

中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年年度报告 摘要

2015 年 12 月 31 日

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2016 年 3 月 26 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金-中邮创业基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：邮储银行）根据本基金合同规定，于 2016 年 03 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、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。

本报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 02 月 11 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中邮科技创新混合
基金主代码	000966
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年2月11日
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	406,938,045.16份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注在我国经济转型中受益于科技创新的企业，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的股票投资策略相结合的方法进行投资。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，本基金通过对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金将重点关注在中国经济转型过程中，由科技创新带来的具有广阔市场空间及持续成长能力的优质企业，采用自下而上个股精选的股票投资策略，精选上市公司股票。本基金所指的科技创新主要分为科技制造创新和科技服务创新两方面。</p> <p>1、科技创新主题的界定</p> <p>（1）科技制造创新</p> <p>我国未来经济发展的重要立足点在于能够实现由制造大国向制造强国的转变，科学技术的创新是实现制造强国的重要手段。随着我国人口红利的逐渐结束，传统制造业面临劳动力成本上涨的困境，因此依靠科技创新颠覆传统的生产制造方式，提高生产效率和制造的附加值将是制造业未来的发展趋势。</p>

高端装备制造业是科技制造创新的典型代表。高端装备制造业是制造业的先导产业，具有高、精、专的特点，同时高端装备制造业既是科技创新的成果，也是推动科技创新的主要动力之一，因此高端装备制造业是本基金投资科技创新的主要方向之一。

（2）科技服务创新

伴随着人口结构的改变及消费升级，科技服务逐渐成为消费的重要方向之一，科技服务的创新也正在改变着人们的生活方式。

互联网行业是科技服务创新的重要体现。在互联网行业与各行业的融合和碰撞过程中，用户体验的提升，商业模式的重塑，新的盈利增长点的诞生，都是本基金主要关注的方向。

本基金管理人将持续跟踪国家相关政策、关注科技创新的发展状况、科研成果和技术工艺的重大突破新等因素的变化，对科技创新的范畴进行动态调整。

2、核心科技创新主题的个股特征

具体来说，本基金将重点筛选具有如下“核心科技创新”特征的企业：

（1）提供全新的产品或服务、开创新的产业领域，或以前所未有的方式提供已有的产品或服务，并且产品或服务具有核心竞争优势；

（2）应用新知识、新技术、新工艺、新思维，大幅降低生产成本、提高产品质量和产量；

（3）在技术边界上提高生产技术手段、强化工艺流程，在业务边界上改进产品和服务体验，在运作边界上扩大产业活动基础平台，在市场边界上增强产品和服务的竞争力；

（4）在商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等诸多方面的变化和创新，通过这些创新实现了企业成本的降低、盈利的增加和竞争实力的提高；

（5）改善人类生活质量、推动经济的发展和社会的进步。

（三）债券投资策略

在债券投资部分，本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上，对影响个别债券定价的主要因素，包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

（四）权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内

	<p>在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。</p> <p>（五）股指期货投资策略</p> <p>本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货，特别是在科技创新受经济环境、政策监管等外部重要因素影响时相应行业的上市公司股价变化可能出现一定程度的波动，通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	<p>本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%。</p> <p>本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。</p>
风险收益特征	<p>本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。</p>

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		中邮创业基金管理股份有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	田东辉
	联系电话	010-82295160-157	010-68858113
	电子邮箱	houyuc@postfund.com.cn	tiantonghui@psbc.com
客户服务电话		010-58511618	95580
传真		010-82295155	010-68858120

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人或基金托管人的办公场所。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年2月11日 (基金合同生效日) -2015年12月 31日	2014年	2013年
本期已实现收益	91,514,600.16	-	-
本期利润	165,743,867.32	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.2510	-	-
本期基金份额净值增长率	18.00%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.1146	-	-
期末基金资产净值	480,014,876.65	-	-
期末基金份额净值	1.180	-	-

注：1. 本基金基金合同生效日为 2015 年 02 月 11 日，本报告期指 2015 年 02 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日。

2. 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。

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

4. 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，不是当前发生额）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去三个月	42.00%	2.64%	10.65%	1.01%	31.35%	1.63%
过去六个月	3.42%	3.64%	-8.15%	1.61%	11.57%	2.03%
自基金合同 生效起至今	18.00%	3.08%	9.53%	1.51%	8.47%	1.57%

注：1. 本基金基金合同生效日为 2015 年 02 月 11 日。

2. 所述基金业绩指标不包括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。

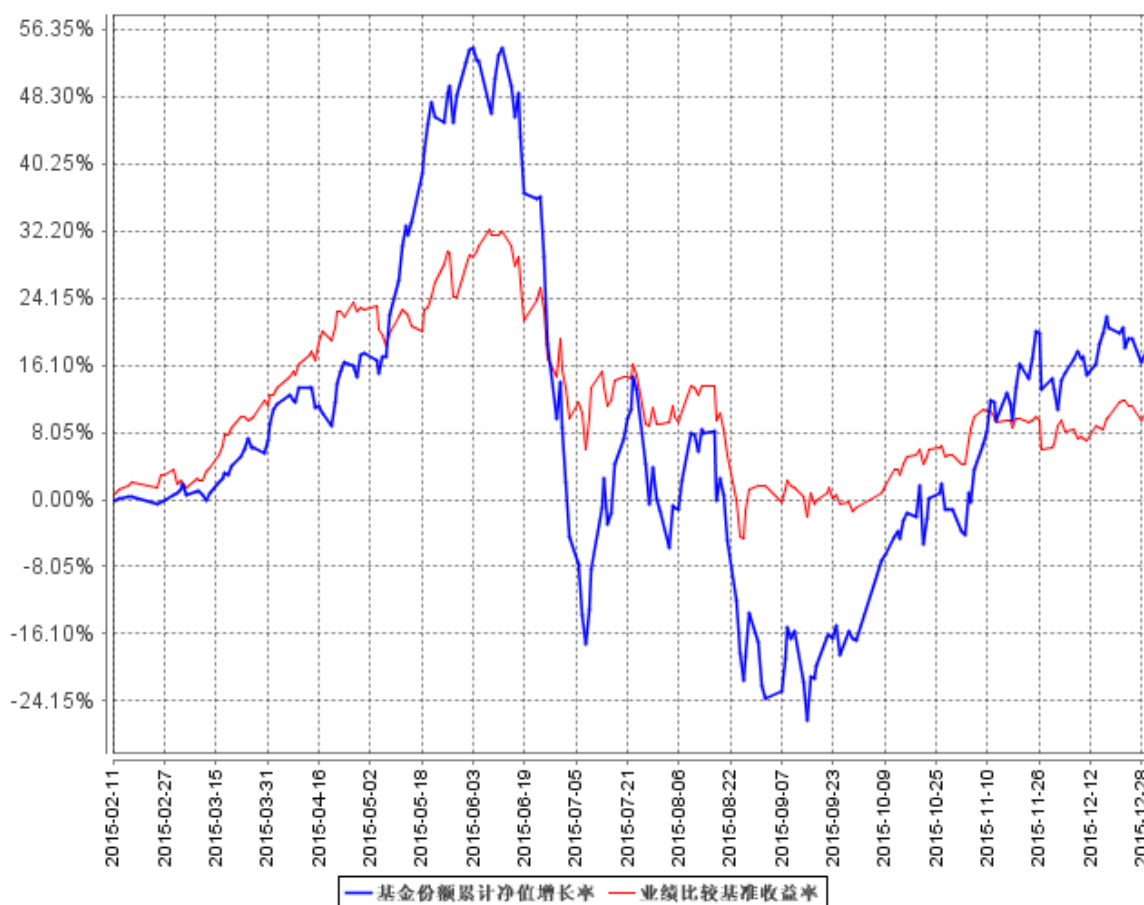
3. 关于业绩基准的说明：

本基金业绩比较基准为：本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%。

本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数。

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

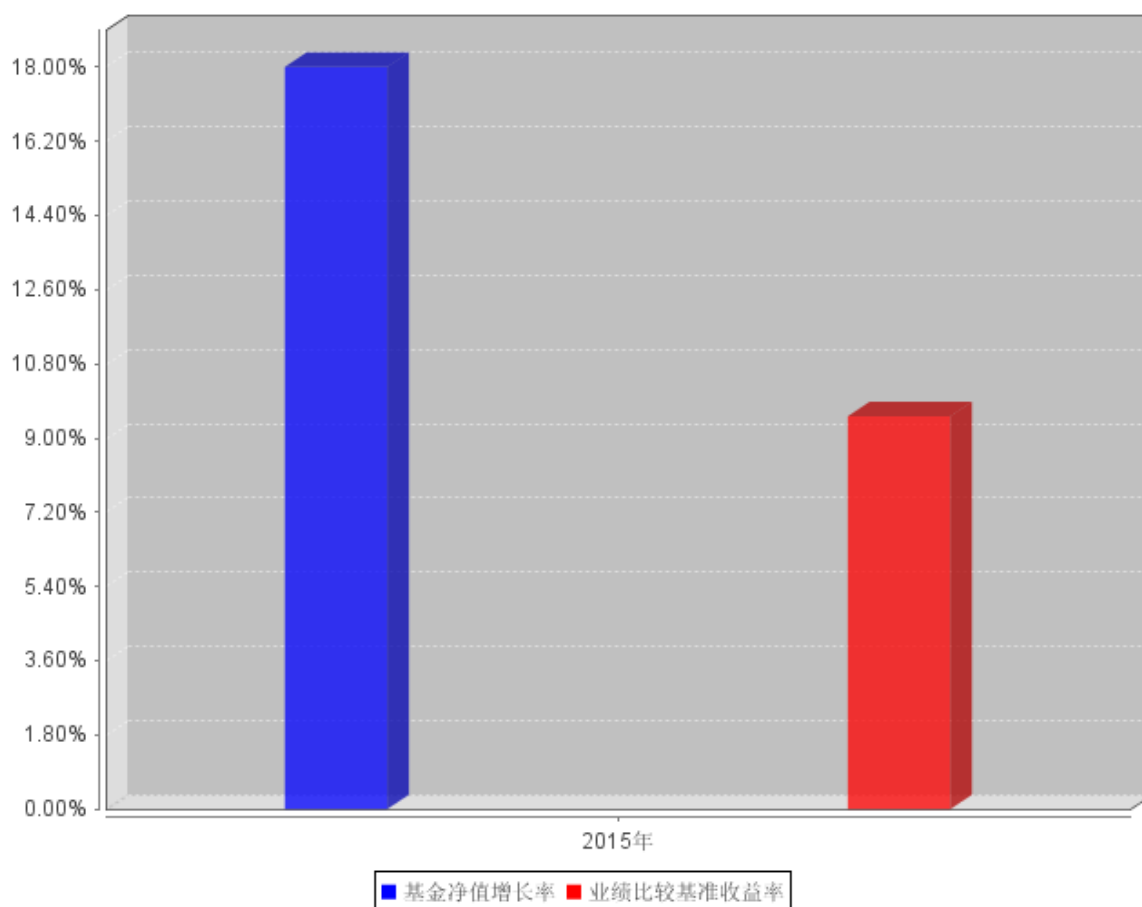
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 2 月 11 日至报告期末未满 1 年；按基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 02 月 11 日，本报告期指 2015 年 02 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日；本报告期内本基金未实施利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司成立于 2006 年 5 月 18 日，截至 2015 年 12 月 31 日，本公司共管理 23 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放

债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创业新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金。

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		
曹思	基金经理	2015年2月11日	-	8年	经济学硕士，曾任中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究、投资、交易等各方面受到公平对待，确保各基金获得公平交易的机会。

报告期内，本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发生内幕交易的情况；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务、注册登记业务均按规定的程序、规则进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

1、公平交易制度

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中邮基金管理股份有限公司公平交易制度》。公司的公平交易制度所规范的业务范围既包括所有投资组合品种，即涵盖封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等；也规范所有一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并且包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的所有业务环节。

公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严格禁止直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

公司按照规定严格将投资管理职能和交易执行职能进行隔离，以时间优先、价格优先、

综合平衡、比例实施、保证各基金间的利益公平为原则建立和完善集中交易制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

投资组合经理对公平交易执行过程或公平交易结果发生争议情况下，相关交易员应该先暂停执行交易并报告交易部总经理，由交易部总经理与相关投资组合经理就争议内容进行协调处理，经协调后方可执行；若无法达成一致意见，则由交易部总经理根据公司制度报公司总经理和监察稽核部门协调解决。

监察稽核部每季度依照相关法律法规及本制度的规定，对公司所管理的各投资组合公平交易制度执行情况进行监督检查，并出具检查报告，经总经理、投资总监、投资组合经理确认并签署后将有关公平交易情况的专项说明报告转发至相关部门作为编制定期报告的内容。

2、控制方法

监察稽核部建立投资交易行为监督和评估制度，对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。如若发现异常交易行为，监察稽核部有权要求相关投资经理、交易部等相关责任部门、责任人做出说明。监察稽核部要求相关责任部门、责任人就异常交易行为做出说明的，相关责任部门、责任人须在三个工作日内，提交异常交易行为情况说明，经督察长、总经理签字后，报监察稽核部备查。

为更好执行公平交易制度，公司加快了升级衡泰风险与绩效评估 4.0 系统的进度，其业界通用的公平交易模块即将得到使用。公司目前使用的公平交易模型可以通过设置参数出具季度和连续 12 个月公平交易价差分析报告，相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，并最终形成有关公平交易情况的专项说明报告发送至相关部门。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

在证监会颁发《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》后，由金融工程部组织，对交易部和投资部相关人员进行培训，督促相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的顺利执行，公司与衡泰软件共同开发了公平交易系统，并按月度、季度、年度生成各只基金之间的交易价差分析报告，逐一分析得出结论后发送给相关部门和人员。对于报告中产生的异常情况，在做出合理解释后，提请各部门相关人员引起重视，完善公司内部公平交易制度，使之更符合指导意见精神，并避免类似情况再次发生，最后妥善保存分析报告备查。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，基金管理人管理的所有投资组合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未超过该证券当日成交量的 5%。

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

在报告期内，市场经历了几轮大幅的波动，基金产品净值同时也出现了比较明显的震动。2015 年自产品成立，坚持了基金产品的投资定位，主要投资方向定位在代表中国经济未来发展方向的科技创新领域。经历了全年的一波三折，市场风险偏好明显改变，估值泡沫破裂，因此在个股选择标准上，估值安全和业绩增长确定性成为首要条件。

在行业配置方面，我们认为能够穿越周期的更多是代表未来经济发展方向的具备科技创新属

性的行业和个股，因此重点配置方向为互联网产业，高端制造业以及生物医药等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.180 元，累计净值 1.180 元。本报告期份额净值增长率为 18.00%，同期业绩比较基准增长率为 9.53%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

首先从宏观经济基本面看，预计 2016 年整体宏观经济增速将会进一步下滑，传统经济依旧疲弱。但是从微观企业的表现看，新兴经济亮点层出不穷。流动性方面预计将会维持积极的货币政策，市场流动性将会保持相对宽松的状态，但对市场的边际改善作用将相对于 2015 年明显减弱。在对整体宏观经济基本面以及流动性判断的基础上，我们认为 2016 年整体主要是结构性的投资机会，代表未来经济增长驱动力的新兴产业预计将会有较好的市场表现，业绩和成长空间仍将是考量股票的主要标准。最后对于 2016 年基金产品投资策略，依然看好新兴经济中的投资机会，具体体现在三条投资主线，第一，信息经济。主要以互联网为代表，包括信息产业基础设施建设以及互联网和传统经济的融合等的投资机会。第二，健康经济。主要包括生物医药，医疗服务、体育产业等的投资机会。第三，智能经济，主要智能硬件设备、高端设备、机器人等为代表的投资机会。

在行业配置方面，主要看好代表未来经济转型的具备科技创新属性和能力的 TMT、生物医药、环保等行业。将从这几个行业中选择具有科技创新属性的公司进行配置。

另外我们将根据整体宏观经济的运行以及市场走势的变化，及时对仓位进行调整，力争为投资者带来良好的投资回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人致力于建立和健全公司内部控制制度，努力防范和化解公司各项经营管理活动中的风险，促进公司诚信、合法、有效经营，切实保障基金份额持有人的利益。

公司已建立了督察长制度，督察长全权负责公司的监察与稽核工作，对基金运作的合法合规性进行全面检查与监督，遇有重大风险事件立即向公司董事长和中国证监会报告。公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，由督察长直接领导。监察稽核部按照规定的权限和程序，通过日常实时监控、现场专项检查、定期监察稽核评估等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向公司董事和管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人主要内部监察稽核工作如下：

1. 制度建设不断完善

基金管理人进一步健全公司内控体系，保持了良好的内控环境、完善了内部控制的三道防线，并根据公司实际业务情况细化了岗位风险控制。在制订部门规章制度和业务流程时，将内控要求融入到各业务规范当中。同时根据公司业务的发展及监管部门法律法规的更新，对公司和部门制度进行持续的完善、修订及补充。根据新《基金法》，

公司制定了《中邮创业基金管理股份有限公司基金从业人员证券投资管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司关联交易管理制度》。根据业务发展需要和监管要求，各个业务部门也都不断修改和完善自身的部门制度。投研、交易、固定收益、金融工程、人力资源等部门均根据实际工作需要对本部门制度进行了较大完善。公司反洗钱内控制度方面，根据人民银行《金融机构洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》，公司制定了《中邮创业基金管理股份有限公司洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理制度》，进一步完善了公司的制度体系。

2. 日常监察稽核工作

为规范基金投资运作、防范风险、更好的保护基金份额持有人的利益，对基金投资运作进行日常的监察工作，保障研究、投资决策、交易执行等环节严格执行法律法规及基金合同的有关规定。在日常实时电脑监控中，对基金投资及相关业务进行事中的风险控制，保障公司管理的基金规范运作。此外对信息技术、基金的注册登记、基金会计、信息披露等业务进行例行检查。

3. 专项与常规监察稽核工作

根据监管部门的要求及公司业务开展情况，对相关业务部门进行专项和常规监察稽核。报告期内，对公司的研究、投资、交易、固定收益业务、三条底线、防范内幕交易进行了专项稽核。对信息技术、公共事务部、营销部等进行了常规稽核。通过检查发现内部控制薄弱点，及时提出了整改意见及建议。

4. 定期监察稽核及内控检查评估工作

每季度对公司及基金运作的合法合规性及内部控制情况进行检查，对公司各项业务的制度建设、制度执行、风险控制等情况进行评估，发现内控的薄弱环节，并提出相应改进措施，促进公司内部控制和风险管理水平的加强和提高。

在本报告期内，本基金管理人运用基金财产进行投资严格按照招募说明书所披露的投资决策程序进行，无不当内幕交易和关联交易。没有发生重大违法违规行为。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持内部控制优先原则，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、督察长、基金清算部经理、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理，在采用估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 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，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人依据国家相关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本 2015 年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字(2016)第 110ZA2808 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人。
引言段	我们审计了后附的中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金（以下简称中邮核心科技创新基金）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年 02 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中邮核心科技创新基金的基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司管理层的责任，这种责任包括：（1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，中邮核心科技创新基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中邮核心科技创新基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 02 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日的经营成果和所有者权益（基金净值）变动

	情况。	
注册会计师的姓名	卫俏嫔	吕玉芝
会计师事务所的名称	致同会计师事务所（特殊普通合伙）	
会计师事务所的地址	中国·北京 朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层	
审计报告日期	2016 年 3 月 18 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		106,854,858.64	-
结算备付金		899,410.59	-
存出保证金		845,304.54	-
交易性金融资产		389,023,438.57	-
其中：股票投资		389,023,438.57	-
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		-	-
应收利息		20,693.80	-
应收股利		-	-
应收申购款		515,588.40	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		498,159,294.54	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日	上年度末 2014 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		13,755,541.21	-
应付赎回款		2,490,640.15	-
应付管理人报酬		625,505.75	-
应付托管费		104,250.95	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		833,613.63	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		334,866.20	-
负债合计		18,144,417.89	-
所有者权益：			
实收基金		406,938,045.16	-
未分配利润		73,076,831.49	-
所有者权益合计		480,014,876.65	-
负债和所有者权益总计		498,159,294.54	-

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.180 元，基金份额总额 406,938,045.16 份。

本基金基金合同生效日为 2015 年 02 月 11 日，本报告期指 2015 年 02 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日，因此无上年度可比期间数据。

7.2 利润表

会计主体：中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 11 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015 年 2 月 11 日(基 金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 12 月 31 日
一、收入		182,687,579.68	-
1. 利息收入		2,169,016.99	-
其中：存款利息收入		1,753,660.56	-
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		415,356.43	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		101,263,981.62	-

其中：股票投资收益		100,241,005.35	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		1,022,976.27	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		74,229,267.16	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）		5,025,313.91	-
减：二、费用		16,943,712.36	-
1. 管理人报酬		9,713,526.93	-
2. 托管费		1,618,921.20	-
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用		5,195,864.23	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用		415,400.00	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		165,743,867.32	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		165,743,867.32	-

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 02 月 11 日，本报告期指 2015 年 02 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日，因此无上年度可比期间数据。

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 2 月 11 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	941,247,382.79	-	941,247,382.79

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	165,743,867.32	165,743,867.32
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）	-534,309,337.63	-92,667,035.83	-626,976,373.46
其中：1. 基金申购款	622,800,280.76	158,696,470.92	781,496,751.68
2. 基金赎回款	-1,157,109,618.39	-251,363,506.75	-1,408,473,125.14
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）	406,938,045.16	73,076,831.49	480,014,876.65
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润）	-	-	-
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	-	-	-

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 02 月 11 日，本报告期指 2015 年 02 月 11 日至 2015 年 12 月 31 日，因此无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

周克

周克

吕伟卓

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中邮核心科技创新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[2014]1363号《关于准予中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准募集，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于2015年2月11日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集941,247,382.79元，业经致同会计师事务所(特殊普通合伙) 致同验字(2015)第110ZC0072号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮核心科技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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、可转换债券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：股票投资占基金资产的比例为0%~95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%~100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为0%~3%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%。本基金投资于科技创新主题的证券不低于非现金基金资产的80%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）和中国证券业协会2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会2010年2月8日颁布的证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板3号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况等有关信息。

7.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.4.1 会计政策变更的说明

本报告期本基金无会计政策变更。

7.4.4.2 会计估计变更的说明

2014 年 11 月 13 日，中国证券投资基金业协会发布了《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“新估值标准”），及《关于 2015 年 1 季度固定收益品种估值处理标准的通知》，自 2015 年 3 月 30 日起，本基金对持有的在交易所市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外）的估值方法进行调整，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

除上述会计估计变更外，本报告期内本基金无其他会计估计变更。

7.4.4.3 差错更正的说明

本报告期本基金无差错更正。

7.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税字[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《财政部 国家税务总局证监会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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1. 以发行基金方式募集资金，不属于营业税征收范围，不征收营业税。
2. 自 2013 年 1 月 1 日起，对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税；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。
3. 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
4. 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。

7.4.6 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中邮创业基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金管理人股东控股的公司、基金代销机构
首创证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
三井住友银行股份有限公司	基金管理人的股东
中国邮政集团公司	基金管理人的股东

7.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.7.2 关联方报酬

7.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	9,713,526.93	-
其中：支付销售机构的客户维护费	2,846,399.90	-

注：支付基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值的1.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.5% / 当年天数

7.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2015年2月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,618,921.20	-

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数

7.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2015年2月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日	2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日（2015年2月11日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	1,952,631.46	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	1,952,631.46	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.48%	-

7.4.7.4.2 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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

7.4.7.5 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		上年度可比期间	
	2015年2月11日(基金合同生效日)至2015年12月31日		2014年1月1日至2014年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	106,854,858.64	1,677,847.50	-	-

7.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

7.4.8 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本报告期末本基金未持有因认购/增发而持有的流通受限证券。

7.4.8.2 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
601388	怡球资源	2015年7月27日	重大事项	20.72	2016年2月15日	21.00	500,000	10,557,915.83	10,360,000.00	-
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项	57.62	-	-	220,070	4,873,200.18	12,680,433.40	-
300324	旋极信息	2015年12月1日	重大事项	50.60	2016年3月10日	44.33	100,000	4,538,481.00	5,060,000.00	-
300456	耐威科技	2015年8月3日	重大事项	108.96	2016年1月15日	113.00	259,918	25,936,144.88	28,320,665.28	-

注：1. 按照证监会公告[2008]38号-《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及《中国证券业协会基金估值小组停牌股票估值的参考方法》的要求，上述股票怡球资源（601388）、梅泰诺（300038）、旋极信息（300324）、耐威科技（300456）均按“指数收益法”进行估值。

2. 2016年2月15日怡球资源复牌交易，根据该股票复牌后的交易特征，本公司综合参考各项相关影响因素并与托管人共同协商一致，决定自2016年2月16日起恢复采用收盘价进行估值；2016年3月10日旋极信息复牌交易，根据该股票复牌后的交易特征，本公司综合参考各项相关影响因素并与托管人共同协商一致，决定自2016年3月14日起恢复采用收盘价进行估值。

7.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	389,023,438.57	78.09
	其中：股票	389,023,438.57	78.09
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	107,754,269.23	21.63
7	其他各项资产	1,381,586.74	0.28
8	合计	498,159,294.54	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	206,876,886.63	43.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	5,601,000.00	1.17
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,962,873.60	22.70
J	金融业	4,375,000.00	0.91
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,808,478.34	3.71
M	科学研究和技术服务业	31,680,000.00	6.60
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	13,719,200.00	2.86
S	综合	-	-
	合计	389,023,438.57	81.04

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项目公允价值占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	300215	电科院	1,600,000	31,680,000.00	6.60
2	300456	耐威科技	259,918	28,320,665.28	5.90
3	300383	光环新网	400,000	22,284,000.00	4.64
4	300367	东方网力	280,000	19,516,000.00	4.07
5	603300	华铁科技	369,931	17,808,478.34	3.71
6	002326	永太科技	800,000	16,832,000.00	3.51
7	600594	益佰制药	770,000	16,324,000.00	3.40
8	300302	同有科技	210,000	15,214,500.00	3.17
9	002368	太极股份	224,989	15,096,761.90	3.15
10	600136	道博股份	220,000	13,719,200.00	2.86

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002347	泰尔重工	62,359,894.35	12.99
2	002326	永太科技	61,615,485.28	12.84
3	002047	宝鹰股份	58,680,724.16	12.22
4	300383	光环新网	51,528,624.10	10.73
5	000046	泛海控股	43,144,719.40	8.99
6	300367	东方网力	40,710,710.09	8.48
7	002312	三泰控股	39,327,603.50	8.19
8	000541	佛山照明	33,626,409.68	7.01
9	601166	兴业银行	33,066,099.40	6.89
10	300430	诚益通	32,862,863.85	6.85
11	300379	东方通	31,775,845.12	6.62
12	300451	创业软件	31,198,752.77	6.50
13	600594	益佰制药	30,732,927.95	6.40
14	300077	国民技术	30,593,432.43	6.37
15	300456	耐威科技	28,904,370.88	6.02
16	002734	利民股份	27,770,332.02	5.79
17	300285	国瓷材料	27,742,933.90	5.78
18	300215	电科院	27,512,373.62	5.73
19	000971	高升控股	27,117,108.00	5.65
20	000587	金叶珠宝	26,978,173.28	5.62
21	002546	新联电子	26,867,053.40	5.60
22	601218	吉鑫科技	26,686,992.43	5.56
23	000158	常山股份	26,366,828.64	5.49
24	300267	尔康制药	22,948,565.40	4.78
25	000050	深天马A	22,841,614.04	4.76
26	002681	奋达科技	22,094,942.08	4.60
27	300385	雪浪环境	21,694,635.91	4.52
28	300271	华宇软件	20,768,915.30	4.33
29	300097	智云股份	19,789,460.44	4.12
30	002715	登云股份	19,225,304.34	4.01

31	600523	贵航股份	19,152,886.77	3.99
32	603118	共进股份	18,476,357.00	3.85
33	002189	利达光电	18,022,335.54	3.75
34	002390	信邦制药	17,993,203.07	3.75
35	002229	鸿博股份	17,698,634.52	3.69
36	002664	信质电机	17,510,671.00	3.65
37	300193	佳士科技	17,426,752.69	3.63
38	300338	开元仪器	16,784,594.80	3.50
39	603000	人民网	16,733,638.00	3.49
40	002256	彩虹精化	15,802,178.90	3.29
41	300302	同有科技	15,377,789.32	3.20
42	002376	新北洋	15,306,733.06	3.19
43	000686	东北证券	14,949,927.00	3.11
44	300392	腾信股份	14,675,876.48	3.06
45	603023	威帝股份	14,509,353.60	3.02
46	603300	华铁科技	14,412,051.38	3.00
47	603088	宁波精达	13,963,270.00	2.91
48	600728	佳都科技	13,564,071.32	2.83
49	601801	皖新传媒	13,549,178.00	2.82
50	300203	聚光科技	12,953,102.85	2.70
51	300250	初灵信息	12,865,906.63	2.68
52	601388	怡球资源	12,669,499.00	2.64
53	300072	三聚环保	12,635,793.00	2.63
54	600185	格力地产	12,573,075.03	2.62
55	600391	成发科技	12,541,276.21	2.61
56	600570	恒生电子	12,532,256.00	2.61
57	002368	太极股份	12,507,533.61	2.61
58	600446	金证股份	12,151,932.00	2.53
59	000722	湖南发展	11,951,439.78	2.49
60	002310	东方园林	11,410,518.00	2.38
61	300305	裕兴股份	11,080,864.61	2.31
62	300038	梅泰诺	11,071,932.04	2.31
63	300264	佳创视讯	10,986,387.47	2.29
64	300324	旋极信息	10,770,976.28	2.24
65	300187	永清环保	10,513,707.01	2.19
66	002367	康力电梯	10,343,497.73	2.15

67	002474	榕基软件	10,248,855.50	2.14
68	600172	黄河旋风	10,221,781.30	2.13
69	300163	先锋新材	9,823,267.96	2.05
70	300387	富邦股份	9,779,549.00	2.04
71	002635	安洁科技	9,681,701.27	2.02
72	002285	世联行	9,638,262.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	300383	光环新网	101,943,078.71	21.24
2	002326	永太科技	93,028,131.29	19.38
3	000046	泛海控股	45,586,455.21	9.50
4	000971	高升控股	40,877,828.90	8.52
5	000541	佛山照明	36,587,708.98	7.62
6	002347	泰尔重工	36,534,597.39	7.61
7	300367	东方网力	35,064,338.03	7.30
8	300430	诚益通	32,105,403.20	6.69
9	601166	兴业银行	31,895,676.00	6.64
10	300285	国瓷材料	31,499,406.09	6.56
11	000158	常山股份	31,086,600.51	6.48
12	002047	宝鹰股份	31,072,602.79	6.47
13	002312	三泰控股	29,617,984.89	6.17
14	601218	吉鑫科技	28,041,220.53	5.84
15	300267	尔康制药	27,384,732.34	5.70
16	603118	共进股份	25,067,969.84	5.22
17	002664	信质电机	24,618,719.94	5.13
18	300077	国民技术	24,611,367.12	5.13
19	002681	奋达科技	24,142,167.33	5.03
20	603789	星光农机	23,062,227.81	4.80
21	000050	深天马 A	22,153,837.26	4.62
22	300338	开元仪器	21,753,528.72	4.53
23	002546	新联电子	21,241,538.24	4.43
24	002256	彩虹精化	20,552,824.65	4.28
25	300385	雪浪环境	19,512,591.64	4.06
26	002734	利民股份	19,276,529.84	4.02

27	300302	同有科技	19,229,688.66	4.01
28	300379	东方通	19,019,041.00	3.96
29	600446	金证股份	16,191,488.16	3.37
30	603000	人民网	15,940,785.58	3.32
31	600523	贵航股份	15,813,134.70	3.29
32	002189	利达光电	15,602,996.20	3.25
33	300072	三聚环保	15,498,644.61	3.23
34	300097	智云股份	15,171,106.47	3.16
35	300451	创业软件	15,025,523.50	3.13
36	000587	金叶珠宝	14,584,029.54	3.04
37	600391	成发科技	14,531,538.54	3.03
38	300203	聚光科技	14,353,648.80	2.99
39	600728	佳都科技	14,279,999.00	2.97
40	002635	安洁科技	13,788,852.06	2.87
41	600185	格力地产	13,085,451.56	2.73
42	603023	威帝股份	13,070,841.64	2.72
43	300392	腾信股份	12,925,375.30	2.69
44	600594	益佰制药	12,502,815.53	2.60
45	002229	鸿博股份	12,501,154.00	2.60
46	000686	东北证券	12,079,027.37	2.52
47	002376	新北洋	11,856,582.53	2.47
48	300038	梅泰诺	11,494,685.52	2.39
49	600570	恒生电子	11,490,291.00	2.39
50	601801	皖新传媒	11,225,504.49	2.34
51	300373	扬杰科技	11,184,047.19	2.33
52	603088	宁波精达	11,042,113.00	2.30
53	300250	初灵信息	10,978,995.00	2.29
54	300187	永清环保	10,824,603.98	2.26
55	002367	康力电梯	10,788,518.76	2.25
56	002668	奥马电器	10,666,194.73	2.22
57	300182	捷成股份	10,504,491.58	2.19
58	300305	裕兴股份	10,314,482.48	2.15
59	002715	登云股份	10,234,400.43	2.13
60	600030	中信证券	10,057,178.78	2.10
61	300163	先锋新材	9,604,363.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,850,112,784.36
卖出股票收入（成交）总额	1,635,559,618.30

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未投资股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货，特别是在科技创新受经济环境、政策监管等外部重要因素影响时相应行业的上市公司股价变化可能出现一定程度的波动，通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

注：根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	845,304.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	20,693.80
5	应收申购款	515,588.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,381,586.74

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300456	耐威科技	28,320,665.28	5.90	重大事项

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
12,462	32,654.31	77,253,083.27	18.98%	329,684,961.89	81.02%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	193,807.55	0.0476%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月11日）基金份额总额	941,247,382.79
本报告期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	622,800,280.76
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,157,109,618.39
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	406,938,045.16

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

经本公司董事会审议通过，本公司副总经理王金晖同志于2015年6月3日离任。

本报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为田东辉先生，向监管部门的相关报备手续正在办理中。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的

审计费用为人民币壹拾壹万元整，目前该会计师事务所已为本基金提供审计服务一个会计年度。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华福证券		12,790,206,545.24	80.09%	2,558,597.52	80.11%	-
兴业证券	1	693,530,836.46	19.91%	635,066.98	19.89%	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

(1) 券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与中邮创业基金管理股份有限公司有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

(2) 券商经纪人具有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据中邮创业基金管理股份有限公司所管理基金的特定要求，提供研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

(3) 券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠合理的佣金率。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。基金管理人与被选择的证券公司签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。

2、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金不存在交易单元退租情况

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权证

		成交总额的比 例		券回购 成交总额 的比例		成交总额的 比例
兴业证券	-	-	4,850,000,000.00	100.00%	-	-

中邮创业基金管理股份有限公司
2016年3月26日