

中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券
投资基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：中欧基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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。本中期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 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	59
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	59
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	59

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	66
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	67
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
§ 12 备查文件目录	68
12.1 备查文件目录.....	68
12.2 存放地点.....	68
12.3 查阅方式.....	68

§ 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	326,050,972.93 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	163,787,318.51 份	162,263,654.42 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中欧基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	黎忆海	郭明
	联系电话	021-68609600	(010) 66105799
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700、400-700-9700	95588
传真		021-50190017	(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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期(2025 年 1 月 1 日 - 2025 年 6 月 30 日)	
	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	14,817,338.63	7,828,970.18
本期利润	34,207,632.56	19,504,512.40
加权平均基金份额 本期利润	0.2141	0.2487
本期加权平均净 值利润率	12.33%	15.22%
本期基金份额净 值增长率	13.23%	12.78%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利 润	99,195,125.58	79,916,684.45
期末可供分配基 金份额利润	0.6056	0.4925
期末基金资产净 值	308,757,650.65	285,866,100.67

期末基金份额净值	1.8851	1.7617
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	140.59%	110.08%

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
过去一个月	6.07%	0.77%	4.11%	0.75%	1.96%	0.02%
过去三个月	7.76%	1.57%	1.03%	1.42%	6.73%	0.15%
过去六个月	13.23%	1.36%	3.20%	1.29%	10.03%	0.07%
过去一年	33.85%	1.62%	18.96%	1.63%	14.89%	-0.01%
过去三年	8.96%	1.27%	-7.33%	1.29%	16.29%	-0.02%
自基金合同生效起至今	140.59%	1.27%	24.50%	1.12%	116.09%	0.15%

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

中欧数据挖掘混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	6.00%	0.77%	4.11%	0.75%	1.89%	0.02%

过去三个月	7.54%	1.57%	1.03%	1.42%	6.51%	0.15%
过去六个月	12.78%	1.36%	3.20%	1.29%	9.58%	0.07%
过去一年	32.73%	1.61%	18.96%	1.63%	13.77%	-0.02%
过去三年	6.34%	1.27%	-7.33%	1.29%	13.67%	-0.02%
自基金份额起始 运作日至今	110.08%	1.30%	22.54%	1.16%	87.54%	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

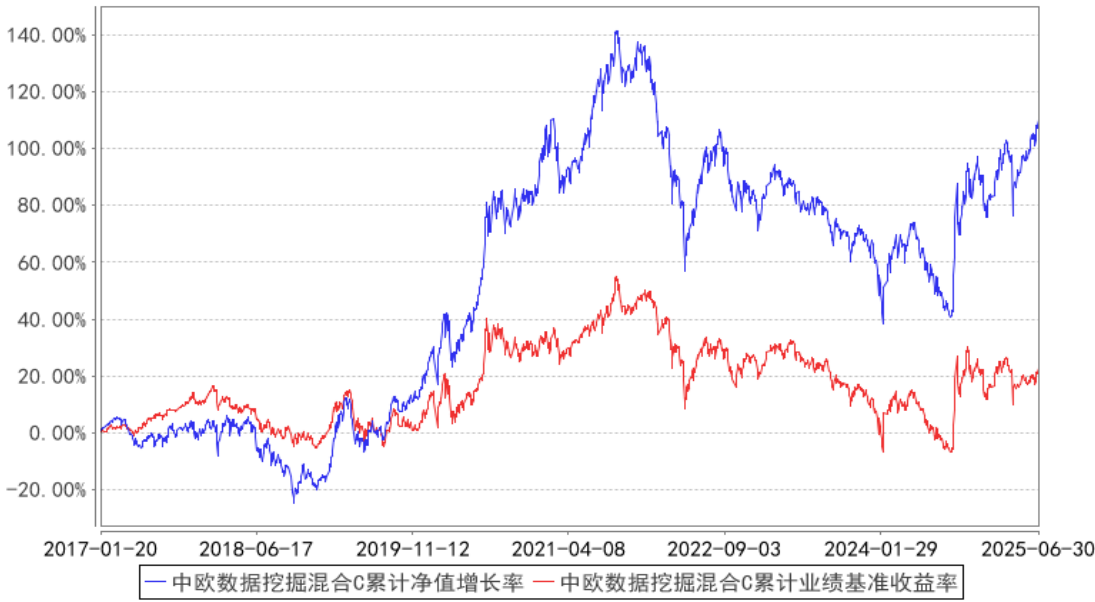
中欧数据挖掘混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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 2025 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中欧基金管理有限公司经中国证监会（证监基字[2006]102 号文）批准，于 2006 年 7 月 19 日正式成立。股东为 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 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 208 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 / 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 投决会委 员/量化 投资总监 /基金经 理/投资 经理	2016-01- 13	-	18 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。
----	--	----------------	---	------	---

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。

3、上表中“职务”指在公司的任职情况，其中赵子衡担任本基金的基金经理助理。

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	2,689,451,479.32	2016-01-13
	私募资产管理计划	2	1,885,092,107.13	2021-12-22
	其他组合	-	-	-
	合计	10	4,574,543,586.45	-

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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。

本报告期内，本基金管理人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 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 19 次，为量化策略组合因投资策略需要发生的反向交易，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

2025 年二季度 A 股市场整体呈现宽幅震荡走势，结构性机会与宏观扰动交织，上证指数微幅上涨。从月度表现来看，4 月因地缘贸易摩擦风险升级，市场明显承压；5 月政策发力与中美谈判缓和带动上证指数反弹；6 月则在外部扰动与风险缓释中维持震荡偏强格局。4 月关税风险冲击显著，政策维稳市场。4 月 3 日美国加征对等关税幅度超出市场预期，引发全球资本市场剧烈波动，大宗商品、权益市场全线承压，全球避险情绪升温，市场同步回调。在市场大幅下行背景下，4 月 8 日中央汇金发布公告，实施增持 ETF 等多项举措，同时中央及各部委协同发声稳定市场预期，上证指数逐步企稳并反弹。随后，美国宣布暂缓征收对等关税 90 天，市场对中美贸易谈判的预期逐步升温，市场延续了回升态势。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，整体表现为中盘平衡风格。基金利用基本面数据、量价数据、宏观微观另类数据等数据源，利用机器学习模型对个股的未来收益进行预测，并采用量化优化器生成以中证 500 指数的风险特征为基准的投资组合，以达到在未来预期收益高的股票上高配，在未来预期收益低的股票上低配的效果，力争挖掘对基准指数的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，基金 A 类份额净值增长率为 13.23%，同期业绩比较基准收益率为 3.20%；基金 C 类份额净值增长率为 12.78%，同期业绩比较基准收益率为 3.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短期地缘政治因素或许还会扰动市场节奏，引发阶段性波动。但当前中国市场估值处于低位区间，且在全球资产配置中仍处低配状态，配置性价比突出。面对外部环境压力，国内刺激消费、拉动内需的政策将为经济增长构筑支撑。但也需要保持谨慎的是，下半年部分高增长基数的行业或有增速回落的压力。此外，出口产业链中，海外库存较高的环节也可能受到全球关税压力传导而需求回落。因此，市场需要进一步挖掘结构性投资机会。从行业布局看，我们认为三大方向具备潜力：首先是科技成长领域，AI 产业已进入“硬件铺路、软件变现”的关键阶段，重点关注估值合理的应用层企业，特别是具备垂直行业 know-how 的解决方案提供商。其次，传统

周期行业迎来供给侧改革红利，部分化工、建材细分领域经过三年产能出清，行业集中度显著提升，在“整治内卷式竞争”政策指引下，头部优质企业盈利修复弹性可观。最后，消费行业中的“隐形冠军”值得长期布局，那些维持健康资产负债表、持续进行渠道优化的企业，一旦消费景气度回暖，将展现更强的业绩弹性。值得注意的是，这三个方向都符合“高质量增长”的转型主线，在估值洼地和政策催化双重作用下，有望成为引领市场复苏的重要引擎。基于市场特征演变，本基金将继续强化模型对市场的适配性，力争提升策略在延续波动环境中的超额收益挖掘能力。通过风控把控与模型优化的双向发力，助力量化策略在复杂市场中追求更稳健的表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定，有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为总经理，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，防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：基金日常估值由基金管理人进行，基金托管人按基金合同规定的估值方法、时间、程序进行复核，基金份额净值由基金管理人完成估值后，将估值结果以 XBRL 形式报给基金托管人，基金托管人复核无误后签章返回给基金管理人，由基金管理人依据本基金合同和有关法律法规的规定予以公布。报告期内相关基金估值政策的变更由托管银行进行复核确认。上述参与估值流程人员均具有估值业务所需的专业胜任能力及相关工作经历。上述参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内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 托管人对本中期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 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	74,444,839.40	49,579,707.33
结算备付金		3,608,547.07	6,605,389.90
存出保证金		5,333,158.55	3,173,809.93
交易性金融资产	6.4.7.2	514,280,560.99	303,804,236.53
其中：股票投资		512,547,973.15	302,079,653.60
基金投资		-	-
债券投资		1,732,587.84	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		15,167,443.09	342,640.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		612,834,549.10	363,505,784.19
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		10,145,194.65	4,573,499.06
应付赎回款		6,426,588.82	119,771.26
应付管理人报酬		502,238.59	366,822.15
应付托管费		83,706.44	61,137.03
应付销售服务费		140,741.37	75,566.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,034.56	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	911,293.35	1,259,454.99
负债合计		18,210,797.78	6,456,251.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	326,050,972.93	218,779,679.50
未分配利润	6.4.7.8	268,572,778.39	138,269,853.43
净资产合计		594,623,751.32	357,049,532.93
负债和净资产总计		612,834,549.10	363,505,784.19

注： 报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 326,050,972.93 份，其中下属 A 类基金份额净值为人民币 1.8851 元，基金份额总额 163,787,318.51 份；下属 C 类基金份额净值为人民币 1.7617 元，基金份额总额 162,263,654.42 份。

6.2 利润表

会计主体：中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		57,117,718.65	-21,890,600.89

1. 利息收入		109,758.60	109,494.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	109,758.60	109,494.51
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		25,858,887.93	-6,075,890.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	20,240,745.92	-13,398,693.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18,714.91	-
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	978,739.92	40,180.85
股利收益	6.4.7.14	4,620,687.18	7,282,621.90
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）	6.4.7.15	31,065,836.15	-15,981,208.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	83,235.97	57,003.98
减：二、营业总支出		3,405,573.69	4,268,934.95
1. 管理人报酬		2,401,226.76	2,834,942.16
2. 托管费		400,204.47	472,490.33
3. 销售服务费		506,430.68	866,901.59
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		3,555.28	364.51
8. 其他费用	6.4.7.18	94,156.50	94,236.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		53,712,144.96	-26,159,535.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		53,712,144.96	-26,159,535.84

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		53,712,144.96	-26,159,535.84

6.3 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	218,779,679.50	-	138,269,853.43	357,049,532.93
二、本期期初净资产	218,779,679.50	-	138,269,853.43	357,049,532.93
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	107,271,293.43	-	130,302,924.96	237,574,218.39
（一）、综合收益总额	-	-	53,712,144.96	53,712,144.96
（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）	107,271,293.43	-	76,590,780.00	183,862,073.43
其中：1. 基金申购款	178,319,234.70	-	127,397,437.05	305,716,671.75
2. 基金赎回款	-71,047,941.27	-	-50,806,657.05	-121,854,598.32
（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	326,050,972.93	-	268,572,778.39	594,623,751.32
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 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）	-25,681,535.85	-	-36,792,586.86	-62,474,122.71
（一）、综合收益总额	-	-	-26,159,535.84	-26,159,535.84
（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）	-25,681,535.85	-	-10,633,051.02	-36,314,586.87
其中：1. 基金申购款	54,656,756.53	-	24,743,611.34	79,400,367.87
2. 基金赎回款	-80,338,292.38	-	-35,376,662.36	-115,714,954.74
（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	319,609,681.91	-	117,687,517.45	437,297,199.36

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

刘建平

王音然

李宝林

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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

6.4.2 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 3 号《半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。

6.4.3 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	74,444,839.40
等于：本金	74,438,309.21
加：应计利息	6,530.19
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	74,444,839.40

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		492,859,666.90	-	512,547,973.15	19,688,306.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,717,000.00	28,847.84	1,732,587.84	-13,260.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,717,000.00	28,847.84	1,732,587.84	-13,260.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		494,576,666.90	28,847.84	514,280,560.99	19,675,046.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 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	41,760,594.03	-	-	-
其中： 股指期货投资	41,760,594.03	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	41,760,594.03	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IC2507	IC2507	17.00	19,949,160.00	1,016,015.97
IC2508	IC2508	11.00	12,815,880.00	230,240.00
IC2509	IC2509	7.00	8,086,120.00	182,350.00
IM2509	IM2509	2.00	2,462,240.00	124,200.00
合计				1,552,805.97
减：可抵销期货暂收款				1,552,805.97
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

无。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	8,937.25
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	818,053.54
其中：交易所市场	818,053.54
银行间市场	—
应付利息	—
预提费用-审计费	24,795.19
预提费用-信息披露费	59,507.37
合计	911,293.35

6.4.7.7 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	148,884,540.64	148,884,540.64
本期申购	57,906,017.78	57,906,017.78
本期赎回（以“-”号填列）	-43,003,239.91	-43,003,239.91
本期末	163,787,318.51	163,787,318.51

中欧数据挖掘混合 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,895,138.86	69,895,138.86
本期申购	120,413,216.92	120,413,216.92
本期赎回（以“-”号填列）	-28,044,701.36	-28,044,701.36
本期末	162,263,654.42	162,263,654.42

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。

6.4.7.8 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	76,302,249.60	22,683,387.75	98,985,637.35
本期期初	76,302,249.60	22,683,387.75	98,985,637.35
本期利润	14,817,338.63	19,390,293.93	34,207,632.56
本期基金份额交易产生的变动数	8,075,537.35	3,701,524.88	11,777,062.23

其中：基金申购款	31,768,500.56	12,904,475.45	44,672,976.01
基金赎回款	-23,692,963.21	-9,202,950.57	-32,895,913.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	99,195,125.58	45,775,206.56	144,970,332.14

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	28,780,914.33	10,503,301.75	39,284,216.08
本期期初	28,780,914.33	10,503,301.75	39,284,216.08
本期利润	7,828,970.18	11,675,542.22	19,504,512.40
本期基金份额交易产生的变动数	43,306,799.94	21,506,917.83	64,813,717.77
其中：基金申购款	55,589,482.98	27,134,978.06	82,724,461.04
基金赎回款	-12,282,683.04	-5,628,060.23	-17,910,743.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	79,916,684.45	43,685,761.80	123,602,446.25

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	84,361.20
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	23,908.69
其他	1,488.71
合计	109,758.60

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,428,372,973.59
减：卖出股票成本总额	2,404,411,661.42
减：交易费用	3,720,566.25
买卖股票差价收入	20,240,745.92

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	18,714.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	-

券到期兑付) 差价收入	
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	18,714.91

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	978,739.92

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,620,687.18
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	4,620,687.18

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	28,760,990.18
股票投资	28,771,700.18
债券投资	-10,710.00
资产支持证券投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	2,304,845.97
权证投资	-

期货投资	2,304,845.97
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	31,065,836.15

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	81,447.06
基金转换费收入	1,788.91
合计	83,235.97

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	764.00
账户维护费	9,000.00
存托服务费	89.94
合计	94,156.50

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内，不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中欧基金管理有限公司（“中欧基金”）	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
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
上海中欧财富基金销售有限公司（“中	基金管理人的控股子公司、基金销售机构

欧财富”)	
自然人股东	基金管理人股东
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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
国都证券	182,480,277.77	3.64	364,478,480.53	7.00

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 权证交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国都证券	79,560.26	3.64	14,315.75	1.75
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
国都证券	198,977.37	7.02	-	-

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）。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,401,226.76	2,834,942.16
其中：应支付销售机构的客户维护费	596,954.94	443,407.39
应支付基金管理人的净管理费	1,804,271.82	2,391,534.77

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	400,204.47	472,490.33

注：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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
------------	---------------------------------------

关联方名称	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	772.46	772.46
中欧财富	0.00	17,870.38	17,870.38
中欧基金	0.00	9,684.23	9,684.23
合计	0.00	28,327.07	28,327.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中欧数据挖掘混合 A	中欧数据挖掘混合 C	合计
工商银行	0.00	16.75	16.75
中欧财富	0.00	19,654.23	19,654.23
中欧基金	0.00	649,401.46	649,401.46
合计	0.00	669,072.44	669,072.44

注：本基金 A 基金份额不收取销售服务费，本基金 C 基金份额的年销售服务费费率为 0.80%。计算方法如下：

$$H=E\times 0.80\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
无。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

6.4.10.5.2 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	0.89%	1,450,628.30	0.97%

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。

6.4.10.6 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	74,444,839.40	84,361.20	34,222,354.71	67,824.34

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内不存在利润分配情况。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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
001335	信凯科技	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通受限	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
001356	富岭股份	2025 年 1 月 16 日	6 个月	新股流通受限	5.30	14.44	709	3,757.70	10,237.96	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通受限	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	C 信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	C 信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股流通受限	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
001395	亚联机械	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025 年 2 月 24 日	6 个月	新股流通受限	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
301275	汉朔	2025 年 3 月	6 个月	新股流通	27.50	56.19	335	9,212.50	18,823.65	-

	科技	月 4 日		受限						
301479	弘景光电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通受限	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-
301501	恒鑫生活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.51	45.22	325	8,942.08	14,696.50	-
301560	众捷汽车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股流通受限	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301601	惠通科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301602	超研股份	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股流通受限	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301658	首航新能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股流通受限	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
301662	宏工科技	2025 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301665	泰禾	2025 年 4 月	6 个月	新股流通	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-

	股份	月 2 日		受限						
301678	新恒汇	2025 年 6 月 13 日	6 个月	新股流通受限	12.80	44.54	382	4,889.60	17,014.28	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股流通受限	46.50	42.85	189	8,788.50	8,098.65	-
603072	天和磁材	2024 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	12.30	54.45	226	2,779.80	12,305.70	-
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股流通受限	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	93.50	90.66	63	5,890.50	5,711.58	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603257	中国瑞林	2025 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603271	永杰新材	2025 年 3 月 4 日	6 个月	新股流通受限	20.60	35.08	126	2,595.60	4,420.08	-
603382	海阳	2025 年 6	6 个月	新股流通	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-

	科技	月 5 日		受限						
603400	华之杰	2025 年 6 月 12 日	6 个月	新股流通受限	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603409	XD 汇通控	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股流通受限	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-
688411	海博思创	2025 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	19.38	83.49	560	10,852.80	46,754.40	-
688545	兴福电子	2025 年 1 月 15 日	6 个月	新股流通受限	11.68	26.95	994	11,609.92	26,788.30	-
688583	思看科技	2025 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	25.80	79.68	227	5,855.50	18,087.36	-
688755	汉邦科技	2025 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
688757	XD 胜科纳	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
688758	赛分科技	2025 年 1 月 2 日	6 个月	新股流通受限	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
688775	影石创新	2025 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通受限	47.27	124.16	340	16,071.80	42,214.40	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股	停牌	停	期末	复	复牌	数量	期末	期末	备
------	---	----	---	----	---	----	----	----	----	---

码	票名称	日期	牌原因	估值单价	牌日期	开盘单价	(股)	成本总额	估值总额	注
688313	仕佳光子	2025 年 6 月 30 日	重大事项停牌	38.05	2025 年 7 月 11 日	39.98	56,973	1,834,296.49	2,167,822.65	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 06 月 30 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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为混合型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。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，将风险控制可在承受的范围之内。

6.4.13.2 信用风险

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场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上市公司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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本基金所持大部分资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金所承担的除卖出回购金融资产款以外的金融负债的合约约定到期日

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。

6.4.13.3.1 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 6.4.12 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	74,444,839.40	-	-	-	74,444,839.40
结算备付金	3,608,547.07	-	-	-	3,608,547.07
存出保证金	135,550.55	-	-	5,197,608.00	5,333,158.55
交易性金融资产	1,732,587.84	-	-	512,547,973.15	514,280,560.99
应收申购款	-	-	-	15,167,443.09	15,167,443.09
资产总计	79,921,524.86	-	-	532,913,024.24	612,834,549.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,426,588.82	6,426,588.82
应付管理人报酬	-	-	-	502,238.59	502,238.59
应付托管费	-	-	-	83,706.44	83,706.44
应付清算款	-	-	-	10,145,194.65	10,145,194.65
应付销售服务费	-	-	-	140,741.37	140,741.37
应交税费	-	-	-	1,034.56	1,034.56

其他负债	-	-	-	911,293.35	911,293.35
负债总计	-	-	-	18,210,797.78	18,210,797.78
利率敏感度缺口	79,921,524.86	-	-	-514,702,226.46	594,623,751.32
上年度末 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

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有交易性债券资产占基金资产净值的比例为 0.29%（2024 年 12 月 31 日：0.48%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024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	512,547,973.15	86.20	302,079,653.60	84.60
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	512,547,973.15	86.20	302,079,653.60	84.60

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	30,730,650.37	17,336,943.77
	业绩比较基准下降 5%	-30,730,650.37	-17,336,943.77

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	509,951,713.46	300,955,303.73
第二层次	3,915,796.03	2,262,719.43
第三层次	413,051.50	586,213.37
合计	514,280,560.99	303,804,236.53

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 8 月 29 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	512,547,973.15	83.64
	其中：股票	512,547,973.15	83.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,732,587.84	0.28
	其中：债券	1,732,587.84	0.28
	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	78,053,386.47	12.74
8	其他各项资产	20,500,601.64	3.35
9	合计	612,834,549.10	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	279,888.00	0.05
B	采矿业	13,205,026.00	2.22
C	制造业	322,018,917.41	54.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,291,752.80	2.74
E	建筑业	6,639,976.00	1.12
F	批发和零售业	14,793,805.98	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	15,149,762.00	2.55
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,566,258.98	6.32
J	金融业	41,211,273.98	6.93
K	房地产业	2,751,653.00	0.46
L	租赁和商务服务业	14,847,911.96	2.50
M	科学研究和技术服务业	12,129,049.04	2.04
N	水利、环境和公共设施管理业	2,552,290.00	0.43

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	230,328.00	0.04
Q	卫生和社会工作	397,830.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	7,979,513.00	1.34
S	综合	4,502,737.00	0.76
	合计	512,547,973.15	86.20

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	300400	劲拓股份	352,101	5,929,380.84	1.00
2	000553	安道麦 A	819,000	5,913,180.00	0.99
3	002624	完美世界	386,700	5,866,239.00	0.99
4	300241	瑞丰光电	994,800	5,670,360.00	0.95
5	002701	奥瑞金	951,400	5,660,830.00	0.95
6	600731	湖南海利	727,100	5,300,559.00	0.89
7	000823	超声电子	446,100	5,286,285.00	0.89
8	688258	卓易信息	106,354	5,150,724.22	0.87
9	300363	博腾股份	298,800	5,103,504.00	0.86
10	600499	科达制造	508,900	4,987,220.00	0.84
11	600166	福田汽车	1,800,800	4,880,168.00	0.82
12	601107	四川成渝	808,300	4,865,966.00	0.82
13	002913	奥士康	160,200	4,711,482.00	0.79
14	002736	国信证券	395,800	4,559,616.00	0.77
15	300369	绿盟科技	583,500	4,533,795.00	0.76
16	600998	九州通	845,007	4,343,335.98	0.73
17	600531	豫光金铅	549,800	4,255,452.00	0.72
18	300232	洲明科技	575,200	4,164,448.00	0.70
19	688334	西高院	235,599	4,047,590.82	0.68
20	600704	物产中大	750,500	3,955,135.00	0.67
21	000987	越秀资本	573,800	3,936,268.00	0.66
22	600020	中原高速	815,100	3,896,178.00	0.66
23	002303	美盈森	1,091,300	3,885,028.00	0.65
24	000783	长江证券	556,800	3,858,624.00	0.65
25	002080	中材科技	196,900	3,839,550.00	0.65
26	000726	鲁 泰 A	604,500	3,832,530.00	0.64
27	600073	光明肉业	511,300	3,773,394.00	0.63
28	300684	中石科技	156,700	3,741,996.00	0.63
29	300259	新天科技	1,049,400	3,725,370.00	0.63

30	300017	网宿科技	333,600	3,576,192.00	0.60
31	300018	中元股份	437,900	3,481,305.00	0.59
32	601208	东材科技	366,900	3,478,212.00	0.58
33	000690	宝新能源	746,300	3,395,665.00	0.57
34	002739	万达电影	296,600	3,390,138.00	0.57
35	002206	海利得	656,800	3,356,248.00	0.56
36	601555	东吴证券	382,000	3,342,500.00	0.56
37	300050	世纪鼎利	568,200	3,255,786.00	0.55
38	603766	隆鑫通用	253,000	3,228,280.00	0.54
39	300079	数码视讯	547,500	3,202,875.00	0.54
40	300279	和晶科技	460,000	3,187,800.00	0.54
41	300196	长海股份	256,500	3,129,300.00	0.53
42	600901	江苏金租	514,233	3,116,251.98	0.52
43	000975	山金国际	164,500	3,115,630.00	0.52
44	002925	盈趣科技	173,100	3,112,338.00	0.52
45	300212	易华录	135,300	2,944,128.00	0.50
46	600176	中国巨石	254,100	2,896,740.00	0.49
47	000728	国元证券	366,000	2,887,740.00	0.49
48	300787	海能实业	207,680	2,876,368.00	0.48
49	600382	广东明珠	512,300	2,792,035.00	0.47
50	600578	京能电力	611,700	2,746,533.00	0.46
51	000906	浙商中拓	424,100	2,701,517.00	0.45
52	600620	天宸股份	469,600	2,564,016.00	0.43
53	600662	外服控股	492,600	2,517,186.00	0.42
54	600873	梅花生物	235,000	2,512,150.00	0.42
55	000988	华工科技	52,600	2,472,726.00	0.42
56	002228	合兴包装	691,200	2,439,936.00	0.41
57	300206	理邦仪器	200,400	2,408,808.00	0.41
58	300105	龙源技术	312,100	2,406,291.00	0.40
59	002056	横店东磁	160,300	2,268,245.00	0.38
60	688313	仕佳光子	56,973	2,167,822.65	0.36
61	605305	中际联合	77,753	2,159,978.34	0.36
62	688711	宏微科技	121,919	2,144,555.21	0.36
63	600183	生益科技	69,000	2,080,350.00	0.35
64	600582	天地科技	346,400	2,074,936.00	0.35
65	688222	成都先导	125,872	2,024,021.76	0.34
66	002299	圣农发展	139,000	1,986,310.00	0.33
67	600517	国网英大	383,700	1,956,870.00	0.33
68	688373	盟科药业	309,850	1,942,759.50	0.33
69	600673	东阳光	166,700	1,938,721.00	0.33
70	600039	四川路桥	193,900	1,919,610.00	0.32
71	600109	国金证券	217,500	1,907,475.00	0.32
72	600919	江苏银行	159,200	1,900,848.00	0.32

73	601319	中国人保	216,900	1,889,199.00	0.32
74	605077	华康股份	115,900	1,875,262.00	0.32
75	000902	新洋丰	135,100	1,868,433.00	0.31
76	601918	新集能源	287,400	1,856,604.00	0.31
77	600782	新钢股份	523,300	1,852,482.00	0.31
78	000404	长虹华意	260,800	1,851,680.00	0.31
79	300777	中简科技	50,600	1,834,250.00	0.31
80	600268	国电南自	232,000	1,814,240.00	0.31
81	600063	皖维高新	393,600	1,802,688.00	0.30
82	601717	郑煤机	105,300	1,750,086.00	0.29
83	002010	传化智联	309,900	1,729,242.00	0.29
84	603098	森特股份	166,800	1,699,692.00	0.29
85	002706	良信股份	189,000	1,683,990.00	0.28
86	601456	国联民生	159,900	1,654,965.00	0.28
87	300168	万达信息	211,800	1,624,506.00	0.27
88	605020	永和股份	70,500	1,624,320.00	0.27
89	002344	海宁皮城	370,100	1,606,234.00	0.27
90	300662	科锐国际	53,900	1,601,369.00	0.27
91	603466	风语筑	157,600	1,590,184.00	0.27
92	603936	博敏电子	168,200	1,586,126.00	0.27
93	002442	龙星科技	242,100	1,544,598.00	0.26
94	000089	深圳机场	218,500	1,507,650.00	0.25
95	688176	亚虹医药	168,800	1,497,256.00	0.25
96	605259	绿田机械	74,900	1,468,789.00	0.25
97	002091	江苏国泰	200,400	1,456,908.00	0.25
98	688668	鼎通科技	22,988	1,435,830.48	0.24
99	600956	新天绿能	183,900	1,419,708.00	0.24
100	301507	民生健康	96,400	1,398,764.00	0.24
101	600261	阳光照明	422,900	1,387,112.00	0.23
102	688079	美迪凯	137,072	1,376,202.88	0.23
103	000030	富奥股份	232,700	1,370,603.00	0.23
104	300496	中科创达	23,800	1,361,836.00	0.23
105	301511	德福科技	63,900	1,322,730.00	0.22
106	600866	星湖科技	189,600	1,310,136.00	0.22
107	601665	齐鲁银行	204,000	1,289,280.00	0.22
108	600583	海油工程	235,000	1,283,100.00	0.22
109	002632	道明光学	135,500	1,260,150.00	0.21
110	600262	北方股份	55,200	1,258,560.00	0.21
111	601828	美凯龙	431,800	1,247,902.00	0.21
112	301282	金禄电子	50,200	1,244,458.00	0.21
113	002384	东山精密	32,900	1,242,633.00	0.21
114	002434	万里扬	169,000	1,238,770.00	0.21
115	600267	海正药业	133,600	1,235,800.00	0.21

116	300978	东箭科技	106,700	1,190,772.00	0.20
117	603659	璞泰来	63,100	1,185,018.00	0.20
118	601369	陕鼓动力	130,700	1,146,239.00	0.19
119	002483	润邦股份	183,300	1,145,625.00	0.19
120	600057	厦门象屿	162,132	1,139,787.96	0.19
121	301080	百普赛斯	15,900	1,137,327.00	0.19
122	002803	吉宏股份	79,100	1,127,966.00	0.19
123	300160	秀强股份	196,700	1,105,454.00	0.19
124	600675	中华企业	383,300	1,103,904.00	0.19
125	000100	TCL 科技	254,800	1,103,284.00	0.19
126	603565	中谷物流	115,200	1,100,160.00	0.19
127	603966	法兰泰克	117,500	1,090,400.00	0.18
128	000686	东北证券	142,000	1,083,460.00	0.18
129	002001	新 和 成	50,800	1,080,516.00	0.18
130	002939	长城证券	128,500	1,076,830.00	0.18
131	600490	鹏欣资源	243,000	1,066,770.00	0.18
132	300510	金冠股份	232,000	1,062,560.00	0.18
133	688425	铁建重工	257,870	1,052,109.60	0.18
134	000729	燕京啤酒	80,300	1,038,279.00	0.17
135	300843	胜蓝股份	32,700	1,036,263.00	0.17
136	600273	嘉化能源	122,300	1,034,658.00	0.17
137	300207	欣旺达	51,400	1,031,084.00	0.17
138	600510	黑牡丹	201,800	1,027,162.00	0.17
139	300081	恒信东方	142,900	1,011,732.00	0.17
140	603969	银龙股份	137,200	1,005,676.00	0.17
141	002367	康力电梯	140,800	989,824.00	0.17
142	002636	金安国纪	102,000	966,960.00	0.16
143	300548	长芯博创	14,100	941,457.00	0.16
144	000776	广发证券	55,900	939,679.00	0.16
145	300737	科顺股份	194,300	936,526.00	0.16
146	603811	诚意药业	100,700	929,461.00	0.16
147	600288	大恒科技	90,000	925,200.00	0.16
148	002539	云图控股	97,900	918,302.00	0.15
149	601568	北元集团	221,100	917,565.00	0.15
150	300088	长信科技	153,700	916,052.00	0.15
151	688499	利元亨	21,622	899,691.42	0.15
152	600219	南山铝业	234,200	896,986.00	0.15
153	688197	首药控股	24,600	890,520.00	0.15
154	603300	海南华铁	79,700	888,655.00	0.15
155	601061	中信金属	112,200	887,502.00	0.15
156	600732	爱旭股份	67,400	882,940.00	0.15
157	603871	嘉友国际	81,680	878,060.00	0.15
158	300825	阿尔特	80,900	874,529.00	0.15

159	002846	英联股份	43,400	866,264.00	0.15
160	300870	欧陆通	6,800	860,200.00	0.14
161	002532	天山铝业	102,600	852,606.00	0.14
162	603619	中曼石油	42,200	846,954.00	0.14
163	301220	亚香股份	18,780	843,222.00	0.14
164	688372	伟测科技	13,800	833,520.00	0.14
165	000936	华西股份	121,100	833,168.00	0.14
166	300308	中际旭创	5,700	831,402.00	0.14
167	002395	双象股份	46,900	830,130.00	0.14
168	688573	信宇人	23,988	829,984.80	0.14
169	603298	杭叉集团	39,500	827,525.00	0.14
170	601595	上海电影	27,900	826,956.00	0.14
171	301323	新莱福	18,600	825,096.00	0.14
172	300850	新强联	22,900	820,278.00	0.14
173	600795	国电电力	169,400	819,896.00	0.14
174	603281	江瀚新材	32,700	819,462.00	0.14
175	000563	陕国投 A	229,200	818,244.00	0.14
176	001206	依依股份	38,900	816,900.00	0.14
177	600060	海信视像	35,400	814,908.00	0.14
178	601975	招商南油	277,400	810,008.00	0.14
179	000989	九芝堂	90,300	809,991.00	0.14
180	688607	康众医疗	43,100	808,125.00	0.14
181	301219	腾远钴业	15,200	807,424.00	0.14
182	688458	美芯晟	17,088	805,870.08	0.14
183	301216	万凯新材	64,600	805,562.00	0.14
184	603102	百合股份	19,100	804,683.00	0.14
185	600536	中国软件	17,200	804,444.00	0.14
186	002182	宝武镁业	65,700	804,168.00	0.14
187	300698	万马科技	17,300	798,914.00	0.13
188	000596	古井贡酒	6,000	798,900.00	0.13
189	603567	珍宝岛	67,800	796,650.00	0.13
190	688526	科前生物	51,045	795,281.10	0.13
191	300725	药石科技	20,500	793,350.00	0.13
192	688303	大全能源	37,166	792,379.12	0.13
193	603799	华友钴业	21,400	792,228.00	0.13
194	688170	德龙激光	31,400	791,280.00	0.13
195	000719	中原传媒	63,700	790,517.00	0.13
196	603286	日盈电子	26,500	789,170.00	0.13
197	603083	剑桥科技	16,600	785,180.00	0.13
198	600367	红星发展	50,000	784,500.00	0.13
199	300750	宁德时代	3,100	781,882.00	0.13
200	688183	生益电子	15,200	778,240.00	0.13
201	603099	长白山	20,400	776,424.00	0.13

202	600169	太原重工	320,800	776,336.00	0.13
203	688722	同益中	36,366	773,504.82	0.13
204	301308	江波龙	8,800	769,912.00	0.13
205	000932	华菱钢铁	174,200	766,480.00	0.13
206	301392	汇成真空	6,400	762,944.00	0.13
207	300140	节能环保	123,000	758,910.00	0.13
208	301260	格力博	38,300	755,276.00	0.13
209	688778	厦钨新能	13,411	749,943.12	0.13
210	688152	麒麟信安	15,900	745,074.00	0.13
211	688300	联瑞新材	16,000	744,800.00	0.13
212	301498	乖宝宠物	6,800	743,716.00	0.13
213	300450	先导智能	29,918	743,462.30	0.13
214	002555	三七互娱	42,900	741,741.00	0.12
215	603776	永安行	36,700	739,505.00	0.12
216	300972	万辰集团	4,100	738,984.00	0.12
217	002738	中矿资源	22,900	736,464.00	0.12
218	002497	雅化集团	64,500	735,300.00	0.12
219	002362	汉王科技	32,700	733,134.00	0.12
220	002661	克明食品	73,200	732,732.00	0.12
221	603500	祥和实业	79,900	731,884.00	0.12
222	688518	联赢激光	35,877	731,532.03	0.12
223	301230	泓博医药	21,200	729,704.00	0.12
224	000408	藏格矿业	17,100	729,657.00	0.12
225	600163	中闽能源	141,800	726,016.00	0.12
226	600483	福能股份	75,200	724,928.00	0.12
227	603444	吉比特	2,400	724,680.00	0.12
228	300457	赢合科技	31,300	719,900.00	0.12
229	600746	江苏索普	91,700	716,177.00	0.12
230	600025	华能水电	74,900	715,295.00	0.12
231	600529	山东药玻	32,300	715,122.00	0.12
232	600900	长江电力	23,500	708,290.00	0.12
233	300119	瑞普生物	36,200	703,004.00	0.12
234	605319	无锡振华	20,500	700,280.00	0.12
235	000403	派林生物	38,600	699,818.00	0.12
236	300539	横河精密	51,100	699,559.00	0.12
237	600640	国脉文化	57,400	695,688.00	0.12
238	601318	XD 中国平	12,500	693,500.00	0.12
239	301367	瑞迈特	8,200	689,620.00	0.12
240	688488	艾迪药业	49,767	689,272.95	0.12
241	603313	梦百合	79,800	678,300.00	0.11
242	603296	华勤技术	8,400	677,712.00	0.11
243	603345	安井食品	8,400	675,528.00	0.11
244	600489	中金黄金	46,100	674,443.00	0.11

245	688199	久日新材	28,320	668,352.00	0.11
246	300257	开山股份	66,300	667,641.00	0.11
247	002249	大洋电机	101,000	664,580.00	0.11
248	603929	亚翔集成	18,800	659,880.00	0.11
249	600739	辽宁成大	59,700	656,700.00	0.11
250	002127	南极电商	165,400	656,638.00	0.11
251	688503	聚和材料	15,840	655,617.60	0.11
252	300767	震安科技	50,000	651,500.00	0.11
253	000050	深天马 A	76,400	650,928.00	0.11
254	603013	亚普股份	37,600	649,728.00	0.11
255	601890	亚星锚链	63,600	648,084.00	0.11
256	002179	中航光电	15,985	645,154.60	0.11
257	300130	新国都	18,000	639,540.00	0.11
258	301165	锐捷网络	10,400	639,184.00	0.11
259	301489	思泉新材	11,060	635,839.40	0.11
260	603086	先达股份	64,800	635,040.00	0.11
261	000768	中航西飞	23,200	634,288.00	0.11
262	300037	新宙邦	18,000	633,600.00	0.11
263	002027	分众传媒	86,400	630,720.00	0.11
264	300633	开立医疗	21,200	630,064.00	0.11
265	688333	铂力特	10,560	628,953.60	0.11
266	603267	鸿远电子	12,500	628,375.00	0.11
267	300859	西域旅游	15,600	628,212.00	0.11
268	300769	德方纳米	19,000	627,380.00	0.11
269	603725	天安新材	72,800	626,080.00	0.11
270	600909	XD 华安证	107,200	624,976.00	0.11
271	000899	赣能股份	72,000	621,360.00	0.10
272	301038	深水规院	37,200	621,240.00	0.10
273	600987	航民股份	87,600	619,332.00	0.10
274	600170	上海建工	258,400	617,576.00	0.10
275	600570	恒生电子	18,400	617,136.00	0.10
276	300085	银之杰	14,000	616,840.00	0.10
277	605598	上海港湾	28,800	615,456.00	0.10
278	605118	力鼎光电	24,600	610,818.00	0.10
279	300219	鸿利智汇	90,000	604,800.00	0.10
280	600547	山东黄金	18,700	597,091.00	0.10
281	603095	越剑智能	36,140	593,780.20	0.10
282	000421	南京公用	89,700	589,329.00	0.10
283	300994	久祺股份	36,600	572,424.00	0.10
284	600961	株冶集团	50,800	567,944.00	0.10
285	600067	冠城新材	188,800	562,624.00	0.09
286	603328	依顿电子	56,700	556,227.00	0.09
287	688055	龙腾光电	150,072	555,266.40	0.09

288	300048	合康新能	94,300	553,541.00	0.09
289	603113	金能科技	79,100	548,163.00	0.09
290	603109	神驰机电	19,600	547,624.00	0.09
291	300041	回天新材	58,100	547,302.00	0.09
292	300731	科创新源	18,100	546,077.00	0.09
293	603270	金帝股份	20,900	536,921.00	0.09
294	600226	亨通股份	191,600	534,564.00	0.09
295	601138	工业富联	24,800	530,224.00	0.09
296	600160	巨化股份	17,900	513,372.00	0.09
297	002454	松芝股份	65,800	507,976.00	0.09
298	301526	国际复材	137,600	500,864.00	0.08
299	600880	博瑞传播	93,600	500,760.00	0.08
300	600084	中信尼雅	88,600	492,616.00	0.08
301	601003	柳钢股份	138,900	488,928.00	0.08
302	688519	南亚新材	10,900	488,320.00	0.08
303	000027	深圳能源	75,700	482,966.00	0.08
304	600237	铜峰电子	66,200	479,950.00	0.08
305	301028	东亚机械	38,600	474,394.00	0.08
306	603063	禾望电气	14,000	474,040.00	0.08
307	000819	岳阳兴长	30,100	471,065.00	0.08
308	300435	中泰股份	30,900	469,062.00	0.08
309	600011	华能国际	64,800	462,672.00	0.08
310	600098	广州发展	73,600	460,000.00	0.08
311	002755	奥赛康	28,200	450,636.00	0.08
312	301120	新特电气	44,000	450,560.00	0.08
313	000828	东莞控股	42,000	448,980.00	0.08
314	603499	翔港科技	27,200	448,528.00	0.08
315	002683	广东宏大	13,100	444,614.00	0.07
316	600926	杭州银行	26,400	444,048.00	0.07
317	603379	三美股份	9,100	437,892.00	0.07
318	600728	佳都科技	80,300	437,635.00	0.07
319	300222	科大智能	42,500	433,075.00	0.07
320	301270	汉仪股份	9,000	428,940.00	0.07
321	603689	皖天然气	50,140	422,178.80	0.07
322	600036	招商银行	9,100	418,145.00	0.07
323	600710	苏美达	43,200	415,152.00	0.07
324	688009	中国通号	80,214	412,299.96	0.07
325	601998	中信银行	48,000	408,000.00	0.07
326	688602	康鹏科技	48,400	405,592.00	0.07
327	002350	北京科锐	58,500	401,310.00	0.07
328	300244	迪安诊断	26,700	397,830.00	0.07
329	603380	易德龙	14,600	388,360.00	0.07
330	300347	泰格医药	7,200	383,904.00	0.06

331	600685	中船防务	13,900	377,941.00	0.06
332	300499	高澜股份	21,200	377,360.00	0.06
333	300648	星云股份	10,900	376,704.00	0.06
334	300755	华致酒行	19,500	376,350.00	0.06
335	002603	以岭药业	26,500	373,650.00	0.06
336	002666	德联集团	72,300	368,007.00	0.06
337	002626	金达威	17,500	358,050.00	0.06
338	002155	湖南黄金	20,000	357,000.00	0.06
339	600335	国机汽车	54,700	352,815.00	0.06
340	300649	杭州园林	18,400	351,440.00	0.06
341	000831	中国稀土	9,700	350,364.00	0.06
342	603408	建霖家居	31,000	340,070.00	0.06
343	603386	骏亚科技	26,700	337,755.00	0.06
344	002637	赞宇科技	33,800	337,324.00	0.06
345	301183	东田微	6,500	332,995.00	0.06
346	603588	高能环境	58,500	329,940.00	0.06
347	600475	华光环能	31,400	327,188.00	0.06
348	601002	晋亿实业	65,100	320,943.00	0.05
349	002452	长高电新	45,500	316,225.00	0.05
350	601288	农业银行	53,500	314,580.00	0.05
351	603788	宁波高发	19,800	314,226.00	0.05
352	300871	回盛生物	15,000	313,500.00	0.05
353	002019	亿帆医药	24,100	313,059.00	0.05
354	603665	康隆达	12,400	307,272.00	0.05
355	600674	川投能源	19,100	306,364.00	0.05
356	600315	上海家化	14,500	305,515.00	0.05
357	601609	金田股份	43,300	303,533.00	0.05
358	603486	科沃斯	5,200	302,796.00	0.05
359	000935	四川双马	16,500	300,630.00	0.05
360	300138	晨光生物	24,400	295,728.00	0.05
361	300980	祥源新材	12,600	295,092.00	0.05
362	300553	集智股份	7,030	291,252.90	0.05
363	601601	中国太保	7,700	288,827.00	0.05
364	603477	巨星农牧	13,600	279,888.00	0.05
365	605080	浙江自然	10,000	278,000.00	0.05
366	600429	三元股份	60,900	274,659.00	0.05
367	603527	众源新材	25,200	273,924.00	0.05
368	601211	国泰海通	14,200	272,072.00	0.05
369	601083	锦江航运	24,400	271,084.00	0.05
370	688177	百奥泰	10,800	270,648.00	0.05
371	601958	金钼股份	24,500	268,030.00	0.05
372	603103	横店影视	16,600	266,430.00	0.04
373	300395	菲利华	5,200	265,720.00	0.04

374	002585	双星新材	48,600	265,356.00	0.04
375	002517	恺英网络	13,600	262,616.00	0.04
376	603699	纽威股份	8,300	258,711.00	0.04
377	688322	奥比中光	4,323	255,100.23	0.04
378	002142	宁波银行	9,300	254,448.00	0.04
379	002414	高德红外	24,800	254,200.00	0.04
380	300187	永清环保	49,300	251,430.00	0.04
381	600012	皖通高速	14,800	251,304.00	0.04
382	603228	景旺电子	6,000	251,040.00	0.04
383	601899	紫金矿业	12,800	249,600.00	0.04
384	002375	亚厦股份	64,600	248,710.00	0.04
385	600428	中远海特	39,500	246,875.00	0.04
386	605196	华通线缆	13,900	244,779.00	0.04
387	688257	新锐股份	16,384	240,025.60	0.04
388	300197	节能铁汉	114,400	239,096.00	0.04
389	301128	强瑞技术	4,680	237,837.60	0.04
390	601801	皖新传媒	34,700	237,001.00	0.04
391	002328	新朋股份	40,200	233,964.00	0.04
392	002659	凯文教育	45,700	230,328.00	0.04
393	001914	招商积余	18,600	230,082.00	0.04
394	300573	兴齐眼药	4,400	227,876.00	0.04
395	600035	楚天高速	53,200	225,568.00	0.04
396	002153	石基信息	25,800	223,428.00	0.04
397	300247	融捷健康	56,200	219,180.00	0.04
398	600988	赤峰黄金	8,800	218,944.00	0.04
399	600299	安迪苏	22,200	214,230.00	0.04
400	002284	亚太股份	19,300	213,265.00	0.04
401	600757	长江传媒	22,900	212,512.00	0.04
402	600933	爱柯迪	13,200	211,332.00	0.04
403	601989	中国重工	45,300	210,192.00	0.04
404	301286	侨源股份	8,400	209,916.00	0.04
405	603225	新凤鸣	19,400	206,610.00	0.03
406	300479	神思电子	9,300	205,251.00	0.03
407	300416	苏试试验	14,200	203,486.00	0.03
408	688048	长光华芯	3,500	202,090.00	0.03
409	301029	怡合达	8,800	201,168.00	0.03
410	300306	远方信息	15,200	196,384.00	0.03
411	002293	罗莱生活	21,800	190,532.00	0.03
412	600771	广誉远	9,400	189,504.00	0.03
413	603612	索通发展	10,300	189,314.00	0.03
414	002500	山西证券	32,400	189,216.00	0.03
415	600867	通化东宝	22,900	187,780.00	0.03
416	600875	东方电气	11,200	187,488.00	0.03

417	688062	迈威生物	6,522	184,442.16	0.03
418	002107	沃华医药	32,100	183,612.00	0.03
419	002373	千方科技	19,700	183,210.00	0.03
420	301275	汉朔科技	3,135	182,539.65	0.03
421	301365	矩阵股份	10,600	181,684.00	0.03
422	300984	金沃股份	3,160	180,910.00	0.03
423	601886	江河集团	29,200	179,580.00	0.03
424	600621	华鑫股份	11,700	179,127.00	0.03
425	002345	潮宏基	12,100	177,023.00	0.03
426	600819	耀皮玻璃	29,900	174,018.00	0.03
427	688122	西部超导	3,336	173,071.68	0.03
428	688719	爱科赛博	4,058	172,465.00	0.03
429	002727	一心堂	10,500	171,570.00	0.03
430	600714	金瑞矿业	14,000	171,220.00	0.03
431	600623	华谊集团	22,500	170,325.00	0.03
432	688205	德科立	2,713	170,077.97	0.03
433	002938	鹏鼎控股	5,300	169,759.00	0.03
434	688203	海正生材	13,390	169,517.40	0.03
435	605589	圣泉集团	6,100	169,275.00	0.03
436	002487	大金重工	5,100	167,790.00	0.03
437	601933	永辉超市	34,200	167,580.00	0.03
438	688208	道通科技	5,461	167,106.60	0.03
439	300926	博俊科技	6,300	166,761.00	0.03
440	300733	西菱动力	9,400	166,662.00	0.03
441	688658	悦康药业	8,740	166,409.60	0.03
442	600026	中远海能	15,900	164,247.00	0.03
443	000928	中钢国际	26,100	163,908.00	0.03
444	000657	中钨高新	13,700	162,482.00	0.03
445	301210	金杨股份	3,900	162,006.00	0.03
446	603309	维力医疗	12,730	161,925.60	0.03
447	000959	首钢股份	47,600	161,840.00	0.03
448	300829	金丹科技	9,200	159,896.00	0.03
449	688070	纵横股份	3,300	159,390.00	0.03
450	000708	中信特钢	13,400	157,584.00	0.03
451	600363	联创光电	2,700	157,491.00	0.03
452	002286	保龄宝	13,700	155,221.00	0.03
453	600817	宇通重工	12,800	151,552.00	0.03
454	600031	三一重工	8,400	150,780.00	0.03
455	600548	深高速	14,100	147,627.00	0.02
456	688202	美迪西	4,100	147,313.00	0.02
457	600066	宇通客车	5,900	146,674.00	0.02
458	688158	优刻得	6,434	145,537.08	0.02
459	605088	冠盛股份	3,800	144,096.00	0.02

460	002741	光华科技	6,800	143,344.00	0.02
461	000733	振华科技	2,800	140,140.00	0.02
462	301101	明月镜片	2,800	137,060.00	0.02
463	300624	万兴科技	2,200	136,510.00	0.02
464	002649	博彦科技	9,300	135,129.00	0.02
465	600419	天润乳业	13,600	134,368.00	0.02
466	000598	兴蓉环境	18,600	134,106.00	0.02
467	600337	美克家居	60,600	133,926.00	0.02
468	300286	安科瑞	5,900	133,163.00	0.02
469	300238	冠昊生物	8,200	133,086.00	0.02
470	601066	中信建投	5,500	132,275.00	0.02
471	601117	中国化学	17,200	131,924.00	0.02
472	688636	智明达	3,870	130,767.30	0.02
473	000967	盈峰环境	18,600	129,270.00	0.02
474	601229	上海银行	12,000	127,320.00	0.02
475	688049	炬芯科技	2,095	126,747.50	0.02
476	601168	西部矿业	7,600	126,388.00	0.02
477	003000	劲仔食品	9,500	125,685.00	0.02
478	300231	银信科技	10,200	125,562.00	0.02
479	002039	黔源电力	7,900	125,452.00	0.02
480	600496	精工钢构	38,600	123,520.00	0.02
481	603085	天成自控	10,700	123,157.00	0.02
482	688512	慧智微	11,200	122,192.00	0.02
483	600469	风神股份	21,600	122,040.00	0.02
484	688195	腾景科技	2,700	121,500.00	0.02
485	605580	恒盛能源	8,900	120,951.00	0.02
486	601901	方正证券	14,900	117,859.00	0.02
487	688133	泰坦科技	5,060	116,481.20	0.02
488	002959	小熊电器	2,500	116,100.00	0.02
489	002793	罗欣药业	25,000	116,000.00	0.02
490	002170	芭田股份	11,300	115,825.00	0.02
491	600064	南京高科	15,000	115,650.00	0.02
492	300620	光库科技	2,400	113,064.00	0.02
493	002516	旷达科技	21,100	108,665.00	0.02
494	600968	海油发展	26,600	108,528.00	0.02
495	600681	百川能源	30,800	108,108.00	0.02
496	300418	昆仑万维	3,200	107,616.00	0.02
497	300011	鼎汉技术	14,200	106,074.00	0.02
498	300570	太辰光	1,100	106,018.00	0.02
499	300611	美力科技	4,500	104,805.00	0.02
500	000425	徐工机械	13,400	104,118.00	0.02
501	600773	XD 西藏城	10,300	103,618.00	0.02
502	000061	农 产 品	15,900	101,601.00	0.02

503	000725	京东方 A	25,400	101,346.00	0.02
504	601688	华泰证券	5,600	99,736.00	0.02
505	600350	山东高速	9,100	97,006.00	0.02
506	300768	迪普科技	5,600	96,040.00	0.02
507	600488	津药药业	22,700	94,659.00	0.02
508	600352	浙江龙盛	9,000	91,440.00	0.02
509	301200	大族数控	2,100	89,187.00	0.01
510	300317	珈伟新能	20,800	86,112.00	0.01
511	300291	百纳千成	14,500	82,795.00	0.01
512	000001	平安银行	6,700	80,869.00	0.01
513	000672	上峰水泥	10,200	80,580.00	0.01
514	002815	崇达技术	7,100	80,443.00	0.01
515	600391	航发科技	2,700	78,840.00	0.01
516	000531	穗恒运 A	12,700	78,105.00	0.01
517	600246	万通发展	12,700	77,597.00	0.01
518	605050	福然德	5,600	77,000.00	0.01
519	601225	陕西煤业	3,900	75,036.00	0.01
520	603456	九洲药业	4,900	74,529.00	0.01
521	601096	宏盛华源	18,000	74,520.00	0.01
521	688371	菲沃泰	4,500	74,520.00	0.01
522	688496	清越科技	7,924	73,693.20	0.01
523	600338	西藏珠峰	6,400	70,976.00	0.01
524	001389	广合科技	1,200	70,524.00	0.01
525	002545	东方铁塔	7,800	69,342.00	0.01
526	301510	固高科技	2,300	69,115.00	0.01
527	002020	京新药业	5,200	67,860.00	0.01
528	300476	胜宏科技	500	67,190.00	0.01
529	600184	光电股份	3,800	66,728.00	0.01
530	300702	天宇股份	2,800	65,128.00	0.01
531	300655	晶瑞电材	6,400	64,064.00	0.01
532	601577	长沙银行	6,300	62,622.00	0.01
533	603529	爱玛科技	1,800	61,920.00	0.01
534	688787	海天瑞声	566	60,097.88	0.01
535	301339	通行宝	3,500	59,955.00	0.01
536	300014	亿纬锂能	1,300	59,553.00	0.01
537	600716	凤凰股份	15,700	58,090.00	0.01
538	300445	康斯特	3,400	57,970.00	0.01
539	600928	西安银行	14,500	56,840.00	0.01
540	600637	东方明珠	7,600	56,772.00	0.01
541	002463	沪电股份	1,300	55,354.00	0.01
542	300019	硅宝科技	2,800	55,272.00	0.01
543	688472	阿特斯	5,970	54,625.50	0.01
544	000166	申万宏源	10,700	53,714.00	0.01

545	603230	内蒙新华	4,100	52,931.00	0.01
546	600298	安琪酵母	1,500	52,755.00	0.01
547	603885	吉祥航空	3,900	52,533.00	0.01
548	002060	广东建工	15,000	52,200.00	0.01
549	601328	交通银行	6,400	51,200.00	0.01
550	300879	大叶股份	1,300	51,064.00	0.01
551	688552	航天南湖	1,260	50,286.60	0.01
552	600004	白云机场	5,500	50,050.00	0.01
553	601628	中国人寿	1,200	49,428.00	0.01
554	002318	久立特材	2,000	46,780.00	0.01
555	688411	海博思创	560	46,754.40	0.01
556	000913	钱江摩托	3,100	46,500.00	0.01
557	002478	常宝股份	8,800	46,200.00	0.01
558	300111	向日葵	14,000	45,920.00	0.01
559	688221	前沿生物	4,480	44,979.20	0.01
560	002267	陕天然气	5,800	43,906.00	0.01
561	600027	华电国际	8,000	43,760.00	0.01
562	002405	四维图新	5,000	42,700.00	0.01
563	600348	华阳股份	6,400	42,624.00	0.01
564	002445	中南文化	16,700	42,585.00	0.01
565	688775	影石创新	340	42,214.40	0.01
566	600188	兖矿能源	3,300	40,161.00	0.01
567	688629	华丰科技	700	40,040.00	0.01
568	603889	新澳股份	6,500	37,700.00	0.01
569	000688	国城矿业	2,800	37,268.00	0.01
570	600143	金发科技	3,600	37,116.00	0.01
571	600233	圆通速递	2,800	36,092.00	0.01
572	000042	中洲控股	5,000	35,550.00	0.01
573	002258	利尔化学	3,200	35,328.00	0.01
574	300752	隆利科技	1,500	33,720.00	0.01
575	603697	有友食品	2,500	32,975.00	0.01
576	000750	国海证券	8,000	32,960.00	0.01
577	000791	甘肃能源	5,100	32,538.00	0.01
578	688141	杰华特	960	31,276.80	0.01
579	600983	惠而浦	2,900	30,102.00	0.01
580	300133	华策影视	3,900	29,289.00	0.00
581	688716	中研股份	800	28,480.00	0.00
582	300781	因赛集团	500	27,060.00	0.00
583	300772	运达股份	2,100	27,048.00	0.00
584	688545	兴福电子	994	26,788.30	0.00
585	688112	鼎阳科技	721	26,655.37	0.00
586	002324	普利特	2,500	26,575.00	0.00
587	600030	中信证券	900	24,858.00	0.00

588	000551	创元科技	1,900	24,415.00	0.00
589	601579	会稽山	1,200	23,892.00	0.00
590	600115	中国东航	5,800	23,374.00	0.00
591	300249	依米康	1,700	23,188.00	0.00
592	688117	圣诺生物	640	21,536.00	0.00
593	688280	精进电动	2,880	20,937.60	0.00
594	603197	保隆科技	500	19,535.00	0.00
595	600305	恒顺醋业	2,500	19,325.00	0.00
596	688302	海创药业	400	18,720.00	0.00
597	301277	新天地	1,292	18,566.04	0.00
598	688583	思看科技	227	18,087.36	0.00
599	301678	新恒汇	382	17,014.28	0.00
600	301602	超研股份	658	16,318.40	0.00
601	001388	C 信通电子	937	15,385.54	0.00
602	300375	鹏翎股份	3,000	15,330.00	0.00
603	301501	恒鑫生活	325	14,696.50	0.00
604	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
605	688757	XD 胜科纳	536	13,903.84	0.00
606	688182	灿勤科技	500	13,780.00	0.00
607	688758	赛分科技	777	13,185.69	0.00
608	600061	国投资本	1,700	12,784.00	0.00
609	300905	宝丽迪	400	12,780.00	0.00
610	300146	汤臣倍健	1,100	12,364.00	0.00
611	603072	天和磁材	226	12,305.70	0.00
612	301662	宏工科技	143	11,797.50	0.00
613	300558	贝达药业	200	11,590.00	0.00
614	301601	惠通科技	342	11,576.70	0.00
615	601311	骆驼股份	1,200	10,836.00	0.00
616	001356	富岭股份	709	10,237.96	0.00
617	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
618	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
619	002073	软控股份	1,000	8,890.00	0.00
620	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
621	688321	微芯生物	350	8,323.00	0.00
622	603049	中策橡胶	189	8,098.65	0.00
623	688755	汉邦科技	203	7,983.99	0.00
624	301173	毓恬冠佳	173	7,781.54	0.00
625	603071	物产环能	600	7,638.00	0.00
626	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
627	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
628	688509	正元地信	1,514	6,495.06	0.00
629	001359	平安电工	184	6,417.92	0.00
630	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00

631	603202	天有为	63	5,711.58	0.00
632	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
633	600380	健康元	500	5,515.00	0.00
634	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
635	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
636	603271	永杰新材	126	4,420.08	0.00
637	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
638	601838	成都银行	200	4,020.00	0.00
639	001395	亚联机械	80	3,780.00	0.00
640	603409	XD 汇通控	100	3,332.00	0.00
641	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
642	603257	中国瑞林	78	2,922.66	0.00
643	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
644	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
645	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
646	603120	肯特催化	65	2,172.95	0.00
647	300632	光莆股份	100	1,335.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002335	科华数据	12,627,227.00	3.54
2	002624	完美世界	10,461,271.00	2.93
3	300279	和晶科技	10,086,449.00	2.82
4	300972	万辰集团	8,667,489.56	2.43
5	000893	亚钾国际	8,537,321.00	2.39
6	000938	紫光股份	8,154,025.00	2.28
7	002170	芭田股份	7,919,762.00	2.22
8	600073	光明肉业	7,259,181.00	2.03
9	002080	中材科技	7,241,830.50	2.03
10	688258	卓易信息	7,113,657.03	1.99
11	300638	广和通	6,886,956.60	1.93
12	300369	绿盟科技	6,718,200.00	1.88
13	000792	盐湖股份	6,359,389.00	1.78
14	688289	圣湘生物	6,283,455.79	1.76
15	600499	科达制造	6,258,760.00	1.75
16	002851	麦格米特	6,219,834.00	1.74
17	000553	安道麦 A	6,181,247.00	1.73
18	600166	福田汽车	6,142,989.00	1.72
19	300400	劲拓股份	6,057,562.00	1.70
20	002701	奥瑞金	6,020,902.48	1.69

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002335	科华数据	14,674,003.00	4.11
2	000893	亚钾国际	10,342,110.00	2.90
3	000938	紫光股份	8,237,023.80	2.31
4	300972	万辰集团	7,930,418.00	2.22
5	002170	芭田股份	7,815,538.00	2.19
6	002851	麦格米特	7,493,188.00	2.10
7	300279	和晶科技	7,343,624.00	2.06
8	300638	广和通	7,302,690.40	2.05
9	002624	完美世界	6,892,634.00	1.93
10	000792	盐湖股份	6,394,347.00	1.79
11	000600	建投能源	6,186,557.00	1.73
12	300251	光线传媒	6,135,135.00	1.72
13	688289	圣湘生物	6,117,861.26	1.71
14	002345	潮宏基	6,076,899.00	1.70
15	300624	万兴科技	6,073,298.00	1.70
16	600050	中国联通	5,865,069.00	1.64
17	300752	隆利科技	5,859,152.00	1.64
18	301210	金杨股份	5,846,727.00	1.64
19	603918	金桥信息	5,758,522.00	1.61
20	300723	一品红	5,685,439.00	1.59

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,586,108,280.79
卖出股票收入（成交）总额	2,428,372,973.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	1,732,587.84	0.29
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	1,732,587.84	0.29

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	1,732,587.84	0.29

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.11.2 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5,333,158.55
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	15,167,443.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,500,601.64

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中欧数据挖掘混合 A	18,673	8,771.34	86,704,313.80	52.94%	77,083,004.71	47.06%
中欧数据挖掘混合 C	28,431	5,707.28	126,319,340.70	77.85%	35,944,313.72	22.15%
合计	47,104	6,921.94	213,023,654.50	65.33%	113,027,318.43	34.67%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管	中欧数据挖掘混合 A	1,559,281.34	0.95%

理人所有从业人员持有本基金	中欧数据挖掘混合 C	8,901.82	0.01%
	合计	1,568,183.16	0.48%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中欧数据挖掘混合 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 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	148,884,540.64	69,895,138.86
本报告期基金总申购份额	57,906,017.78	120,413,216.92
减：本报告期基金总赎回份额	43,003,239.91	28,044,701.36
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	163,787,318.51	162,263,654.42

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

10.2.1 基金管理人的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

10.2.2 基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生重大改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-06-10
采取稽查或处罚等措施的机构	上海监管局
受到的具体措施类型	警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	公司部分业务内控管理不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	监管局现场检查结束后，公司即成立整改小组，制定整改措施包括制度修订、人员培训宣导和强化内部检查等。针对涉及的问题，公司已按要求及时完成整改，并将整改报告报至上海监管局。
其他	无

10.6.2 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
民生证券	2	842,420,336	16.81	367,270.28	16.81	-

		. 29				
申万宏源 证券	1	717, 778, 367 . 39	14. 32	312, 883. 05	14. 32	—
国海证券	1	565, 844, 904 . 50	11. 29	246, 685. 72	11. 29	—
国盛证券	1	402, 102, 381 . 79	8. 02	175, 282. 48	8. 02	—
华福证券	1	385, 846, 867 . 64	7. 70	168, 256. 48	7. 70	—
兴业证券	1	234, 988, 458 . 98	4. 69	102, 464. 52	4. 69	—
东方财富	1	230, 989, 293 . 75	4. 61	100, 689. 69	4. 61	—
浙商证券	1	208, 987, 799 . 70	4. 17	91, 133. 18	4. 17	—
东方证券	1	196, 432, 995 . 54	3. 92	85, 643. 16	3. 92	—
国都证券	2	182, 480, 277 . 77	3. 64	79, 560. 26	3. 64	—
中泰证券	2	167, 543, 037 . 54	3. 34	73, 036. 04	3. 34	—
东吴证券	1	132, 291, 985 . 21	2. 64	57, 667. 21	2. 64	—
财通证券	1	131, 404, 137 . 41	2. 62	57, 294. 91	2. 62	—
天风证券	1	129, 990, 924 . 27	2. 59	56, 693. 61	2. 59	—
长江证券	1	108, 972, 688 . 39	2. 17	47, 500. 06	2. 17	—
国联民生	1	84, 525, 879. 42	1. 69	36, 845. 54	1. 69	本 报 告 期 新 增 1 个
中信证券	2	81, 073, 615. 05	1. 62	35, 343. 08	1. 62	—
中信建投	1	73, 632, 821. 09	1. 47	32, 097. 80	1. 47	—
国金证券	1	55, 720, 056. 60	1. 11	24, 288. 75	1. 11	—
西部证券	1	27, 365, 424. 78	0. 55	11, 933. 61	0. 55	—
广发证券	1	24, 595, 856. 65	0. 49	10, 725. 35	0. 49	—
西南证券	1	18, 080, 192.	0. 36	7, 881. 61	0. 36	—

		90				
国泰海通	2	9,661,826.00	0.19	4,211.12	0.19	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个
华源证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	本报告期新增 1 个

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。

3、本报告期内，国泰君安证券变更为国泰海通证券，海通证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	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 (%)
民生证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国联民生	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-

德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
国信证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
华源证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-

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。

3、本报告期内，国泰君安证券变更为国泰海通证券，海通证券变更为国泰海通证券，国联证券变更为国联民生证券。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-01-18

2	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 4 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
3	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第四季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-01-22
4	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-02-22
5	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年年度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
6	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会指定媒介	2025-03-29
7	中欧基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度下半年）	中国证监会指定媒介	2025-03-31
8	中欧基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第一季度报告的提示性公告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
9	中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒介	2025-04-22
10	中欧基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-03
11	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	2025-06-03
12	中欧基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理本公司旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2025-06-09

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 05 月 21 日至	26,800,392.88	17,331,187.83	0.00	44,131,580.71	13.54 %

		2025 年 05 月 22 日					
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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、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

12.2 存放地点

基金管理人的办公场所。

12.3 查阅方式

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

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 8 月 30 日