

中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告 摘要

2016 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：中国民生银行股份有限公司

送出日期：2017 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示

1.1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

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 2016 年 01 月 01 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金简称 | 中邮新思路 |
| 基金主代码 | 001224 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015 年 11 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 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 99,724,161.06 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金将灵活应用各种金融工具和风险对冲策略降低投资组合风险，实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金通过多种绝对收益策略、多种交易品种的操作，有效地规避市场的系统性风险。同时在严格控制风险敞口的前提下，捕捉套利机会和趋势性交易机会，力求为基金份额持有人赢取稳定的绝对收益。</p> <p>（一）股票绝对收益投资策略</p> <p>本策略积极依托基金管理人投研平台的研究能力进行积极主动的个股选择策略，通过定量与定性相结合的分析方法考量上市公司的盈利状况、估值水平、市场情绪、股价催化剂等因素，辅以量化投资模型从基金管理人的股票库中精选股票，努力获取超额收益，同时在金融衍生品市场上对冲，剥离系统性风险，力争实现较为稳定的绝对收益。在构建投资组合的过程中，本基金将遵循以下投资策略：</p> <p>1、定性与定量相结合构建股票组合</p> <p>本基金选取具有良好投资价值的股票作为投资对象，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，通过定量和定性相结合的方法精选个股。</p> <p>2、市场中性策略</p> <p>现阶段本基金将利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化、现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，并进行适时灵活调整。同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同月份期货合约之间进行动态配置，通过优化股指期货合约的持仓来创造额外收益。另外当本基金出</p> |

| | |
|--------|--|
| | <p>现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理，根据基金净申购或净赎回的规模，分别买入数量匹配的多头或者空头股指期货合约，并选择适当的时机平仓。随着监管的放开及其他工具流动性增强，我们会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式，在数量模型的约束下，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。</p> <p>(二) 其他绝对收益策略</p> <p>1、固定收益品种投资策略</p> <p>本基金投资债券首先综合考量股票组合及股指期货套期保值对资金的需求，对闲置资金投资债券做出规划，包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等。然后在这些约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</p> <p>2、衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金整体业绩比较基准构成为：金融机构人民币一年期定期存款基准利率（税后）+2% |
| 风险收益特征 | 本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。 |

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 | 中国民生银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 侯玉春 | 罗菲菲 |
| | 联系电话 | 010-82295160—157 | 010-58560666 |
| | 电子邮箱 | houyc@postfund.com.cn | tgbfxjdzx@cmbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 010-58511618 | 95568 |
| 传真 | | 010-82295155 | 010-58560798 |

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 | 2016 年 | 2015 年 11 月 11 日 (基金合同生效日)– 2015 年 12 月 31 日 | 2014 年 |
|---------------|----------------|--|---------|
| 本期已实现收益 | 6,429,334.03 | 2,911,757.48 | – |
| 本期利润 | 4,162,244.98 | 5,075,545.25 | – |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0239 | 0.0100 | – |
| 本期基金份额净值增长率 | 6.21% | 1.50% | – |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016 年末 | 2015 年末 | 2014 年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0780 | 0.0080 | – |
| 期末基金资产净值 | 107,501,461.32 | 306,507,070.14 | – |
| 期末基金份额净值 | 1.078 | 1.015 | – |

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. 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. 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 | 0.47% | 0.71% | 0.86% | 0.01% | -0.39% | 0.70% |
| 过去六个月 | 2.57% | 0.67% | 1.73% | 0.01% | 0.84% | 0.66% |

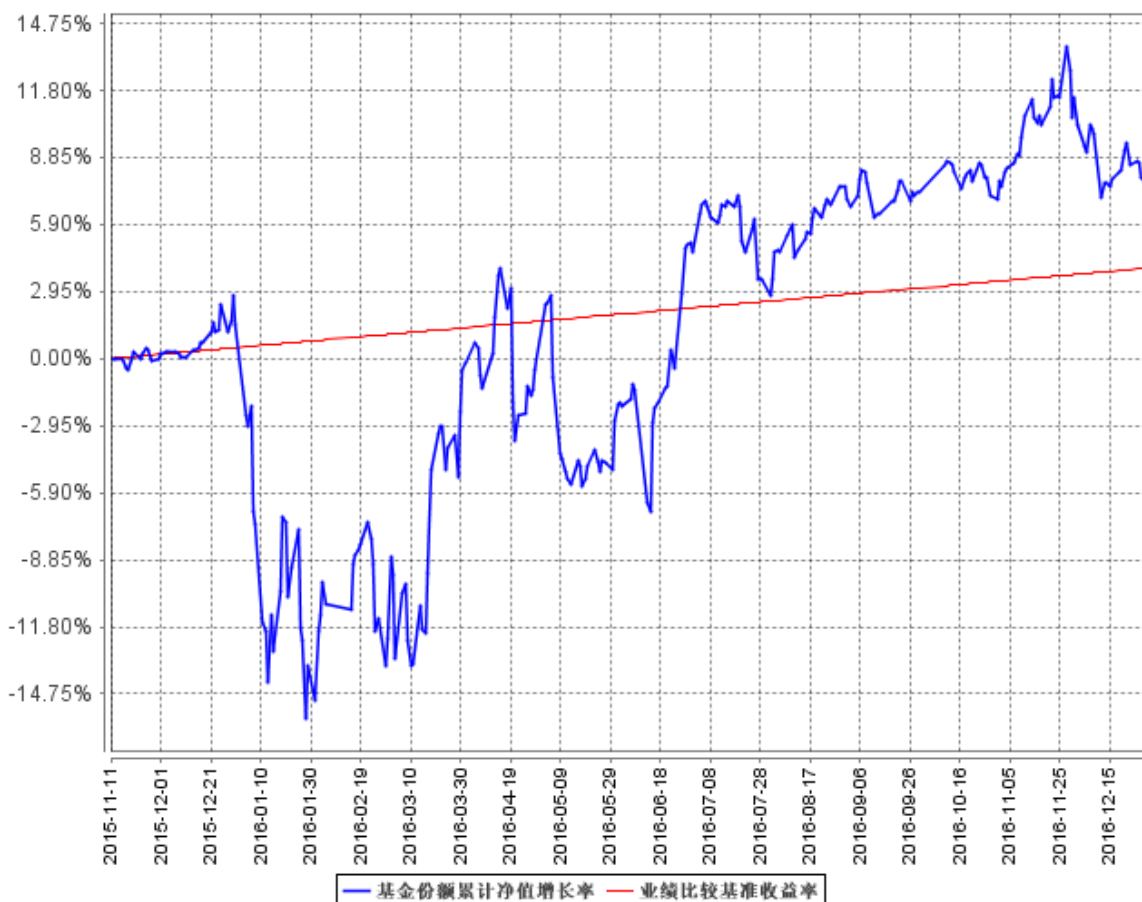
| | | | | | | |
|------------|-------|-------|-------|-------|-------|-------|
| 过去一年 | 6.21% | 1.49% | 3.49% | 0.01% | 2.72% | 1.48% |
| 自基金合同生效起至今 | 7.80% | 1.40% | 4.00% | 0.01% | 3.80% | 1.39% |

注：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。

本基金业绩衡量基准=金融机构人民币一年期定期存款基准利率（税后）+2%。

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

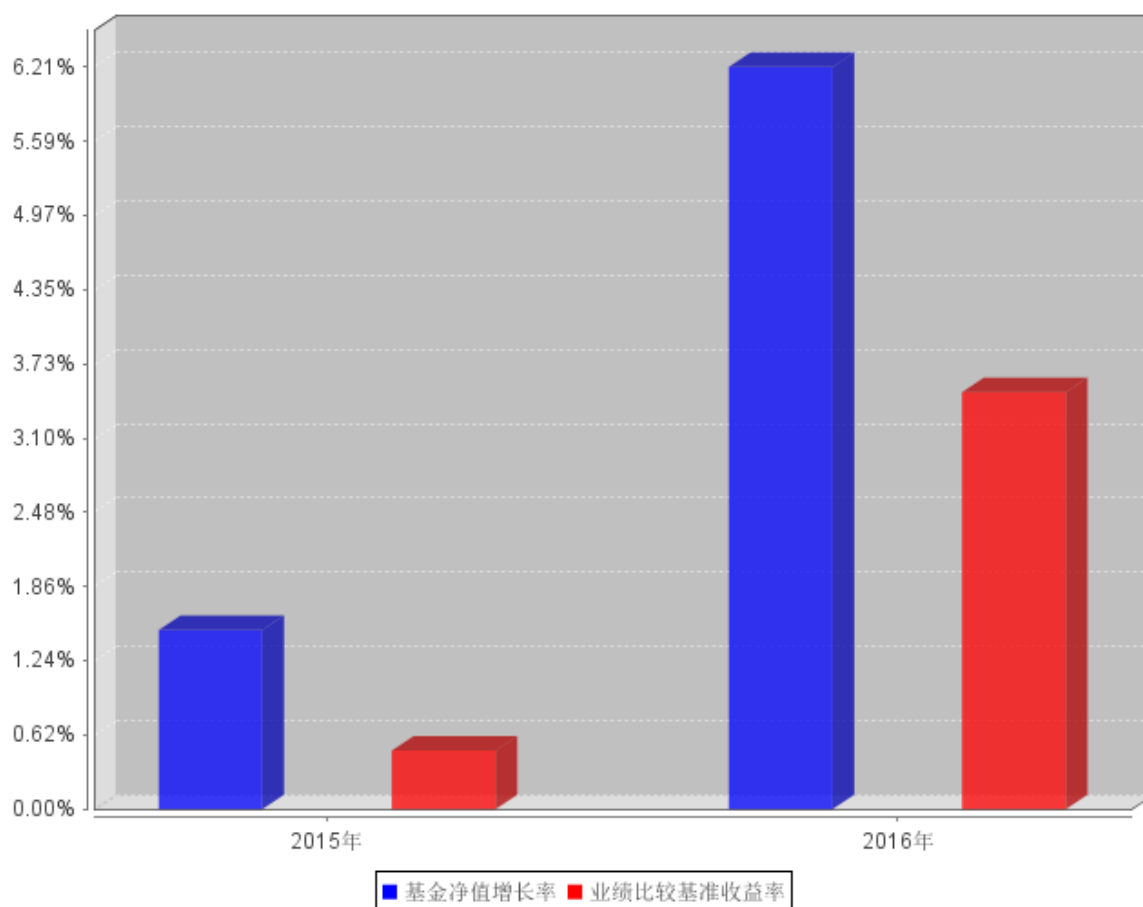
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起 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约定。

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 2016 年 12 月 31 日，本公司共管理 31 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

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、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮增力债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金。

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 | | |
| 刘涛 | 基金经理 | 2015年 11月11日 | - | 9年 | 曾任中国民族国际信托投资公司职员、安信证券股份有限公司研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心主题混合型证券投资基金基金经理助理、研究部副总经理，现任中邮创业基金管理股份有限公司投资部总经理、中邮核心优选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基金经理。 |
| 栾超 | 基金经理 | 2015年 11月11日 | - | 3年 | 曾担任中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员，现担任中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理。 |

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的基金经理注册或变更等通知的日期。

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵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、投资组合经理确认后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

2016 年，我们在投资上保持了均衡的配置策略。一方面，我们在周期行业中挑选了景气周期上行、子行业价格上涨的行业进行了配置，也投资了国企改革、一带一路等板块方向。同时在经济调结构的背景下，我们从 TMT、新能源汽车、生物医药为代表的新兴产业中，自下而上筛选出成长股进行投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.078 元，累计净值 1.078 元，本报告期份额净值增长率为 6.21%。同期业绩比较基准增长率为 4.00%。

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 2017 年，我们认为中国经济将继续企稳回升，国内经济的两大抓手地产和基建将成为稳增长的重要支撑。同时通胀很难成为威胁，全年 CPI 预计将在 3%以下，因此货币政策不会收的过紧。在巨量资金在海外投资受阻，外汇流出受限背景下，证券市场有望迎来较好的投资机会。周期性行业受益于去产能和需求回升，多周期共振下盈利将陆续得到体现；成长股受困于 IPO 加速，但高估值逐步消化后将有较好表现；白马价值股在消费升级和资产驱动下有望成为贯穿全年的主线。

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

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，本基金托管人在对中邮新思路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》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金资产，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司在中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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，中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

由中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司编制，并经过本托管人复核审查的本年度报告中的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

| | |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是 |
| 审计意见类型 | 标准无保留意见 |
| 审计报告编号 | 致同审字(2017)第 110ZA3451 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 | 中邮新思路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新思路灵活配置混合型证券投资基金（以下简称中邮新思路基金）财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表，2016 年度的利润表、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新思路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 | 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。 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。 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。 |
| 审计意见段 | 我们认为，中邮新思路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，公允反映了中邮新思路基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 年度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 | 2017 年 3 月 24 日 | |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|---------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | | 46,092,296.56 | 154,974,509.71 |
| 结算备付金 | | 6,457,834.51 | 1,793,255.77 |
| 存出保证金 | | 305,244.59 | 60,575.73 |
| 交易性金融资产 | | 53,899,120.75 | 138,538,406.50 |
| 其中：股票投资 | | 53,899,120.75 | 138,538,406.50 |
| 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 | | 1,971,937.63 | 13,844,217.17 |
| 应收利息 | | 21,838.97 | 42,875.23 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 2,175.09 | 104,849.06 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | | - | - |
| 资产总计 | | 108,750,448.10 | 309,358,689.17 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2016 年 12 月 31 日 | 上年度末 2015 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 22,683.44 | 1,616,813.46 |
| 应付管理人报酬 | | 140,217.80 | 577,275.97 |
| 应付托管费 | | 23,369.65 | 96,212.68 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | | 572,681.07 | 539,285.80 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | | 490,034.82 | 22,031.12 |
| 负债合计 | | 1,248,986.78 | 2,851,619.03 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | | 99,724,161.06 | 302,122,786.84 |
| 未分配利润 | | 7,777,300.26 | 4,384,283.30 |
| 所有者权益合计 | | 107,501,461.32 | 306,507,070.14 |
| 负债和所有者权益总计 | | 108,750,448.10 | 309,358,689.17 |

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日基金份额净值 1.078 元，基金份额总额 99,724,161.06 份。

7.2 利润表

会计主体：中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2015 年 11 月 11 日 (基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日 |
|-------------------|-----|---|---|
| 一、收入 | | 14,156,457.60 | 7,140,569.54 |
| 1. 利息收入 | | 709,398.77 | 1,089,541.44 |
| 其中：存款利息收入 | | 445,895.12 | 1,048,174.38 |
| 债券利息收入 | | 42,440.21 | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 221,063.44 | 41,367.06 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 15,080,083.87 | 2,708,629.14 |
| 其中：股票投资收益 | | 14,731,094.96 | 2,708,629.14 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | | -14,330.00 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | | 25,180.00 | - |

| | | | |
|----------------------------|-----------|---------------|--------------|
| 股利收益 | | 338,138.91 | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | | -2,267,089.05 | 2,163,787.77 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | | 634,064.01 | 1,178,611.19 |
| 减：二、费用 | | 9,994,212.62 | 2,065,024.29 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.8.2.1 | 2,617,906.38 | 1,053,869.12 |
| 2. 托管费 | 7.4.8.2.2 | 436,317.74 | 175,644.85 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.8.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | | 6,440,887.74 | 813,353.37 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 其他费用 | | 499,100.76 | 22,156.95 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 4,162,244.98 | 5,075,545.25 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 4,162,244.98 | 5,075,545.25 |

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日 | | |
|-----------------------------------|--|--------------|-----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 302,122,786.84 | 4,384,283.30 | 306,507,070.14 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 4,162,244.98 | 4,162,244.98 |
| 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） | -202,398,625.78 | -769,228.02 | -203,167,853.80 |
| 其中：1. 基金申购款 | 51,975,195.63 | 691,252.55 | 52,666,448.18 |

| | | | |
|--|---|---------------|-----------------|
| 2. 基金赎回款 | -254,373,821.41 | -1,460,480.57 | -255,834,301.98 |
| 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） | 99,724,161.06 | 7,777,300.26 | 107,501,461.32 |
| 项目 | 上年度可比期间 2015年11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） | 610,011,199.82 | - | 610,011,199.82 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期净利润） | - | 5,075,545.25 | 5,075,545.25 |
| 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） | -307,888,412.98 | -691,261.95 | -308,579,674.93 |
| 其中：1. 基金申购款 | 5,649,948.15 | 66,339.06 | 5,716,287.21 |
| 2. 基金赎回款 | -313,538,361.13 | -757,601.01 | -314,295,962.14 |
| 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） | 302,122,786.84 | 4,384,283.30 | 306,507,070.14 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 - 至 - 财务报表由下列负责人签署：

周克
基金管理人负责人

周克
主管会计工作负责人

吕伟卓
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中邮新思路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”）证监基金字[2015]572号《关于核准中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，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《中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2015 年 11 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 610,011,199.82 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2015)第 110ZC0542 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，基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮新思路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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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等合计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%。

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 重要会计政策和会计估计

无

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

7.4.6 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[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[2015]101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》、财税[2016]36号《财政部 国家税务总局 关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部 国家税务总局 关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《财政部 国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1. 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，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。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；上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
2. 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。
3. 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。
4. 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产（质押式、买断式）；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

7.4.7 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 |
| 中国民生银行股份有限公司 | 基金托管人、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 |
| 中国邮政储蓄银行有限责任公司 | 基金管理人股东控股的公司、基金代销机构 |
| 中国邮政集团公司 | 基金管理人的股东 |
| 三井住友银行股份有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 首创京都期货有限公司 | 基金管理人股东控股的公司 |

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易的情况。

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

无

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年 12月31日 | 上年度可比期间 2015年11月11日(基金合同生效 日)至2015年12月31日 |
|-----------------|---------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,617,906.38 | 1,053,869.12 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 725,294.46 | 198,245.64 |

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

1.50%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 × 1.50% / 当年天数

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2016年1月1日至2016年 12月31日 | 上年度可比期间 2015年11月11日(基金合同生效 日)至2015年12月31日 |
|----------------|---------------------------------|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 436,317.74 | 175,644.85 |

注：支付基金托管人中国民生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%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

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.8.4.2 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

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。

7.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日 | | 上年度可比期间 2015年11月11日(基金合同生效日)至 2015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 |
| 民生银行股份 有限公司 | 46,092,296.56 | 390,388.92 | 154,974,509.71 | 416,414.98 |

7.4.8.6 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。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内通过首创京都期货有限公司进行期货交易的合同/名义金额为 4,321,600.00 元，占当期期货成交总额的比例为 100%。本报告期末由首创京都期货有限公司保管的期货备付金期末余额为 5,024,952.29 元，当期产生的利息收入为 16,201.99 元。上年度未与首创京都期货有限公司合作，因此无上年度比较数据。

7.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本期末本基金未持有因认购/新发而流通受限证券。

7.4.9.2 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 |
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|
|------|------|------|------|--------|------|--------|-------|--------|--------|----|

| | | | | | | | | | | |
|--------|-----------|-------------------------|----------|-------|-----------------------|-------|---------|--------------|--------------|---|
| 300076 | GQY 视讯 | 2016 年 10月 17日 | 重大 事项 | 15.26 | 2017 年 3月 1日 | 13.73 | 200,000 | 3,131,322.40 | 3,052,000.00 | - |
|--------|-----------|-------------------------|----------|-------|-----------------------|-------|---------|--------------|--------------|---|

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.10 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 | 53,899,120.75 | 49.56 |
| | 其中：股票 | 53,899,120.75 | 49.56 |
| 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 | 52,550,131.07 | 48.32 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,301,196.28 | 2.12 |
| 8 | 合计 | 108,750,448.10 | 100.00 |

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项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

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 14,935,988.35 | 13.89 |
| C | 制造业 | 24,401,800.00 | 22.70 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 1,070,000.00 | 1.00 |
| F | 批发和零售业 | 2,961,332.40 | 2.75 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 6,604,000.00 | 6.14 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,200,000.00 | 2.05 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 1,726,000.00 | 1.61 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| 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 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 53,899,120.75 | 50.14 |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

8.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未投资沪港通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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 | 300321 | 同大股份 | 220,000 | 8,492,000.00 | 7.90 |
| 2 | 601899 | 紫金矿业 | 1,500,000 | 5,010,000.00 | 4.66 |
| 3 | 300084 | 海默科技 | 399,999 | 4,659,988.35 | 4.33 |
| 4 | 300157 | 恒泰艾普 | 400,000 | 3,676,000.00 | 3.42 |
| 5 | 600033 | 福建高速 | 1,000,000 | 3,460,000.00 | 3.22 |
| 6 | 600103 | 青山纸业 | 600,000 | 3,390,000.00 | 3.15 |
| 7 | 000902 | 新洋丰 | 300,000 | 3,378,000.00 | 3.14 |
| 8 | 601919 | 中远海控 | 600,000 | 3,144,000.00 | 2.92 |
| 9 | 300076 | GQY 视讯 | 200,000 | 3,052,000.00 | 2.84 |
| 10 | 002758 | 华通医药 | 99,910 | 2,961,332.40 | 2.75 |

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 002104 | 恒宝股份 | 26,982,119.36 | 8.80 |
| 2 | 002165 | 红宝丽 | 25,030,991.32 | 8.17 |
| 3 | 600497 | 驰宏锌锗 | 24,418,893.34 | 7.97 |
| 4 | 300008 | 天海防务 | 24,010,090.89 | 7.83 |
| 5 | 300263 | 隆华节能 | 23,941,270.06 | 7.81 |
| 6 | 600322 | 天房发展 | 21,878,089.78 | 7.14 |
| 7 | 600549 | 厦门钨业 | 21,820,699.54 | 7.12 |
| 8 | 600259 | 广晟有色 | 21,791,756.68 | 7.11 |
| 9 | 000060 | 中金岭南 | 21,724,255.08 | 7.09 |
| 10 | 600990 | 四创电子 | 20,681,820.28 | 6.75 |
| 11 | 300084 | 海默科技 | 19,245,558.94 | 6.28 |
| 12 | 600693 | 东百集团 | 19,120,875.75 | 6.24 |
| 13 | 300352 | 北信源 | 19,069,071.60 | 6.22 |
| 14 | 002667 | 鞍重股份 | 18,915,891.72 | 6.17 |
| 15 | 300061 | 康耐特 | 17,942,218.54 | 5.85 |
| 16 | 300246 | 宝莱特 | 17,533,037.37 | 5.72 |
| 17 | 600386 | 北巴传媒 | 16,796,954.39 | 5.48 |
| 18 | 600303 | 曙光股份 | 16,295,917.16 | 5.32 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 19 | 601088 | 中国神华 | 16,275,045.93 | 5.31 |
| 20 | 600103 | 青山纸业 | 15,799,405.00 | 5.15 |
| 21 | 002019 | 亿帆鑫富 | 15,319,348.00 | 5.00 |
| 22 | 300010 | 立思辰 | 15,197,428.50 | 4.96 |
| 23 | 002167 | 东方锆业 | 14,330,448.47 | 4.68 |
| 24 | 300119 | 瑞普生物 | 14,272,649.34 | 4.66 |
| 25 | 600240 | 华业资本 | 14,018,670.18 | 4.57 |
| 26 | 000938 | 紫光股份 | 13,852,536.20 | 4.52 |
| 27 | 002001 | 新和成 | 13,573,070.09 | 4.43 |
| 28 | 000971 | 高升控股 | 13,300,752.85 | 4.34 |
| 29 | 002056 | 横店东磁 | 13,256,707.99 | 4.33 |
| 30 | 603002 | 宏昌电子 | 12,808,159.34 | 4.18 |
| 31 | 603268 | 松发股份 | 12,094,239.65 | 3.95 |
| 32 | 600777 | 新潮能源 | 12,082,912.27 | 3.94 |
| 33 | 000630 | 铜陵有色 | 12,047,118.87 | 3.93 |
| 34 | 300143 | 星河生物 | 11,991,139.55 | 3.91 |
| 35 | 000960 | 锡业股份 | 11,974,165.92 | 3.91 |
| 36 | 300456 | 耐威科技 | 11,851,977.00 | 3.87 |
| 37 | 002036 | 联创电子 | 11,593,922.24 | 3.78 |
| 38 | 600963 | 岳阳林纸 | 11,575,058.23 | 3.78 |
| 39 | 002025 | 航天电器 | 11,427,563.65 | 3.73 |
| 40 | 603369 | 今世缘 | 11,085,161.98 | 3.62 |
| 41 | 300416 | 苏试试验 | 11,078,339.61 | 3.61 |
| 42 | 600056 | 中国医药 | 11,073,774.74 | 3.61 |
| 43 | 002700 | 新疆浩源 | 11,039,333.61 | 3.60 |
| 44 | 300076 | GQY 视讯 | 10,856,689.40 | 3.54 |
| 45 | 000525 | 红太阳 | 10,641,103.00 | 3.47 |
| 46 | 300230 | 永利股份 | 10,572,584.00 | 3.45 |
| 47 | 600593 | 大连圣亚 | 10,555,530.80 | 3.44 |
| 48 | 300022 | 吉峰农机 | 10,531,151.59 | 3.44 |
| 49 | 002650 | 加加食品 | 10,510,563.50 | 3.43 |
| 50 | 002522 | 浙江众成 | 10,470,048.87 | 3.42 |
| 51 | 300264 | 佳创视讯 | 10,409,747.75 | 3.40 |
| 52 | 002657 | 中科金财 | 10,393,597.26 | 3.39 |
| 53 | 600861 | 北京城乡 | 10,262,552.00 | 3.35 |
| 54 | 300093 | 金刚玻璃 | 10,092,662.00 | 3.29 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 55 | 603968 | 醋化股份 | 10,031,943.00 | 3.27 |
| 56 | 000709 | 河钢股份 | 9,969,797.25 | 3.25 |
| 57 | 000632 | 三木集团 | 9,859,078.40 | 3.22 |
| 58 | 600532 | 宏达矿业 | 9,770,506.05 | 3.19 |
| 59 | 300181 | 佐力药业 | 9,769,534.05 | 3.19 |
| 60 | 600352 | 浙江龙盛 | 9,637,757.00 | 3.14 |
| 61 | 300321 | 同大股份 | 9,486,711.22 | 3.10 |
| 62 | 600651 | 飞乐音响 | 9,390,016.26 | 3.06 |
| 63 | 600667 | 太极实业 | 9,389,130.96 | 3.06 |
| 64 | 601336 | 新华保险 | 9,311,128.75 | 3.04 |
| 65 | 600730 | 中国高科 | 9,286,358.00 | 3.03 |
| 66 | 600755 | 厦门国贸 | 9,270,142.17 | 3.02 |
| 67 | 300379 | 东方通 | 9,237,311.00 | 3.01 |
| 68 | 601313 | 江南嘉捷 | 9,177,247.50 | 2.99 |
| 69 | 600216 | 浙江医药 | 9,102,916.31 | 2.97 |
| 70 | 300031 | 宝通科技 | 9,098,168.00 | 2.97 |
| 71 | 002299 | 圣农发展 | 9,094,011.30 | 2.97 |
| 72 | 000970 | 中科三环 | 9,085,390.72 | 2.96 |
| 73 | 002023 | 海特高新 | 9,027,334.69 | 2.95 |
| 74 | 000851 | 高鸿股份 | 8,978,205.64 | 2.93 |
| 75 | 000779 | 三毛派神 | 8,959,585.06 | 2.92 |
| 76 | 300290 | 荣科科技 | 8,854,357.72 | 2.89 |
| 77 | 300067 | 安诺其 | 8,816,337.00 | 2.88 |
| 78 | 000558 | 莱茵体育 | 8,740,251.00 | 2.85 |
| 79 | 000411 | 英特集团 | 8,722,719.00 | 2.85 |
| 80 | 600363 | 联创光电 | 8,677,268.12 | 2.83 |
| 81 | 300096 | 易联众 | 8,598,526.00 | 2.81 |
| 82 | 000797 | 中国武夷 | 8,514,490.37 | 2.78 |
| 83 | 600432 | *ST 吉恩 | 8,510,876.42 | 2.78 |
| 84 | 002406 | 远东传动 | 8,496,523.58 | 2.77 |
| 85 | 002280 | 联络互动 | 8,478,892.00 | 2.77 |
| 86 | 603003 | 龙宇燃油 | 8,474,088.14 | 2.76 |
| 87 | 002444 | 巨星科技 | 8,444,810.82 | 2.76 |
| 88 | 002537 | 海立美达 | 8,422,446.05 | 2.75 |
| 89 | 002761 | 多喜爱 | 8,379,825.00 | 2.73 |
| 90 | 600114 | 东睦股份 | 8,358,381.54 | 2.73 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 91 | 000404 | 华意压缩 | 8,223,556.82 | 2.68 |
| 92 | 601021 | 春秋航空 | 8,193,119.08 | 2.67 |
| 93 | 603788 | 宁波高发 | 8,152,610.00 | 2.66 |
| 94 | 600108 | 亚盛集团 | 7,853,000.00 | 2.56 |
| 95 | 300062 | 中能电气 | 7,840,910.71 | 2.56 |
| 96 | 002079 | 苏州固锔 | 7,820,752.00 | 2.55 |
| 97 | 600189 | 吉林森工 | 7,793,042.00 | 2.54 |
| 98 | 002655 | 共达电声 | 7,584,695.90 | 2.47 |
| 99 | 000567 | 海德股份 | 7,517,635.17 | 2.45 |
| 100 | 000813 | 天山纺织 | 7,496,465.84 | 2.45 |
| 101 | 600729 | 重庆百货 | 7,381,834.36 | 2.41 |
| 102 | 601919 | 中远海控 | 7,288,000.00 | 2.38 |
| 103 | 300025 | 华星创业 | 7,284,815.92 | 2.38 |
| 104 | 600332 | 白云山 | 7,245,758.00 | 2.36 |
| 105 | 600146 | 商赢环球 | 7,180,855.00 | 2.34 |
| 106 | 601600 | 中国铝业 | 7,126,000.00 | 2.32 |
| 107 | 300249 | 依米康 | 7,073,703.20 | 2.31 |
| 108 | 002108 | 沧州明珠 | 7,058,619.01 | 2.30 |
| 109 | 600068 | 葛洲坝 | 7,018,132.10 | 2.29 |
| 110 | 000977 | 浪潮信息 | 6,954,046.00 | 2.27 |
| 111 | 002734 | 利民股份 | 6,942,227.00 | 2.26 |
| 112 | 600208 | 新潮中宝 | 6,940,143.81 | 2.26 |
| 113 | 300041 | 回天新材 | 6,913,475.98 | 2.26 |
| 114 | 300287 | 飞利信 | 6,893,711.05 | 2.25 |
| 115 | 600687 | 刚泰控股 | 6,890,583.05 | 2.25 |
| 116 | 600128 | 弘业股份 | 6,874,837.06 | 2.24 |
| 117 | 600284 | 浦东建设 | 6,815,798.00 | 2.22 |
| 118 | 600033 | 福建高速 | 6,772,000.00 | 2.21 |
| 119 | 000523 | 广州浪奇 | 6,763,480.58 | 2.21 |
| 120 | 300161 | 华中数控 | 6,754,026.00 | 2.20 |
| 121 | 300190 | 维尔利 | 6,748,461.00 | 2.20 |
| 122 | 300375 | 鹏翎股份 | 6,745,561.73 | 2.20 |
| 123 | 002551 | 尚荣医疗 | 6,739,856.00 | 2.20 |
| 124 | 002068 | 黑猫股份 | 6,703,519.38 | 2.19 |
| 125 | 002502 | 骅威文化 | 6,488,199.20 | 2.12 |
| 126 | 601899 | 紫金矿业 | 6,400,000.00 | 2.09 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 127 | 300182 | 捷成股份 | 6,369,784.00 | 2.08 |
| 128 | 600127 | 金健米业 | 6,317,658.80 | 2.06 |
| 129 | 300409 | 道氏技术 | 6,309,732.00 | 2.06 |
| 130 | 600079 | 人福医药 | 6,253,214.00 | 2.04 |

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 | 300061 | 康耐特 | 39,643,291.07 | 12.93 |
| 2 | 002165 | 红宝丽 | 28,345,148.88 | 9.25 |
| 3 | 002104 | 恒宝股份 | 28,181,919.77 | 9.19 |
| 4 | 300263 | 隆华节能 | 26,799,936.00 | 8.74 |
| 5 | 600497 | 驰宏锌锗 | 25,581,562.28 | 8.35 |
| 6 | 300008 | 天海防务 | 25,572,036.42 | 8.34 |
| 7 | 600322 | 天房发展 | 23,432,032.72 | 7.64 |
| 8 | 000060 | 中金岭南 | 23,042,518.04 | 7.52 |
| 9 | 600990 | 四创电子 | 22,645,650.00 | 7.39 |
| 10 | 600259 | 广晟有色 | 22,550,005.64 | 7.36 |
| 11 | 600549 | 厦门钨业 | 21,295,578.98 | 6.95 |
| 12 | 300352 | 北信源 | 21,084,208.58 | 6.88 |
| 13 | 600693 | 东百集团 | 20,875,345.86 | 6.81 |
| 14 | 600303 | 曙光股份 | 18,439,211.02 | 6.02 |
| 15 | 600386 | 北巴传媒 | 16,996,946.20 | 5.55 |
| 16 | 300246 | 宝莱特 | 16,322,345.60 | 5.33 |
| 17 | 002667 | 鞍重股份 | 16,158,306.00 | 5.27 |
| 18 | 300010 | 立思辰 | 16,148,256.91 | 5.27 |
| 19 | 002167 | 东方锆业 | 15,868,918.84 | 5.18 |
| 20 | 300119 | 瑞普生物 | 15,542,895.09 | 5.07 |
| 21 | 601088 | 中国神华 | 15,485,058.00 | 5.05 |
| 22 | 300084 | 海默科技 | 15,123,031.48 | 4.93 |
| 23 | 603002 | 宏昌电子 | 14,883,975.84 | 4.86 |
| 24 | 002001 | 新和成 | 14,862,084.96 | 4.85 |
| 25 | 002019 | 亿帆鑫富 | 14,632,414.60 | 4.77 |
| 26 | 002056 | 横店东磁 | 14,548,255.97 | 4.75 |
| 27 | 600103 | 青山纸业 | 13,243,218.30 | 4.32 |
| 28 | 600240 | 华业资本 | 12,777,414.00 | 4.17 |

| | | | | |
|----|--------|--------|---------------|------|
| 29 | 600777 | 新潮能源 | 12,553,559.00 | 4.10 |
| 30 | 600861 | 北京城乡 | 12,531,014.56 | 4.09 |
| 31 | 603268 | 松发股份 | 12,435,634.20 | 4.06 |
| 32 | 600963 | 岳阳林纸 | 12,411,922.45 | 4.05 |
| 33 | 600667 | 太极实业 | 12,139,222.88 | 3.96 |
| 34 | 000938 | 紫光股份 | 12,137,836.06 | 3.96 |
| 35 | 000525 | 红太阳 | 11,930,198.15 | 3.89 |
| 36 | 002645 | 华宏科技 | 11,885,971.00 | 3.88 |
| 37 | 000971 | 高升控股 | 11,881,078.60 | 3.88 |
| 38 | 000630 | 铜陵有色 | 11,844,000.00 | 3.86 |
| 39 | 002655 | 共达电声 | 11,710,229.39 | 3.82 |
| 40 | 300416 | 苏试试验 | 11,606,378.80 | 3.79 |
| 41 | 300456 | 耐威科技 | 11,599,101.27 | 3.78 |
| 42 | 300230 | 永利股份 | 11,550,644.54 | 3.77 |
| 43 | 300264 | 佳创视讯 | 11,492,078.28 | 3.75 |
| 44 | 300143 | 星河生物 | 11,314,141.00 | 3.69 |
| 45 | 002036 | 联创电子 | 11,302,061.50 | 3.69 |
| 46 | 300379 | 东方通 | 11,254,716.98 | 3.67 |
| 47 | 300022 | 吉峰农机 | 11,174,751.04 | 3.65 |
| 48 | 600056 | 中国医药 | 11,155,499.04 | 3.64 |
| 49 | 600770 | 综艺股份 | 11,090,382.11 | 3.62 |
| 50 | 603369 | 今世缘 | 11,016,696.44 | 3.59 |
| 51 | 000960 | 锡业股份 | 10,903,846.00 | 3.56 |
| 52 | 000970 | 中科三环 | 10,811,617.00 | 3.53 |
| 53 | 002650 | 加加食品 | 10,768,375.50 | 3.51 |
| 54 | 002522 | 浙江众成 | 10,591,367.38 | 3.46 |
| 55 | 002025 | 航天电器 | 10,572,218.40 | 3.45 |
| 56 | 300181 | 佐力药业 | 10,547,716.18 | 3.44 |
| 57 | 600306 | *ST 商城 | 10,518,608.81 | 3.43 |
| 58 | 601313 | 江南嘉捷 | 10,367,473.46 | 3.38 |
| 59 | 600593 | 大连圣亚 | 10,194,163.75 | 3.33 |
| 60 | 600651 | 飞乐音响 | 10,027,125.08 | 3.27 |
| 61 | 600173 | 卧龙地产 | 10,008,916.80 | 3.27 |
| 62 | 601336 | 新华保险 | 9,989,983.16 | 3.26 |
| 63 | 603968 | 醋化股份 | 9,980,310.25 | 3.26 |
| 64 | 000411 | 英特集团 | 9,973,519.36 | 3.25 |
| 65 | 000709 | 河钢股份 | 9,944,500.94 | 3.24 |
| 66 | 002467 | 二六三 | 9,939,884.64 | 3.24 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|--------------|------|
| 67 | 000632 | 三木集团 | 9,917,996.56 | 3.24 |
| 68 | 600352 | 浙江龙盛 | 9,808,271.00 | 3.20 |
| 69 | 600532 | 宏达矿业 | 9,778,178.48 | 3.19 |
| 70 | 300290 | 荣科科技 | 9,770,525.85 | 3.19 |
| 71 | 002299 | 圣农发展 | 9,752,534.60 | 3.18 |
| 72 | 002657 | 中科金财 | 9,751,305.00 | 3.18 |
| 73 | 600755 | 厦门国贸 | 9,732,188.81 | 3.18 |
| 74 | 000404 | 华意压缩 | 9,678,380.94 | 3.16 |
| 75 | 300096 | 易联众 | 9,314,077.20 | 3.04 |
| 76 | 000558 | 莱茵体育 | 9,136,043.70 | 2.98 |
| 77 | 600730 | 中国高科 | 9,086,196.00 | 2.96 |
| 78 | 600216 | 浙江医药 | 9,051,238.77 | 2.95 |
| 79 | 000779 | 三毛派神 | 9,041,542.20 | 2.95 |
| 80 | 000851 | 高鸿股份 | 9,022,712.00 | 2.94 |
| 81 | 002700 | 新疆浩源 | 8,945,888.45 | 2.92 |
| 82 | 300067 | 安诺其 | 8,922,906.20 | 2.91 |
| 83 | 002079 | 苏州固锝 | 8,829,689.06 | 2.88 |
| 84 | 002023 | 海特高新 | 8,759,507.16 | 2.86 |
| 85 | 300031 | 宝通科技 | 8,683,241.00 | 2.83 |
| 86 | 000813 | 天山纺织 | 8,591,037.02 | 2.80 |
| 87 | 002406 | 远东传动 | 8,483,760.00 | 2.77 |
| 88 | 002537 | 海立美达 | 8,483,047.80 | 2.77 |
| 89 | 600114 | 东睦股份 | 8,481,951.88 | 2.77 |
| 90 | 600432 | *ST 吉恩 | 8,479,009.00 | 2.77 |
| 91 | 300041 | 回天新材 | 8,470,842.37 | 2.76 |
| 92 | 600363 | 联创光电 | 8,438,984.15 | 2.75 |
| 93 | 002444 | 巨星科技 | 8,233,200.21 | 2.69 |
| 94 | 002761 | 多喜爱 | 8,193,364.00 | 2.67 |
| 95 | 300076 | GQY 视讯 | 8,188,072.88 | 2.67 |
| 96 | 603003 | 龙宇燃油 | 8,166,272.50 | 2.66 |
| 97 | 002005 | 德豪润达 | 8,161,212.35 | 2.66 |
| 98 | 000567 | 海德股份 | 7,926,095.00 | 2.59 |
| 99 | 002280 | 联络互动 | 7,890,557.48 | 2.57 |
| 100 | 601021 | 春秋航空 | 7,827,238.00 | 2.55 |
| 101 | 300062 | 中能电气 | 7,820,622.34 | 2.55 |
| 102 | 300093 | 金刚玻璃 | 7,796,379.00 | 2.54 |
| 103 | 300279 | 和晶科技 | 7,755,226.62 | 2.53 |
| 104 | 600189 | 吉林森工 | 7,713,260.00 | 2.52 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 105 | 300375 | 鹏翎股份 | 7,712,851.88 | 2.52 |
| 106 | 600729 | 重庆百货 | 7,646,888.72 | 2.49 |
| 107 | 002108 | 沧州明珠 | 7,573,330.00 | 2.47 |
| 108 | 000797 | 中国武夷 | 7,543,391.75 | 2.46 |
| 109 | 600108 | 亚盛集团 | 7,435,613.00 | 2.43 |
| 110 | 002224 | 三力士 | 7,344,711.40 | 2.40 |
| 111 | 300182 | 捷成股份 | 7,305,997.00 | 2.38 |
| 112 | 603788 | 宁波高发 | 7,294,372.00 | 2.38 |
| 113 | 002551 | 尚荣医疗 | 7,206,859.39 | 2.35 |
| 114 | 002734 | 利民股份 | 7,176,571.00 | 2.34 |
| 115 | 600068 | 葛洲坝 | 7,145,059.10 | 2.33 |
| 116 | 600332 | 白云山 | 7,107,482.00 | 2.32 |
| 117 | 600146 | 商赢环球 | 7,018,668.18 | 2.29 |
| 118 | 600208 | 新湖中宝 | 7,004,000.00 | 2.29 |
| 119 | 300249 | 依米康 | 7,002,300.00 | 2.28 |
| 120 | 300287 | 飞利信 | 6,928,968.98 | 2.26 |
| 121 | 000523 | 广州浪奇 | 6,908,531.96 | 2.25 |
| 122 | 002068 | 黑猫股份 | 6,807,681.51 | 2.22 |
| 123 | 300190 | 维尔利 | 6,806,675.40 | 2.22 |
| 124 | 600284 | 浦东建设 | 6,751,566.00 | 2.20 |
| 125 | 002530 | 丰东股份 | 6,667,434.57 | 2.18 |
| 126 | 601600 | 中国铝业 | 6,615,370.01 | 2.16 |
| 127 | 300161 | 华中数控 | 6,416,358.00 | 2.09 |
| 128 | 601766 | 中国中车 | 6,388,023.80 | 2.08 |
| 129 | 300049 | 福瑞股份 | 6,361,088.84 | 2.08 |
| 130 | 300409 | 道氏技术 | 6,354,375.85 | 2.07 |
| 131 | 002502 | 骅威文化 | 6,319,773.30 | 2.06 |
| 132 | 000977 | 浪潮信息 | 6,311,856.81 | 2.06 |
| 133 | 600079 | 人福医药 | 6,284,461.25 | 2.05 |
| 134 | 600127 | 金健米业 | 6,191,229.32 | 2.02 |

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 | 2,054,020,086.81 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,151,123,378.47 |

注：买卖金额均按卖出买卖金额（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投资。

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投资。

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持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本期未参与国债期货投资。

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

本基金本期未参与国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本期末未参与国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

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 | 305,244.59 |
| 2 | 应收证券清算款 | 1,971,937.63 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 21,838.97 |
| 5 | 应收申购款 | 2,175.09 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,301,196.28 |

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处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|--------|--------------|---------------|----------|
| 1 | 300076 | GQY 视讯 | 3,052,000.00 | 2.84 | 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 |
| 2,089 | 47,737.75 | 20,100,813.68 | 20.16% | 79,623,347.38 | 79.84% |

9.3 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 | 304,044.53 | 0.3049% |

9.4 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 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 10~50 |

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2015年11月11日）基金份额总额 | 610,011,199.82 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 302,122,786.84 |
| 本报告期基金总申购份额 | 51,975,195.63 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 254,373,821.41 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 99,724,161.06 |

§ 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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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玖万元整，目前该会计师事务所已为本基金提供审计服务二个会计年度。

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 | |
| | | | | | | |

| | | | | | |
|------|-------------------|--------|--------------|--------|---|
| 国泰君安 | 12,613,026,164.19 | 62.14% | 2,433,513.48 | 62.14% | - |
| 中泰证券 | 11,592,008,007.03 | 37.86% | 1,482,632.96 | 37.86% | - |

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | 475,000,000.00 | 100.00% | - | - |

中邮创业基金管理股份有限公司
2017 年 3 月 31 日