,183,579.03	499,771,322.07

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 2024 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 0.48%（2023



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（2023 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

#### 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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	302,079,653.60	84.60	448,012,484.24	89.64
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	302,079,653.60	84.60	448,012,484.24	89.64

##### 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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月

			31 日 )
	业绩比较基准上升 5%	17,336,943.77	23,274,082.39
	业绩比较基准下降 5%	-17,336,943.77	-23,274,082.39

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	300,955,303.73	446,611,027.22
第二层次	2,262,719.43	338,352.00
第三层次	586,213.37	1,063,105.02
合计	303,804,236.53	448,012,484.24

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	1,063,105.02	1,063,105.02
当期购买	0.00	233,562.08	233,562.08
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	1,063,105.02	1,063,105.02
当期利得或损失总额	0.00	352,651.29	352,651.29
其中：计入损益的利得或损失	0.00	352,651.29	352,651.29
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	586,213.37	586,213.37
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	352,651.29	352,651.29
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	4,040,589.15	4,040,589.15
当期购买	0.00	897,280.80	897,280.80
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	4,040,589.15	4,040,589.15
当期利得或损失总额	0.00	165,824.22	165,824.22
其中：计入损益的利得或损失	0.00	165,824.22	165,824.22
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	1,063,105.02	1,063,105.02
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	165,824.22	165,824.22

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	586,213.37	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.2665-5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,063,105.02	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1855-2.1988	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

##### 7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 27 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	302,079,653.60	83.10
	其中：股票	302,079,653.60	83.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,724,582.93	0.47
	其中：债券	1,724,582.93	0.47

	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	56,185,097.23	15.46
8	其他各项资产	3,516,450.43	0.97
9	合计	363,505,784.19	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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	3,236,932.00	0.91
B	采矿业	12,317,666.00	3.45
C	制造业	188,541,009.15	52.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,143,924.00	4.24
E	建筑业	9,159,704.00	2.57
F	批发和零售业	8,210,188.19	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	9,393,064.50	2.63
H	住宿和餐饮业	1,410,945.00	0.40
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,423,391.94	5.44
J	金融业	22,675,537.13	6.35
K	房地产业	3,982,785.00	1.12
L	租赁和商务服务业	2,459,833.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	2,401,104.69	0.67
N	水利、环境和公共设施管理业	2,641,436.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	559,555.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	522,578.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	302,079,653.60	84.60

### 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投资股票。

## 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	000157	中联重科	298,100	2,155,263.00	0.60
2	688208	道通科技	48,300	1,891,428.00	0.53
3	002335	科华数据	54,700	1,581,924.00	0.44
4	300699	光威复材	44,800	1,552,320.00	0.43
5	600153	建发股份	145,000	1,525,400.00	0.43
6	000988	华工科技	35,100	1,519,830.00	0.43
7	001965	招商公路	108,300	1,510,785.00	0.42
8	603529	爱玛科技	36,700	1,505,434.00	0.42
9	601872	招商轮船	232,900	1,492,889.00	0.42
10	601121	宝地矿业	212,500	1,487,500.00	0.42
11	688615	合合信息	7,377	1,484,014.92	0.42
12	002938	鹏鼎控股	40,600	1,481,088.00	0.41
13	603296	华勤技术	20,700	1,468,665.00	0.41
14	002624	完美世界	141,700	1,463,761.00	0.41
15	000977	浪潮信息	28,200	1,463,016.00	0.41
16	002371	北方华创	3,700	1,446,700.00	0.41
17	300087	荃银高科	122,000	1,439,600.00	0.40
18	688631	莱斯信息	16,400	1,428,276.00	0.40
19	301165	锐捷网络	19,700	1,422,340.00	0.40
20	688150	莱特光电	62,108	1,398,672.16	0.39
21	000600	建投能源	245,800	1,391,228.00	0.39
22	300681	英搏尔	55,700	1,385,259.00	0.39
23	000915	华特达因	49,000	1,380,820.00	0.39
24	000893	亚钾国际	67,900	1,368,864.00	0.38
25	002927	泰永长征	91,600	1,354,764.00	0.38
26	000528	柳工	111,100	1,339,866.00	0.38
27	689009	九号公司	27,805	1,320,737.50	0.37
28	600602	云赛智联	83,400	1,319,388.00	0.37
29	600449	宁夏建材	87,800	1,318,756.00	0.37
30	605117	德业股份	15,400	1,305,920.00	0.37
31	603379	三美股份	33,700	1,293,406.00	0.36
32	603214	爱婴室	56,900	1,283,664.00	0.36
33	002497	雅化集团	109,200	1,277,640.00	0.36
34	000661	长春高新	12,800	1,272,832.00	0.36
35	600378	昊华科技	43,700	1,263,367.00	0.35
36	002245	蔚蓝锂芯	117,900	1,260,351.00	0.35
37	000561	烽火电子	142,300	1,257,932.00	0.35
38	002851	麦格米特	20,400	1,253,784.00	0.35
39	300693	盛弘股份	46,200	1,245,552.00	0.35
40	600694	大商股份	47,100	1,242,027.00	0.35
41	300792	壹网壹创	51,600	1,238,400.00	0.35
42	002706	良信股份	160,400	1,231,872.00	0.35

43	301110	青木科技	19,800	1,218,492.00	0.34
44	688426	康为世纪	37,100	1,061,431.00	0.30
45	605108	同庆楼	35,600	872,556.00	0.24
46	603558	健盛集团	78,500	844,660.00	0.24
47	601857	中国石油	93,100	832,314.00	0.23
48	601288	农业银行	141,100	753,474.00	0.21
49	600894	广日股份	50,400	735,840.00	0.21
50	600008	首创环保	223,600	733,408.00	0.21
51	600028	中国石化	107,700	719,436.00	0.20
52	000048	京基智农	39,600	712,800.00	0.20
53	600901	江苏金租	132,233	690,256.26	0.19
54	002867	周大生	47,500	690,175.00	0.19
55	605507	国邦医药	33,100	689,473.00	0.19
56	000090	天健集团	167,000	686,370.00	0.19
57	600900	长江电力	23,100	682,605.00	0.19
58	002595	豪迈科技	13,600	682,584.00	0.19
59	601818	光大银行	173,800	672,606.00	0.19
60	002440	闰土股份	99,600	668,316.00	0.19
61	601598	中国外运	124,800	667,680.00	0.19
62	601916	浙商银行	228,300	664,353.00	0.19
63	600284	浦东建设	105,800	663,366.00	0.19
64	600269	赣粤高速	118,200	663,102.00	0.19
65	600282	南钢股份	140,900	660,821.00	0.19
66	603676	卫信康	66,400	660,680.00	0.19
67	600248	陕建股份	146,800	657,664.00	0.18
68	002061	浙江交科	161,100	657,288.00	0.18
69	600998	九州通	128,200	656,384.00	0.18
70	600023	浙能电力	114,800	649,768.00	0.18
71	601618	中国中冶	196,300	647,790.00	0.18
72	002233	塔牌集团	84,200	645,814.00	0.18
73	601369	陕鼓动力	74,100	644,670.00	0.18
74	601298	青岛港	70,700	644,077.00	0.18
75	002191	劲嘉股份	152,500	640,500.00	0.18
76	002372	伟星新材	50,700	640,341.00	0.18
77	601988	中国银行	116,100	639,711.00	0.18
78	000708	中信特钢	55,800	636,678.00	0.18
79	000672	上峰水泥	82,800	633,420.00	0.18
80	600582	天地科技	102,200	631,596.00	0.18
81	000582	北部湾港	79,800	628,824.00	0.18
82	603599	广信股份	52,000	626,600.00	0.18
83	688428	诺诚健华	51,000	626,280.00	0.18
84	002546	新联电子	144,500	625,685.00	0.18
85	688663	新风光	28,800	625,248.00	0.18

86	600019	宝钢股份	89,000	623,000.00	0.17
87	300119	瑞普生物	33,900	622,743.00	0.17
88	600098	广州发展	97,000	622,740.00	0.17
89	601229	上海银行	67,900	621,285.00	0.17
90	600064	南京高科	79,800	620,046.00	0.17
91	600096	云天化	27,800	619,940.00	0.17
92	603111	康尼机电	102,800	619,884.00	0.17
93	600820	隧道股份	85,900	617,621.00	0.17
94	600219	南山铝业	157,500	615,825.00	0.17
95	601169	北京银行	100,100	615,615.00	0.17
96	600968	海油发展	143,700	613,599.00	0.17
97	002100	天康生物	93,100	609,805.00	0.17
98	600519	贵州茅台	400	609,600.00	0.17
99	601225	陕西煤业	26,200	609,412.00	0.17
100	000683	远兴能源	108,700	607,633.00	0.17
101	002004	华邦健康	134,100	606,132.00	0.17
102	601868	中国能建	264,600	605,934.00	0.17
103	603158	腾龙股份	74,800	604,384.00	0.17
104	603156	养元饮品	26,400	602,976.00	0.17
105	600352	浙江龙盛	58,400	600,936.00	0.17
106	605166	聚合顺	50,200	600,894.00	0.17
107	002226	江南化工	110,800	600,536.00	0.17
108	600502	安徽建工	125,500	599,890.00	0.17
109	003020	立方制药	33,200	598,928.00	0.17
110	600380	健康元	53,100	598,437.00	0.17
111	001286	陕西能源	64,400	597,632.00	0.17
112	002088	鲁阳节能	46,700	597,293.00	0.17
113	000967	盈峰环境	120,100	596,897.00	0.17
114	600236	桂冠电力	87,700	596,360.00	0.17
115	000933	神火股份	35,200	594,880.00	0.17
116	601377	兴业证券	94,800	593,448.00	0.17
117	601992	金隅集团	333,100	592,918.00	0.17
118	600875	东方电气	37,300	592,697.00	0.17
119	600869	远东股份	124,600	591,850.00	0.17
120	601958	金钼股份	58,800	591,528.00	0.17
121	000807	云铝股份	43,600	589,908.00	0.17
122	002690	美亚光电	39,800	589,836.00	0.17
123	601168	西部矿业	36,700	589,769.00	0.17
124	002056	横店东磁	45,500	589,680.00	0.17
125	601311	骆驼股份	71,100	589,419.00	0.17
126	600496	精工钢构	194,600	587,692.00	0.16
127	600000	浦发银行	57,100	587,559.00	0.16
128	002688	金河生物	131,400	587,358.00	0.16



129	600261	阳光照明	179,600	587,292.00	0.16
130	600517	国网英大	106,500	586,815.00	0.16
131	601179	中国西电	77,300	586,707.00	0.16
132	002393	力生制药	33,200	585,648.00	0.16
133	603515	欧普照明	35,600	585,620.00	0.16
134	002159	三特索道	37,500	585,375.00	0.16
135	603987	康德莱	81,500	585,170.00	0.16
136	000850	华茂股份	141,600	584,808.00	0.16
137	002202	金风科技	56,600	584,678.00	0.16
138	600162	香江控股	304,300	584,256.00	0.16
139	002773	康弘药业	29,800	584,080.00	0.16
140	601877	正泰电器	24,900	582,909.00	0.16
141	688330	宏力达	22,200	582,528.00	0.16
142	600742	一汽富维	65,800	582,330.00	0.16
143	601319	中国人保	76,100	579,882.00	0.16
144	000498	山东路桥	97,400	579,530.00	0.16
145	000591	太阳能	121,300	577,388.00	0.16
146	688526	科前生物	40,400	577,316.00	0.16
147	301282	金禄电子	27,500	576,125.00	0.16
148	000685	中山公用	62,400	575,952.00	0.16
149	603115	海星股份	44,600	575,786.00	0.16
150	600328	中盐化工	73,000	574,510.00	0.16
151	600295	鄂尔多斯	58,700	572,912.00	0.16
152	301039	中集车辆	63,300	572,865.00	0.16
153	002926	华西证券	68,700	570,897.00	0.16
154	600938	中国海油	19,300	569,543.00	0.16
155	301087	可孚医疗	16,100	569,296.00	0.16
156	002206	海利得	132,700	569,283.00	0.16
157	688553	汇宇制药	37,400	568,480.00	0.16
158	300737	科顺股份	112,000	567,840.00	0.16
159	002500	山西证券	90,400	567,712.00	0.16
160	603568	伟明环保	26,200	566,706.00	0.16
161	600546	山煤国际	47,900	566,657.00	0.16
162	601688	华泰证券	32,200	566,398.00	0.16
163	603113	金能科技	100,600	566,378.00	0.16
164	688558	国盛智科	26,500	565,775.00	0.16
165	601117	中国化学	68,200	565,378.00	0.16
166	300360	炬华科技	33,700	565,149.00	0.16
167	002563	森马服饰	80,200	563,004.00	0.16
168	002939	长城证券	68,600	562,520.00	0.16
169	600061	国投资本	74,800	562,496.00	0.16
170	601001	晋控煤业	41,100	561,837.00	0.16
171	002142	宁波银行	23,100	561,561.00	0.16

172	603995	甬金股份	30,700	561,503.00	0.16
173	000030	富奥股份	109,400	561,222.00	0.16
174	002831	裕同科技	20,700	560,970.00	0.16
175	601018	宁波港	145,600	560,560.00	0.16
176	601898	中煤能源	46,000	560,280.00	0.16
177	300244	迪安诊断	49,300	559,555.00	0.16
178	688269	凯立新材	22,400	559,552.00	0.16
179	601766	中国中车	66,700	558,946.00	0.16
180	601600	中国铝业	76,000	558,600.00	0.16
181	601665	齐鲁银行	99,800	557,882.00	0.16
182	300471	厚普股份	58,900	557,194.00	0.16
183	001914	招商积余	52,700	557,039.00	0.16
184	600663	陆家嘴	56,600	556,944.00	0.16
185	002385	大北农	128,600	556,838.00	0.16
186	600848	上海临港	55,100	556,510.00	0.16
187	603301	振德医疗	25,300	556,347.00	0.16
188	688381	帝奥微	28,800	555,264.00	0.16
189	688182	灿勤科技	31,000	554,280.00	0.16
190	600727	鲁北化工	74,800	554,268.00	0.16
191	600015	华夏银行	69,187	554,187.87	0.16
192	601619	嘉泽新能	166,900	554,108.00	0.16
193	603043	广州酒家	33,300	553,779.00	0.16
194	600995	南网储能	54,700	553,564.00	0.16
195	000928	中钢国际	86,800	552,916.00	0.15
196	300643	万通智控	46,200	552,552.00	0.15
197	601886	江河集团	102,100	551,340.00	0.15
198	688697	纽威数控	33,100	550,784.00	0.15
199	000039	中集集团	70,800	550,116.00	0.15
200	688135	利扬芯片	27,400	549,918.00	0.15
201	600583	海油工程	100,500	549,735.00	0.15
202	300761	立华股份	28,200	548,772.00	0.15
203	002978	安宁股份	19,300	548,506.00	0.15
204	000828	东莞控股	51,300	548,397.00	0.15
205	603939	益丰药房	22,680	547,268.40	0.15
206	002203	海亮股份	50,900	547,175.00	0.15
207	603565	中谷物流	55,800	546,840.00	0.15
208	002601	龙佰集团	30,900	546,003.00	0.15
209	301307	美利信	26,800	544,844.00	0.15
210	000589	贵州轮胎	108,200	544,246.00	0.15
211	300951	博硕科技	18,200	543,634.00	0.15
212	000050	深天马 A	60,200	543,606.00	0.15
213	000686	东北证券	68,400	543,096.00	0.15
214	000739	普洛药业	33,400	543,084.00	0.15

215	601108	财通证券	66,400	542,488.00	0.15
216	688371	菲沃泰	34,900	541,648.00	0.15
217	301379	天山电子	26,800	541,360.00	0.15
218	002250	联化科技	98,100	540,531.00	0.15
219	000166	申万宏源	101,000	540,350.00	0.15
220	603588	高能环境	103,100	540,244.00	0.15
221	600188	兖矿能源	38,100	539,877.00	0.15
222	600109	国金证券	61,800	539,514.00	0.15
223	688687	凯因科技	25,000	539,500.00	0.15
224	688133	泰坦科技	29,571	539,375.04	0.15
225	000725	京东方 A	122,800	539,092.00	0.15
226	600258	首旅酒店	36,700	538,389.00	0.15
227	301370	国科恒泰	49,800	537,840.00	0.15
228	002299	圣农发展	37,000	535,760.00	0.15
229	600909	华安证券	88,300	535,098.00	0.15
230	600362	江西铜业	25,900	534,576.00	0.15
231	688389	普门科技	35,900	534,551.00	0.15
232	603733	仙鹤股份	25,900	534,317.00	0.15
233	600426	华鲁恒升	24,700	533,767.00	0.15
234	600780	通宝能源	94,800	533,724.00	0.15
235	688331	荣昌生物	17,700	532,947.00	0.15
236	688533	上声电子	15,300	532,746.00	0.15
237	000783	长江证券	77,800	530,596.00	0.15
238	002106	莱宝高科	48,600	530,226.00	0.15
239	300745	欣锐科技	33,200	528,544.00	0.15
240	688689	银河微电	24,900	527,631.00	0.15
241	601633	长城汽车	20,000	526,600.00	0.15
242	601318	中国平安	10,000	526,500.00	0.15
243	300682	朗新集团	43,100	525,820.00	0.15
244	603355	莱克电气	23,200	525,480.00	0.15
245	688579	山大地纬	57,100	524,749.00	0.15
246	603833	欧派家居	7,600	523,944.00	0.15
247	688102	斯瑞新材	59,400	523,908.00	0.15
248	601231	环旭电子	31,700	523,050.00	0.15
249	688728	格科微	38,900	522,816.00	0.15
250	600036	招商银行	13,300	522,690.00	0.15
251	688061	灿瑞科技	18,091	522,468.08	0.15
252	000700	模塑科技	74,400	522,288.00	0.15
253	002736	国信证券	46,600	521,920.00	0.15
254	688349	三一重能	16,900	521,872.00	0.15
255	688176	亚虹医药	76,800	521,472.00	0.15
256	603013	亚普股份	34,800	521,304.00	0.15
257	603008	喜临门	31,100	521,236.00	0.15

258	002532	天山铝业	66,200	520,994.00	0.15
259	600648	外高桥	43,700	520,467.00	0.15
260	688401	路维光电	19,700	519,883.00	0.15
261	688030	山石网科	33,500	519,250.00	0.15
262	688475	萤石网络	17,192	519,026.48	0.15
263	002683	广东宏大	19,600	519,008.00	0.15
264	000537	中绿电	56,900	518,928.00	0.15
265	001311	多利科技	20,100	518,379.00	0.15
266	688556	高测股份	46,300	517,634.00	0.14
267	688699	明微电子	14,400	517,536.00	0.14
268	000415	渤海租赁	136,900	516,113.00	0.14
269	000728	国元证券	61,700	515,812.00	0.14
270	601668	中国建筑	85,900	515,400.00	0.14
271	688232	新点软件	17,762	514,920.38	0.14
272	688588	凌志软件	37,100	511,980.00	0.14
273	600866	星湖科技	79,100	511,777.00	0.14
274	002540	亚太科技	83,000	511,280.00	0.14
275	603132	金徽股份	45,500	510,965.00	0.14
276	688391	钜泉科技	16,832	510,851.20	0.14
277	600478	科力远	123,600	510,468.00	0.14
278	600132	重庆啤酒	8,100	510,462.00	0.14
279	688139	海尔生物	14,500	510,400.00	0.14
280	600989	宝丰能源	30,300	510,252.00	0.14
281	688496	清越科技	59,500	509,915.00	0.14
282	300919	中伟股份	14,100	509,292.00	0.14
283	688410	山外山	45,543	508,259.88	0.14
284	601628	中国人寿	12,100	507,232.00	0.14
285	600643	爱建集团	98,000	506,660.00	0.14
286	002483	润邦股份	97,200	506,412.00	0.14
287	603799	华友钴业	17,300	506,198.00	0.14
288	000987	越秀资本	72,000	505,440.00	0.14
289	601198	东兴证券	45,900	505,359.00	0.14
290	688388	嘉元科技	34,300	505,239.00	0.14
291	301276	嘉曼服饰	24,800	504,680.00	0.14
292	000552	甘肃能化	183,500	504,625.00	0.14
293	688112	鼎阳科技	18,000	504,540.00	0.14
294	300772	运达股份	38,100	504,444.00	0.14
295	600585	海螺水泥	21,200	504,136.00	0.14
296	000776	广发证券	31,100	504,131.00	0.14
297	601901	方正证券	60,400	503,132.00	0.14
298	002415	海康威视	16,300	500,410.00	0.14
299	603170	宝立食品	32,800	499,216.00	0.14
300	000932	华菱钢铁	119,300	498,674.00	0.14

301	601601	中国太保	14,600	497,568.00	0.14
302	688127	蓝特光学	18,328	496,688.80	0.14
303	002833	弘亚数控	29,400	494,802.00	0.14
304	300055	万邦达	103,100	493,849.00	0.14
305	688478	晶升股份	17,500	493,675.00	0.14
306	688512	慧智微	49,800	493,518.00	0.14
307	688088	虹软科技	12,795	493,375.20	0.14
308	002236	大华股份	30,800	492,800.00	0.14
309	301219	腾远钴业	10,900	492,789.00	0.14
310	688100	威胜信息	13,600	492,320.00	0.14
311	601066	中信建投	19,100	491,825.00	0.14
312	688621	阳光诺和	13,000	490,100.00	0.14
313	600739	辽宁成大	47,300	489,555.00	0.14
314	688516	奥特维	11,300	489,403.00	0.14
315	688561	奇安信	18,200	488,306.00	0.14
316	000550	江铃汽车	20,800	487,760.00	0.14
317	300003	乐普医疗	43,000	487,620.00	0.14
318	301029	怡合达	19,700	486,984.00	0.14
319	300057	万顺新材	101,000	486,820.00	0.14
320	300259	新天科技	139,000	486,500.00	0.14
321	300207	欣旺达	21,800	486,358.00	0.14
322	002430	杭氧股份	22,300	486,140.00	0.14
323	688373	盟科药业	98,200	485,108.00	0.14
324	000065	北方国际	49,500	484,110.00	0.14
325	688580	伟思医疗	17,300	482,843.00	0.14
326	688201	信安世纪	54,600	482,118.00	0.14
327	000718	苏宁环球	204,000	481,440.00	0.13
328	300529	健帆生物	16,400	481,176.00	0.13
329	301238	瑞泰新材	30,500	477,630.00	0.13
330	688148	芳源股份	96,200	476,190.00	0.13
331	688079	美迪凯	54,800	474,568.00	0.13
332	688259	创耀科技	13,500	473,985.00	0.13
333	688375	国博电子	9,598	473,757.28	0.13
334	600195	中牧股份	70,600	473,726.00	0.13
335	603317	天味食品	35,500	473,570.00	0.13
336	688509	正元地信	119,200	473,224.00	0.13
337	300400	劲拓股份	29,001	470,396.22	0.13
338	688261	东微半导	11,200	470,288.00	0.13
339	688711	宏微科技	27,100	468,288.00	0.13
340	688612	威迈斯	19,844	467,127.76	0.13
341	600420	国药现代	39,100	466,854.00	0.13
342	688508	芯朋微	10,846	466,052.62	0.13
343	688336	三生国健	21,730	465,456.60	0.13

344	300331	苏大维格	21,500	465,045.00	0.13
345	601882	海天精工	21,200	464,916.00	0.13
346	688007	光峰科技	31,421	464,716.59	0.13
347	688063	派能科技	11,600	464,580.00	0.13
348	688005	容百科技	14,715	464,258.25	0.13
349	300726	宏达电子	14,900	463,390.00	0.13
350	002043	兔宝宝	39,000	463,320.00	0.13
351	688122	西部超导	10,800	462,456.00	0.13
352	002267	陕天然气	54,600	461,370.00	0.13
353	688002	睿创微纳	9,800	460,698.00	0.13
354	603600	永艺股份	38,700	460,143.00	0.13
355	600956	新天绿能	60,800	458,432.00	0.13
356	603053	成都燃气	45,700	458,371.00	0.13
357	601089	福元医药	28,600	457,600.00	0.13
358	000968	蓝焰控股	68,800	457,520.00	0.13
359	300618	寒锐钴业	13,500	455,895.00	0.13
360	603408	建霖家居	36,300	454,839.00	0.13
361	002293	罗莱生活	57,610	449,358.00	0.13
362	603367	辰欣药业	32,700	449,298.00	0.13
363	300203	聚光科技	29,400	447,762.00	0.13
364	688138	清溢光电	19,538	447,420.20	0.13
365	688586	江航装备	46,700	446,919.00	0.13
366	002303	美盈森	124,600	446,068.00	0.12
367	688571	杭华股份	66,398	445,530.58	0.12
368	688352	颀中科技	36,700	445,171.00	0.12
369	001328	登康口腔	14,000	444,640.00	0.12
370	300433	蓝思科技	20,300	444,570.00	0.12
371	603387	基蛋生物	53,700	443,025.00	0.12
372	601002	晋亿实业	101,800	442,830.00	0.12
373	002479	富春环保	93,400	442,716.00	0.12
374	601126	四方股份	26,100	442,656.00	0.12
375	688566	吉贝尔	19,700	441,280.00	0.12
376	603288	海天味业	9,600	440,640.00	0.12
377	000153	丰原药业	71,800	440,134.00	0.12
378	688001	华兴源创	16,200	439,020.00	0.12
379	603693	江苏新能	44,500	438,325.00	0.12
380	300327	中颖电子	17,900	438,013.00	0.12
381	600508	上海能源	33,100	437,913.00	0.12
382	600475	华光环能	48,600	437,886.00	0.12
383	300257	开山股份	48,000	437,760.00	0.12
384	002060	广东建工	119,600	437,736.00	0.12
385	688006	杭可科技	24,500	437,570.00	0.12
386	000529	广弘控股	73,800	435,420.00	0.12

387	600035	楚天高速	94,600	435,160.00	0.12
388	002508	老板电器	20,300	435,029.00	0.12
389	300357	我武生物	21,400	434,848.00	0.12
390	301136	招标股份	36,700	434,528.00	0.12
391	301559	中集环科	28,300	434,405.00	0.12
392	603551	奥普科技	40,600	433,608.00	0.12
393	688778	厦钨新能	9,500	433,580.00	0.12
394	600731	湖南海利	75,900	432,630.00	0.12
395	600389	江山股份	29,900	432,055.00	0.12
396	603966	法兰泰克	55,800	430,776.00	0.12
397	002434	万里扬	69,300	429,660.00	0.12
398	300233	金城医药	35,800	429,600.00	0.12
399	688055	龙腾光电	104,000	429,520.00	0.12
400	002498	汉缆股份	126,700	429,513.00	0.12
401	300434	金石亚药	52,000	429,000.00	0.12
402	688326	经纬恒润	5,100	428,910.00	0.12
403	600310	广西能源	94,000	428,640.00	0.12
404	603727	博迈科	37,300	428,204.00	0.12
405	600664	哈药股份	103,600	427,868.00	0.12
406	002382	蓝帆医疗	83,400	427,842.00	0.12
407	000990	诚志股份	55,100	427,025.00	0.12
408	002923	润都股份	44,700	426,438.00	0.12
409	688661	和林微纳	12,900	425,829.00	0.12
410	688585	上纬新材	63,900	425,574.00	0.12
411	688658	悦康药业	29,500	425,095.00	0.12
412	000729	燕京啤酒	35,300	425,012.00	0.12
413	688651	盛邦安全	12,000	424,440.00	0.12
414	688106	金宏气体	24,900	423,549.00	0.12
415	300514	友讯达	29,300	423,092.00	0.12
416	688093	世华科技	20,900	421,971.00	0.12
417	688248	南网科技	13,101	420,411.09	0.12
418	603659	璞泰来	26,400	420,024.00	0.12
419	000401	冀东水泥	80,300	419,969.00	0.12
420	002788	鹭燕医药	51,100	419,531.00	0.12
421	300390	天华新能	18,200	419,510.00	0.12
422	002818	富森美	28,000	418,320.00	0.12
423	600037	歌华有线	55,800	416,268.00	0.12
424	688598	金博股份	19,700	414,882.00	0.12
425	002166	莱茵生物	55,500	414,585.00	0.12
426	301322	绿通科技	18,860	414,542.80	0.12
427	600750	江中药业	18,200	413,140.00	0.12
428	300142	沃森生物	34,200	413,136.00	0.12
429	688628	优利德	11,200	412,608.00	0.12

430	002791	坚朗五金	18,100	411,594.00	0.12
431	688522	纳睿雷达	7,300	411,282.00	0.12
432	603337	杰克股份	13,500	411,210.00	0.12
433	688206	概伦电子	21,627	408,966.57	0.11
434	000419	通程控股	71,600	408,836.00	0.11
435	600458	时代新材	31,800	407,358.00	0.11
436	600320	振华重工	103,900	407,288.00	0.11
437	002705	新宝股份	27,100	406,500.00	0.11
438	601333	广深铁路	118,100	405,083.00	0.11
439	688548	广钢气体	40,200	404,814.00	0.11
440	601577	长沙银行	45,500	404,495.00	0.11
441	002533	金杯电工	41,100	404,424.00	0.11
441	600372	中航机载	32,800	404,424.00	0.11
442	000156	华数传媒	56,100	403,920.00	0.11
443	601827	三峰环境	47,000	403,260.00	0.11
444	000598	兴蓉环境	53,000	402,270.00	0.11
445	600713	南京医药	81,100	402,256.00	0.11
446	000544	中原环保	46,000	401,580.00	0.11
447	600642	申能股份	42,300	401,427.00	0.11
448	600874	创业环保	67,200	401,184.00	0.11
449	300999	金龙鱼	12,300	401,103.00	0.11
450	600459	贵研铂业	29,200	400,916.00	0.11
451	603100	川仪股份	18,600	400,830.00	0.11
452	002020	京新药业	31,300	400,640.00	0.11
453	300174	元力股份	27,200	400,384.00	0.11
454	600821	金开新能	74,100	400,140.00	0.11
455	600033	福建高速	103,100	400,028.00	0.11
456	000965	天保基建	133,200	399,600.00	0.11
456	002228	合兴包装	133,200	399,600.00	0.11
457	601998	中信银行	57,200	399,256.00	0.11
458	002367	康力电梯	58,100	399,147.00	0.11
459	688722	同益中	31,300	399,075.00	0.11
460	000726	鲁泰 A	61,200	399,024.00	0.11
461	600461	洪城环境	40,100	398,995.00	0.11
462	300316	晶盛机电	12,500	398,750.00	0.11
463	600572	康恩贝	85,000	396,100.00	0.11
464	600039	四川路桥	54,400	396,032.00	0.11
465	600717	天津港	81,200	395,444.00	0.11
466	600020	中原高速	93,700	395,414.00	0.11
467	002034	旺能环境	25,500	395,250.00	0.11
468	300150	世纪瑞尔	90,200	395,076.00	0.11
469	603010	万盛股份	38,400	394,368.00	0.11
470	600032	浙江新能	53,200	393,680.00	0.11



471	002534	西子洁能	35,400	393,294.00	0.11
472	600528	中铁工业	48,700	392,522.00	0.11
473	600863	内蒙华电	90,300	390,999.00	0.11
474	002478	常宝股份	73,900	390,931.00	0.11
475	603093	南华期货	32,700	389,130.00	0.11
476	688244	永信至诚	15,200	389,120.00	0.11
477	300279	和晶科技	64,000	387,840.00	0.11
478	600970	中材国际	40,800	386,784.00	0.11
479	688531	日联科技	7,900	376,277.00	0.11
480	600997	开滦股份	46,100	311,636.00	0.09
481	688157	松井股份	7,900	310,549.00	0.09
482	603277	银都股份	13,000	301,210.00	0.08
483	002780	三夫户外	22,800	288,420.00	0.08
484	601728	中国电信	39,900	288,078.00	0.08
485	002812	恩捷股份	9,000	287,910.00	0.08
486	300110	华仁药业	80,600	283,712.00	0.08
487	600505	西昌电力	23,400	283,140.00	0.08
488	688559	海目星	8,200	282,080.00	0.08
489	002891	中宠股份	7,900	282,030.00	0.08
490	600104	上汽集团	13,500	280,260.00	0.08
491	000938	紫光股份	10,000	278,300.00	0.08
492	600405	动力源	49,000	277,340.00	0.08
493	002847	盐津铺子	4,400	275,440.00	0.08
494	301498	乖宝宠物	3,500	274,120.00	0.08
495	600919	江苏银行	27,600	271,032.00	0.08
496	603918	金桥信息	21,200	269,664.00	0.08
497	002825	纳尔股份	34,000	265,880.00	0.07
498	002179	中航光电	6,700	263,310.00	0.07
499	688356	键凯科技	4,600	261,924.00	0.07
500	002605	姚记科技	9,800	261,268.00	0.07
501	603721	中广天择	10,000	260,700.00	0.07
502	000917	电广传媒	36,400	257,348.00	0.07
503	300634	彩讯股份	11,800	257,240.00	0.07
504	601019	山东出版	22,500	255,375.00	0.07
505	301269	华大九天	2,100	254,310.00	0.07
506	600143	金发科技	29,400	254,016.00	0.07
507	688676	金盘科技	6,100	252,662.00	0.07
508	605196	华通线缆	21,500	251,120.00	0.07
509	688793	倍轻松	8,400	250,320.00	0.07
510	603039	泛微网络	5,100	249,900.00	0.07
511	603868	飞科电器	6,000	249,120.00	0.07
512	301070	开勒股份	4,400	244,288.00	0.07
513	600577	精达股份	33,500	244,215.00	0.07

514	000880	潍柴重机	14,000	242,200.00	0.07
515	301015	百洋医药	9,899	239,654.79	0.07
516	000876	新希望	26,500	237,970.00	0.07
517	605369	拱东医疗	8,400	235,872.00	0.07
518	300170	汉得信息	19,000	235,600.00	0.07
519	002075	沙钢股份	37,600	235,376.00	0.07
520	002130	沃尔核材	9,200	232,300.00	0.07
521	600266	城建发展	44,500	226,950.00	0.06
522	300741	华宝股份	12,600	219,114.00	0.06
523	300587	天铁股份	45,000	197,550.00	0.06
524	002391	长青股份	37,200	186,372.00	0.05
525	601166	兴业银行	8,200	157,112.00	0.04
526	600268	国电南自	23,000	154,560.00	0.04
527	000651	格力电器	3,300	149,985.00	0.04
528	002128	电投能源	6,100	119,438.00	0.03
529	688370	丛麟科技	5,500	107,965.00	0.03
530	601236	红塔证券	12,700	107,823.00	0.03
531	300428	立中集团	6,200	101,060.00	0.03
532	688819	天能股份	3,500	95,270.00	0.03
533	002153	石基信息	12,900	92,106.00	0.03
534	688472	阿特斯	6,470	81,263.20	0.02
535	600029	南方航空	12,510	81,189.90	0.02
536	600176	中国巨石	7,000	79,730.00	0.02
537	600999	招商证券	4,100	78,556.00	0.02
538	688009	中国通号	10,628	66,531.28	0.02
539	002412	汉森制药	10,700	64,307.00	0.02
540	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.02
541	688707	振华新材	5,200	56,940.00	0.02
542	688223	晶科能源	7,900	56,169.00	0.02
543	000055	方大集团	12,800	50,432.00	0.01
544	603369	今世缘	1,100	49,753.00	0.01
545	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
546	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.01
547	601800	中国交建	3,700	38,665.00	0.01
548	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.01
549	300012	华测检测	2,600	32,318.00	0.01
550	688449	联芸科技	1,089	32,060.16	0.01
551	603678	火炬电子	1,000	30,500.00	0.01
552	002636	金安国纪	3,800	29,412.00	0.01
553	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.01
554	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.01
555	688408	中信博	362	26,064.00	0.01
556	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.01

557	688708	佳驰科技	468	22,908.60	0.01
558	300253	卫宁健康	3,100	22,196.00	0.01
559	605286	同力日升	700	21,112.00	0.01
560	301522	上大股份	816	20,269.44	0.01
561	600958	东方证券	1,900	20,064.00	0.01
562	688348	昱能科技	400	19,520.00	0.01
563	688279	峰岬科技	115	18,135.50	0.01
564	001391	国货航	2,587	17,591.60	0.00
565	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
566	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
567	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
568	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
569	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
570	300957	贝泰妮	300	12,807.00	0.00
571	301277	新天地	923	12,765.09	0.00
572	300447	全信股份	900	12,753.00	0.00
573	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
574	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00
575	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
576	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
577	301631	壹连科技	105	10,705.80	0.00
578	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
579	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
580	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
581	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
582	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
583	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
584	603194	中力股份	262	7,370.06	0.00
585	300144	宋城演艺	700	6,503.00	0.00
586	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
587	688439	振华风光	100	5,129.00	0.00
588	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
589	001359	平安电工	184	4,767.44	0.00
590	603310	巍华新材	234	4,200.30	0.00
591	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
592	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
593	688358	祥生医疗	134	3,272.28	0.00
594	688197	首药控股	105	3,133.20	0.00
595	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
596	688165	埃夫特	100	2,640.00	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	688601	力芯微	15,122,772.71	3.03
2	600566	济川药业	11,514,615.00	2.30
3	002371	北方华创	10,950,104.00	2.19
4	603379	三美股份	10,744,040.00	2.15
5	600285	羚锐制药	10,525,410.00	2.11
6	600866	星湖科技	10,390,938.00	2.08
7	002422	科伦药业	10,259,425.00	2.05
8	002605	姚记科技	10,162,406.00	2.03
9	002043	兔宝宝	10,125,790.00	2.03
10	603993	洛阳钼业	10,104,399.00	2.02
11	300413	芒果超媒	10,003,180.00	2.00
12	301236	软通动力	9,609,622.00	1.92
13	688516	奥特维	9,522,299.60	1.91
14	600153	建发股份	9,511,993.00	1.90
15	000915	华特达因	9,453,898.00	1.89
16	000651	格力电器	9,373,865.00	1.88
17	300763	锦浪科技	9,223,744.00	1.85
18	601728	中国电信	9,003,441.00	1.80
19	000596	古井贡酒	8,896,667.00	1.78
20	600176	中国巨石	8,886,716.44	1.78

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	688601	力芯微	15,191,775.90	3.04
2	600566	济川药业	13,700,938.25	2.74
3	300418	昆仑万维	12,398,862.00	2.48
4	603993	洛阳钼业	11,313,799.58	2.26
5	002422	科伦药业	11,011,251.00	2.20
6	600285	羚锐制药	10,801,807.00	2.16
7	301236	软通动力	10,759,677.00	2.15
8	603379	三美股份	10,409,898.00	2.08
9	002371	北方华创	10,084,719.00	2.02
10	600642	申能股份	10,070,250.00	2.01
11	002043	兔宝宝	9,948,515.00	1.99
12	601728	中国电信	9,936,983.00	1.99
13	000651	格力电器	9,936,291.00	1.99
14	600176	中国巨石	9,914,122.06	1.98
15	002605	姚记科技	9,891,546.00	1.98
16	600398	海澜之家	9,779,532.00	1.96

17	600866	星湖科技	9,687,683.00	1.94
18	300763	锦浪科技	9,643,242.00	1.93
19	600482	中国动力	9,634,572.00	1.93
20	600529	山东药玻	9,633,715.00	1.93

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	5,025,568,465.13
卖出股票收入（成交）总额	5,207,658,505.52

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	1,724,582.93	0.48
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,724,582.93	0.48

#### 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	019723	23 国债 20	17,000	1,724,582.93	0.48

#### 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 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 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中，科华数据股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国大唐集团有限公司的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。其余前十大持有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	3,173,809.93
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	342,640.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,516,450.43

### 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	21,052	7,072.23	71,489,541.15	48.02%	77,394,999.49	51.98%
中欧数据挖掘混合 C	22,974	3,042.36	37,436,059.37	53.56%	32,459,079.49	46.44%
合计	44,026	4,969.33	108,925,600.52	49.79%	109,854,078.98	50.21%

### 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 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧数据挖掘混合 A	1,565,959.98	1.05%
	中欧数据挖掘混合 C	8,969.16	0.01%
	合计	1,574,929.14	0.72%

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	中欧数据挖掘混合 A	0
	中欧数据挖掘混合 C	0
	合计	0
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	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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 1 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	182,038,349.26	163,252,868.50
本报告期基金总申购份额	72,597,511.30	53,321,587.12
减：本报告期基金总赎回份额	105,751,319.92	146,679,316.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	148,884,540.64	69,895,138.86

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

本报告期内，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重大改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2017 年 12 月 30 日起聘请安永华明会计师事务所（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 50,000.00 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人及其高级管理人不存在受稽查或处罚的情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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 (%)	
华福证券	1	1,531,225,297.65	14.97	681,435.21	13.56	-
中信建投	1	1,076,866,454.40	10.53	556,809.09	11.08	本报告期退租 1 个
民生证券	2	991,698,256.17	9.69	475,589.12	9.46	-
长江证券	1	784,318,877.95	7.67	417,334.46	8.30	本报告期退租 1 个
华创证券	2	776,943,817.61	7.60	374,216.96	7.44	本报告期新增 1 个
国信证券	1	724,870,470.03	7.09	395,751.59	7.87	-
天风证券	1	544,061,944.27	5.32	237,181.80	4.72	-

中泰证券	2	468,334,689.29	4.58	205,031.06	4.08	-
财通证券	1	379,142,060.13	3.71	206,953.00	4.12	-
国都证券	2	364,478,480.53	3.56	198,977.37	3.96	本报告期 退租 1个
国海证券	1	347,139,571.24	3.39	189,507.16	3.77	-
华源证券	1	321,042,728.28	3.14	139,945.37	2.78	本报告期 新增 1个
浙商证券	1	312,194,515.29	3.05	159,478.86	3.17	-
国泰君安	1	260,460,044.14	2.55	113,540.05	2.26	-
东吴证券	1	227,592,697.99	2.22	119,347.68	2.37	-
广发证券	1	219,889,774.31	2.15	110,377.47	2.20	本报告期 退租 1个
国金证券	1	207,662,866.99	2.03	113,367.02	2.26	-
东方财富	1	191,242,117.64	1.87	104,407.07	2.08	-
德邦证券	2	144,262,259.49	1.41	62,886.28	1.25	-
华泰证券	1	119,134,013.51	1.16	51,932.49	1.03	本报告期 退租 1个
申万宏源 证券	1	99,425,478.06	0.97	43,343.11	0.86	-
西南证券	1	52,649,600.51	0.51	22,951.06	0.46	-
东北证券	2	37,687,588.11	0.37	20,574.19	0.41	-
国投证券	1	29,833,267.00	0.29	16,286.92	0.32	-
兴业证券	1	17,157,188.45	0.17	9,366.42	0.19	-

川财证券	-	-	-	-	-	本报告期退租 1 个
东方证券	1	-	-	-	-	本报告期退租 1 个
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
海通证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	本报告期退租 1 个
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

2、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、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

### 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(%)
华福证券	-	-	5,000,000.00	100.00	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	1,718,550.96	100.00	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

国投证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
川财证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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（被动股票型基金不适用）。

2、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、经营状况的基础上，选择基金专用交易席位。

### 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 2023 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
2	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-01-22
3	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会指定媒介	2024-03-29

4	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-03-29
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
6	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-04-20
7	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（2024 年 6 月）	中国证监会指定媒介	2024-06-15
8	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	2024-06-25
9	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
10	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第二季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-07-19
11	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
12	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-08-31
13	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第三季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2024-10-25
14	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会指定媒介	2024-10-25

## § 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	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 10 月 15 日	142,790,178.82	17,206,228.95	159,996,407.77	0.00	0.00 %
	2	2024 年 10 月 18 日至 2024 年 11 月 21 日	19,944,342.67	26,563,874.64	11,001,647.63	35,506,569.68	16.23 %
产品特有风险							
本基金本报告期存在单一投资者持有基金份额比例超过 20%的情况，在市场情况突变的情况下，可能出现集中甚至巨额赎回从而引发基金的流动性风险，本基金管理人将对申购赎回进行审慎的应对，并在基金运作中对流动性进行严格的管理，降低流动性风险，保护中小投资者利益。							

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、本基金批复文件、基金合同、托管协议、招募说明书及更新；
- 2、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 3、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

基金管理人的办公场所。

### 13.3 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办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人中欧基金管理有限公司：

客户服务中心电话：021-68609700，400-700-9700

中欧基金管理有限公司

2025年3月29日