中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年06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:2018年08月28日

§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。本半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2018年8月27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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至2018年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中欧数据挖掘混合	
基金主代码	001990	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2016年01月13日	
基金管理人	中欧基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	142,111,140.03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	101,242,956.94份	40,868,183.09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	沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金,其预期收益和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	010-66105798
	电子邮箱	liyihai@zofund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-68609700,400-700-9700	95588
传真		021-33830351	010-66105799

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.zofund.com
基金半年度报告备置地点	中国(上海)自由贸易试验区陆家嘴环路333号五层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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(2018年01月01日-2018年06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	-2,409,302.85	-1,720,291.69
本期利润	-6,278,579.49	-3,192,306.66
加权平均基金份额本期利润	-0.0566	-0.3018
本期基金份额净值增长率	-6.77%	-6.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.0606	-0.0699
期末基金资产净值	95,102,718.84	38,010,404.98
期末基金份额净值	0.9394	0.9301

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中欧数据挖掘混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.44%	1.70%	-4.50%	0.77%	-2.94%	0.93%
过去三个月	-9.53%	1.32%	-5.62%	0.68%	-3.91%	0.64%
过去六个月	-6.77%	1.44%	-6.98%	0.69%	0.21%	0.75%
过去一年	-4.22%	1.20%	-1.98%	0.57%	-2.24%	0.63%
自基金合同生效起至今	2.06%	1.00%	4.84%	0.60%	-2.78%	0.40%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%。比较基准每个交易日进行一次再平衡,每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡,使大类资产比例保持恒定。

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	-7.54%	1.70%	-4.50%	0.77%	-3.04%	0.93%
过去三个月	-9.73%	1.32%	-5.62%	0.68%	-4.11%	0.64%
过去六个月	-6.88%	1.44%	-6.98%	0.69%	0.10%	0.75%
过去一年	-4.72%	1.20%	-1.98%	0.57%	-2.74%	0.63%
自基金份额运作日至今	-5.57%	1.05%	3.18%	0.51%	-8.75%	0.54%

注:本基金业绩比较基准为:沪深300指数收益率*60%+中债综合指数收益率*40%。比较基准每个交易日进行一次再平衡,每个交易日在加入损益后根据设定的权重比例进行大类资产之间的再平衡,使大类资产比例保持恒定。

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

注: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2018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。股东为意大利意联银行股份合作公司、国都证券股份有限公司、北京百骏投资有限公司、上海睦亿投资管理合伙企业(有限合伙)、万盛基业投资有限责任公司以及自然人股东,注册资本为1.88亿元人民币,旗下设有北京分公司、中欧盛世资产管理(上海)有限公司、中欧钱滚滚基金销售(上海)有限公司。截至2018年6月30日,本基金管理人共管理73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		
曲径	策略组负责人、基金经理	2016-01-13	-	11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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

回顾2018上半年,A股市场经历了年初蓝筹带动的短暂行情后,进入了持续调整。海外贸易摩擦产生的不确定性,叠加去杠杆大环境下国内经济动能的疑虑,使得资本市场对于后市保有谨慎情绪;而近期推出的以扶贫乡村振兴为抓手的基建托底,配合去杠杆和扩大对外开放等长期改革的组合政策,指明后期投资方向,在下半年宽货币宽信用的预期下,我们认为权益市场应比上半年较为乐观。中欧数据挖掘为量化投资基金。量化投资最大的优点是投资的理性化。通过数据印证的投资逻辑,可以有效避免传统投资的持有型心理偏差,在投资过程中对于投资组合的风险控制更加客观,从而使得基金收益Alpha更为稳定。自2018年1月起,本基金在行业配置上,参考了中证500的行业配置。当前中证500成分股中,第一大行业为医药生物占比超过10%,此外计算机、电子、基建相关的行业,占比均超过5%,均为兼顾成长和防御的行业,也是我们较为看好的板块。在实际操作中,我们在上述行业观点的配置下,采用量化模型精选个股。个股精选以跑赢行业指数为目标。力争在行业配置和个股选择两个维度上,叠加回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,A类份额净值收益率为-6.77%,同期业绩比较基准收益率为-6.98%;C类份额净值增长率为-6.88%,同期业绩比较基准收益率为-6.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前,我们维持年初的判断,即2016年底为始的蓝筹行情已经告一段落,即便经过上半年的调整,估值仍不便宜,部分蓝筹的估值依然高于历史中枢,再叠加零售消费增速的回落,我们认为下半年机会较弱;同时,在房地产维持严调控的环境下,地产后周期产品增速也难为继。另一方面,以智能制造,计算机,5G通信和优质医药股为代表的成长股,经过一年多的调整,在盈利维持较高增速的情况下进入了估值合理的区间;同时在下半年宽货币宽信用的预期下,托底基建的上下游也可能产生投资机会。基金整体维持以中证500为锚定的行业配置,在上述较为看好行业上,如计算机,智能制造等有关行业,进行高配。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内,本基金管理人严格按照本公司制订的《估值委员会议事规则》以及相关法律法规的规定,有效地控制基金估值流程。公司估值委员会主席为公司分管运营副总经理,成员包括总经理、督察长、投资总监、基金运营部总监、监察稽核部总监以及基金核算、金融工程、行业研究等方面的骨干。估值委员会负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督,确保基金估值的公允、合理,防止估值被歪曲进而对基金持有人产生不利影响。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况,可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中欧基金管理有限公司编制和披露的中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金2018年半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 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:2018年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:		
银行存款	7,809,153.41	9,239,756.95
结算备付金	1,350,284.25	2,364,446.57
存出保证金	293,417.19	507,276.84
交易性金融资产	124,378,413.04	123,728,359.35
其中:股票投资	124,378,413.04	123,728,359.35
基金投资	-	-
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	-	-
应收证券清算款	1,332,091.85	298,172.43
应收利息	2,356.72	3,190.03
应收股利	-	-
应收申购款	14,343.47	13,636.87
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	135,180,059.93	136,154,839.04
负债和所有者权益	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	-	-
应付证券清算款	852,355.46	203,307.21
应付赎回款	9,161.88	316,184.37
应付管理人报酬	166,765.41	172,046.85
应付托管费	27,794.23	28,674.49
应付销售服务费	22,260.68	348.44
应付交易费用	714,952.83	828,336.49
应交税费	-	-
应付利息	-	-
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	273,645.62	340,594.56
负债合计	2,066,936.11	1,889,492.41
所有者权益:		
实收基金	142,111,140.03	133,261,974.09
未分配利润	-8,998,016.21	1,003,372.54
所有者权益合计	133,113,123.82	134,265,346.63
负债和所有者权益总计	135,180,059.93	136,154,839.04

注:报告截止日2018年6月30日,中欧数据挖掘A类基金份额净值0.9394元,基金份额101,242,956.94份;中欧数据挖掘C类基金份额净值0.9301元,基金份额40,868,183.09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:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
一、收入	-6,299,568.66	-3,139,400.11
1.利息收入	42,067.40	2,152,158.92
其中:存款利息收入	42,067.40	208,400.78
债券利息收入	-	19.33
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	-	1,943,738.81
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	-1,064,884.71	-17,231,498.78
其中:股票投资收益	-1,897,388.97	-17,944,924.84
基金投资收益	-	-
债券投资收益	-	7,565.77
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-71,388.35	-950,796.42
股利收益	903,892.61	1,656,656.71
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-5,341,291.61	11,431,116.01
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	64,540.26	508,823.74
减:二、费用	3,171,317.49	6,980,405.92
1. 管理人报酬	908,327.10	2,732,641.71
2. 托管费	151,387.87	455,440.30
3. 销售服务费	40,166.43	1,552.41
4. 交易费用	1,938,246.18	3,621,057.71
5. 利息支出	-	-
其中:卖出回购金融资产支出	-	-
6. 税金及附加	49.00	-
7. 其他费用	133,140.91	169,713.79
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	-9,470,886.15	-10,119,806.03
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	-9,470,886.15	-10,119,806.03

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中欧数据挖掘多因子灵活配置混合型证券投资基金

本报告期:2018年01月01日至2018年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	133,261,974.09	1,003,372.54	134,265,346.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,470,886.15	-9,470,886.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	8,849,165.94	-530,502.60	8,318,663.34
其中:1.基金申购款	51,869,857.44	482,120.18	52,351,977.62
2.基金赎回款	-43,020,691.50	-1,012,622.78	-44,033,314.28
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	142,111,140.03	-8,998,016.21	133,113,123.82
项目	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	396,481,150.92	5,238,389.04	401,719,539.96
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,119,806.03	-10,119,806.03
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-78,806,620.83	-1,206,136.80	-80,012,757.63
其中:1.基金申购款	69,179,040.39	1,399,110.50	70,578,150.89
2.基金赎回款	-147,985,661.22	-2,605,247.30	-150,590,908.52
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	317,674,530.09	-6,087,553.79	311,586,976.30

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	杨毅	王音然
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

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为中欧基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")。

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

本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%。

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、解释以及其他相关规定(以下统称"企业会计准则")编制,同时,对于在具体会计核算和信息披露方面,也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证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》、《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〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年半年度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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月1日至2018年6月30日半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

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

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

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

6.4.6.2 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,资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为(以下简称"资管产品运营业务"),暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减;

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定,自2018年1月1日起,资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务,按照以下规定确定销售额:提供贷款服务,以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额;转让2017年12月31日前取得的股票(不包括限售股)、债券、基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的股票收盘价(2017年最后一个交易日处于停牌期间的股票,为停牌前最后一个交易日收盘价)、债券估值(中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加,以实际缴纳的增值税税额为计税依据,分别按7%、3%和2%的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

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

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

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

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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

无

6.4.7.2 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
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
国都证券股份有限公司("国都证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
自然人股东	基金管理人的股东

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	26,387,242.54	2.07%	289,908,138.50	12.02%

6.4.8.1.2 权证交易

无。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国都证券	-	-	217,585.10	100.00%

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30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	-	-	823,000,000.00	25.95%

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06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	24,574.12	2.07%	20,480.28	2.86%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	269,990.41	12.02%	257,714.01	27.49%

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

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	908,327.10	2,732,641.71
其中:支付销售机构的客户维护费	336,092.10	726,508.92

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	151,387.87	455,440.30

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018年01月01日至2018年06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	0.00
国都证券	-	10.93	10.93
中欧基金	-	39,290.38	39,290.38
合计	-	39,301.31	39,301.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	0.00
国都证券	-	2.97	2.97
中欧基金	-	534.14	534.14
合计	-	537.11	537.11

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×0.80%÷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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中欧数据挖掘混合A

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2016年01月13日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

中欧数据挖掘混合C

份额单位:份

项目	本期 2018年01月01日至2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06月30日
基金合同生效日(2016年01月13日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	152,284.26	-
报告期间申购/买入总份额	-	152,284.26
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	152,284.26	152,284.26
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.37%	29.07%

注:1、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;

2、本基金管理人本报告期内无申购、赎回本基金的情况。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位:份

中欧数据挖掘混合C

关联方名称	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017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	1,242.20	0.00%	1,242.20	0.24%

注:截止本报告期末,自然人股东持有本基金的比例为0.0030%,上表展示的比例系四舍五入后的结果。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017年06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	7,809,153.41	32,413.70	22,311,951.33	165,376.76

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.9 期末(2018年06月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.9.2 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
603690	至纯科技	2018-03-12	重大资产重组	16.25	2018-07-10	20.05	48,975	689,423.75	795,843.75	-
002450	康得新	2018-06-04	筹划重大事项	17.08	-	-	45,300	948,498.00	773,724.00	-

注:本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.10.1 公允价值

6.4.10.1.1 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收款项以及其他金融负债,因其剩余期限不长,公允价值与账面价值相若。

6.4.10.1.2 以公允价值计量的金融工具

6.4.10.1.2.1 各层次金融工具公允价值

于2018年06月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为122,808,845.29元,属于第二层次的余额为1,569,567.75元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:属于第一层次的余额为人民币121,892,657.79元,属于第二层次的余额为人民币1,835,701.56元,无划分为第三层次的余额。)。

6.4.10.1.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.10.1.2.3 第三层次公允价值期初金额和本期变动金额

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

6.4.10.2 承诺事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.10.3 其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.10.4 财务报表的批准

本财务报表已于2018年8月28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	124,378,413.04	92.01
	其中:股票	124,378,413.04	92.01
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	9,159,437.66	6.78
8	其他各项资产	1,642,209.23	1.21
9	合计	135,180,059.93	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

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,212,370.50	0.91
B	采矿业	2,970,364.08	2.23
C	制造业	73,070,945.19	54.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,184,987.04	4.65
E	建筑业	2,977,318.00	2.24
F	批发和零售业	5,430,590.00	4.08
G	交通运输、仓储和邮政业	4,154,434.04	3.12
H	住宿和餐饮业	1,396,500.00	1.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,722,961.00	8.06
J	金融业	1,893,498.00	1.42
K	房地产业	6,861,346.40	5.15
L	租赁和商务服务业	1,431,092.79	1.08
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,823,566.00	2.87
R	文化、体育和娱乐业	1,641,240.00	1.23
S	综合	607,200.00	0.46
	合计	124,378,413.04	93.44

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前十名股票投资明细

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	300347	泰格医药	61,800	3,823,566.00	2.87
2	600031	三一重工	350,000	3,139,500.00	2.36
3	002812	创新股份	56,682	2,784,786.66	2.09
4	300124	汇川技术	81,200	2,664,984.00	2.00
5	603799	华友钴业	27,000	2,631,690.00	1.98
6	603533	掌阅科技	78,200	2,530,552.00	1.90
7	600690	青岛海尔	127,800	2,461,428.00	1.85
8	600588	用友网络	85,700	2,100,507.00	1.58
9	002466	天齐锂业	41,300	2,048,067.00	1.54
10	300036	超图软件	91,300	1,861,607.00	1.40

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于www.zofund.com网站的半年度报告正文。

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	600276	恒瑞医药	12,086,657.50	9.00
2	300347	泰格医药	6,984,856.57	5.20
3	000977	浪潮信息	6,744,873.00	5.02
4	603019	中科曙光	6,442,453.74	4.80
5	600436	片仔癀	6,151,708.75	4.58
6	300124	汇川技术	5,846,318.07	4.35
7	600566	济川药业	5,576,163.69	4.15
8	002027	分众传媒	5,541,533.00	4.13
9	603799	华友钴业	5,508,722.26	4.10
10	600031	三一重工	5,460,992.43	4.07
11	002202	金风科技	5,460,566.10	4.07
12	600588	用友网络	5,434,828.20	4.05
13	600104	上汽集团	5,398,549.56	4.02
14	600703	三安光电	5,305,402.00	3.95
15	601111	中国国航	5,296,925.76	3.95
16	001979	招商蛇口	5,290,989.04	3.94
17	300015	爱尔眼科	5,263,546.83	3.92
18	600789	鲁抗医药	5,044,361.16	3.76
19	601318	中国平安	4,804,298.00	3.58
20	002008	大族激光	4,668,036.00	3.48
21	002127	南极电商	4,646,013.76	3.46
22	601288	农业银行	4,333,865.00	3.23
23	300188	美亚柏科	4,285,875.00	3.19
24	300316	晶盛机电	4,227,037.00	3.15
25	002115	三维通信	4,143,586.00	3.09
26	600297	广汇汽车	4,096,951.40	3.05
27	601225	陕西煤业	3,907,244.00	2.91
28	002466	天齐锂业	3,769,358.43	2.81
29	600741	华域汽车	3,717,616.43	2.77
30	300413	快乐购	3,676,301.00	2.74
31	601100	恒立液压	3,640,734.00	2.71
32	601688	华泰证券	3,636,005.00	2.71
33	300285	国瓷材料	3,476,802.00	2.59
34	002589	瑞康医药	3,464,863.00	2.58
35	600690	青岛海尔	3,439,722.00	2.56
36	000002	万科A	3,351,574.00	2.50
37	002179	中航光电	3,324,683.85	2.48
38	600036	招商银行	3,216,624.00	2.40
39	600338	西藏珠峰	3,181,180.65	2.37
40	000651	格力电器	3,099,730.00	2.31
41	601233	桐昆股份	3,088,621.83	2.30
42	600028	中国石化	3,014,376.00	2.25
43	002376	新北洋	3,011,935.00	2.24
44	600029	南方航空	2,998,221.00	2.23
45	600230	沧州大化	2,968,779.00	2.21
46	002402	和而泰	2,956,084.35	2.20
47	000100	TCL集团	2,920,367.00	2.18
48	600271	航天信息	2,912,558.37	2.17
49	300601	康泰生物	2,896,262.00	2.16
50	300009	安科生物	2,891,956.00	2.15
51	601012	隆基股份	2,859,938.00	2.13
52	600340	华夏幸福	2,796,970.00	2.08
53	600048	保利地产	2,785,915.00	2.07
54	601155	新城控股	2,760,238.00	2.06
55	002812	创新股份	2,752,755.36	2.05
56	300144	宋城演艺	2,743,484.00	2.04
57	000998	隆平高科	2,727,892.00	2.03
58	002371	北方华创	2,725,272.47	2.03
59	601899	紫金矿业	2,721,131.58	2.03
60	300251	光线传媒	2,720,141.00	2.03

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	600276	恒瑞医药	11,702,107.10	8.72
2	300015	爱尔眼科	10,087,728.50	7.51
3	603019	中科曙光	7,240,493.95	5.39
4	600029	南方航空	6,912,060.50	5.15
5	002027	分众传媒	6,445,659.30	4.80
6	000977	浪潮信息	6,050,542.40	4.51
7	600436	片仔癀	6,032,987.20	4.49
8	300316	晶盛机电	5,818,876.01	4.33
9	600566	济川药业	5,533,249.06	4.12
10	601111	中国国航	5,297,337.00	3.95
11	600703	三安光电	5,128,820.00	3.82
12	002202	金风科技	5,094,608.70	3.79
13	002439	启明星辰	5,010,291.54	3.73
14	601012	隆基股份	4,937,055.50	3.68
15	600741	华域汽车	4,874,120.00	3.63
16	600588	用友网络	4,510,373.36	3.36
17	601318	中国平安	4,459,617.00	3.32
18	600104	上汽集团	4,458,681.00	3.32
19	300433	蓝思科技	4,415,681.83	3.29
20	002127	南极电商	4,402,534.00	3.28
21	300188	美亚柏科	4,295,977.00	3.20
22	300413	快乐购	4,226,099.00	3.15
23	600516	方大炭素	4,130,806.00	3.08
24	300601	康泰生物	4,075,976.00	3.04
25	601288	农业银行	4,070,028.00	3.03
26	600789	鲁抗医药	3,993,596.00	2.97
27	002376	新北洋	3,957,524.84	2.95
28	002294	信立泰	3,955,916.55	2.95
29	002179	中航光电	3,948,000.47	2.94
30	600338	西藏珠峰	3,923,264.15	2.92
31	600297	广汇汽车	3,828,528.32	2.85
32	002008	大族激光	3,729,711.00	2.78
33	601100	恒立液压	3,644,129.00	2.71
34	603993	洛阳钼业	3,635,097.48	2.71
35	001979	招商蛇口	3,560,682.32	2.65
36	601155	新城控股	3,509,769.20	2.61
37	300124	汇川技术	3,487,212.00	2.60
38	300285	国瓷材料	3,466,099.00	2.58
39	002115	三维通信	3,457,524.00	2.58
40	600196	复星医药	3,448,331.06	2.57
41	000725	京东方A	3,383,576.00	2.52
42	300347	泰格医药	3,333,211.66	2.48
43	600201	生物股份	3,216,738.00	2.40
44	601688	华泰证券	3,214,623.00	2.39
45	600217	中再资环	3,158,724.67	2.35
46	000338	潍柴动力	3,153,322.00	2.35
47	000333	美的集团	3,146,931.15	2.34
48	002371	北方华创	3,143,320.17	2.34
49	601225	陕西煤业	3,139,485.00	2.34
50	300009	安科生物	3,134,017.83	2.33
51	600036	招商银行	3,106,281.00	2.31
52	002402	和而泰	3,100,247.75	2.31
53	600782	新钢股份	3,082,057.00	2.30
54	600028	中国石化	2,974,338.00	2.22
55	603799	华友钴业	2,957,316.45	2.20
56	601336	新华保险	2,940,846.00	2.19
57	002415	海康威视	2,921,387.00	2.18
58	600230	沧州大化	2,832,584.04	2.11
59	300498	温氏股份	2,780,434.20	2.07
60	002460	赣锋锂业	2,750,373.00	2.05
61	600048	保利地产	2,734,471.00	2.04
62	000100	TCL集团	2,731,799.99	2.03

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	642,625,538.23
卖出股票收入(成交)总额	634,857,623.96

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IC1807	IC1807	1	1,037,600.00	-86,920.00	套保
公允价值变动总额合计(元)				-86,920.00	
股指期货投资本期收益(元)				-70,980.00	
股指期货投资本期公允价值变动(元)				-120,820.00	

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

7.11.3 本期国债期货投资评价

国债期货不属于本基金的投资范围,故此项不适用。

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	293,417.19
2	应收证券清算款	1,332,091.85
3	应收股利	-
4	应收利息	2,356.72
5	应收申购款	14,343.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,642,209.23

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 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
中欧数据挖掘混合A	1,825	55,475.59	29,078,484.53	28.72%	72,164,472.41	71.28%
中欧数据挖掘混合C	550	74,305.79	39,859,852.16	97.53%	1,008,330.93	2.47%
合计	2,375	59,836.27	68,938,336.69	48.51%	73,172,803.34	51.49%

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。

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
基金管理人所有从业人员持有本基金	中欧数据挖掘混合A	64,951.62	0.06%
	中欧数据挖掘混合C	1,332.38	0.00%
	合计	66,284.00	0.05%

注:截止本报告期末,基金管理人的从业人员持有本基金C类基金份额的比例为0.0033%,上表展示的比例系四舍五入后的结果。

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	0~10
	中欧数据挖掘混合C	0~10
	合计	0~10
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

	中欧数据挖掘混合A	中欧数据挖掘混合C
基金合同生效日(2016年01月13日)基金份额总额	506,409,681.98	-
本报告期期初基金份额总额	132,741,535.10	520,438.99
本报告期基金总申购份额	8,966,193.01	42,903,664.43
减:本报告期基金总赎回份额	40,464,771.17	2,555,920.33
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	101,242,956.94	40,868,183.09

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

报告期内无基金份额持有人大会决议。

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未发生重大的人事变动。

10.2.2 基金托管人的重大人事变动

本报告期内托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

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,为本基金审计的会计师事务所为安永华明会计师事务所(特殊普通合伙),未有改聘情况发生。

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

报告期内本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门的稽查或处罚。

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 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
国金证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	68,574,424.69	5.37%	63,863.02	5.37%	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	90,290,622.15	7.07%	84,087.62	7.07%	-
东北证券	1	173,657,890.51	13.60%	161,728.13	13.60%	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	323,031,971.71	25.30%	300,836.47	25.30%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	131,612,800.37	10.31%	122,572.11	10.31%	-
东吴证券	1	39,499,290.73	3.09%	36,785.78	3.09%	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	86,449,995.11	6.77%	80,509.58	6.77%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	2	26,387,242.54	2.07%	24,574.12	2.07%	-
中泰证券	2	337,215,347.09	26.41%	314,046.97	26.41%	-

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

2.本报告期内,本基金新增中泰证券上海交易单元和川财证券上海交易单元,减少申万宏源西部证券深圳交易单元和中投证券深圳交易单元。

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 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

§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	序号	报告期内持有基金份额变化情况 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	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018年1月1日至2018年6月30日	29,078,484.53	0.00	0.00	29,078,484.53	20.46%
机构	2	2018年6月8日至2018年6月30日	0.00	39,707,567.90	0.00	39,707,567.90	27.94%
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中欧基金管理有限公司

二〇一八年八月二十八日