

# 中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告

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 重要提示及目录

### 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。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容.....	15
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>16</b>
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	44
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	54

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	54
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.....	54
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.....	54
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	54
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	54
8.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>55</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	55
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>56</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>56</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
11.4 基金投资策略的改变.....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
11.8 其他重大事件.....	58
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>66</b>
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录.....	66
13.2 存放地点.....	67
13.3 查阅方式.....	67

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金
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</p>

	<p>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
注册地址		北京市东城区和平里中街乙16号	北京市西城区复兴门内大街2号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙16号	北京市西城区复兴门内大街2号
邮政编码		100013	100031
法定代表人		吴涛	洪崎

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
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

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙人）	北京市建国门外大街22号赛特广场五层
注册登记机构	中邮创业基金管理股份有限公司	北京市东城区和平里中街乙16号

### §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
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
本期加权平均净值利润率	2.40%	1.00%
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
期末可供分配利润	7,777,300.26	2,405,138.00
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
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	7.80%	1.50%

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

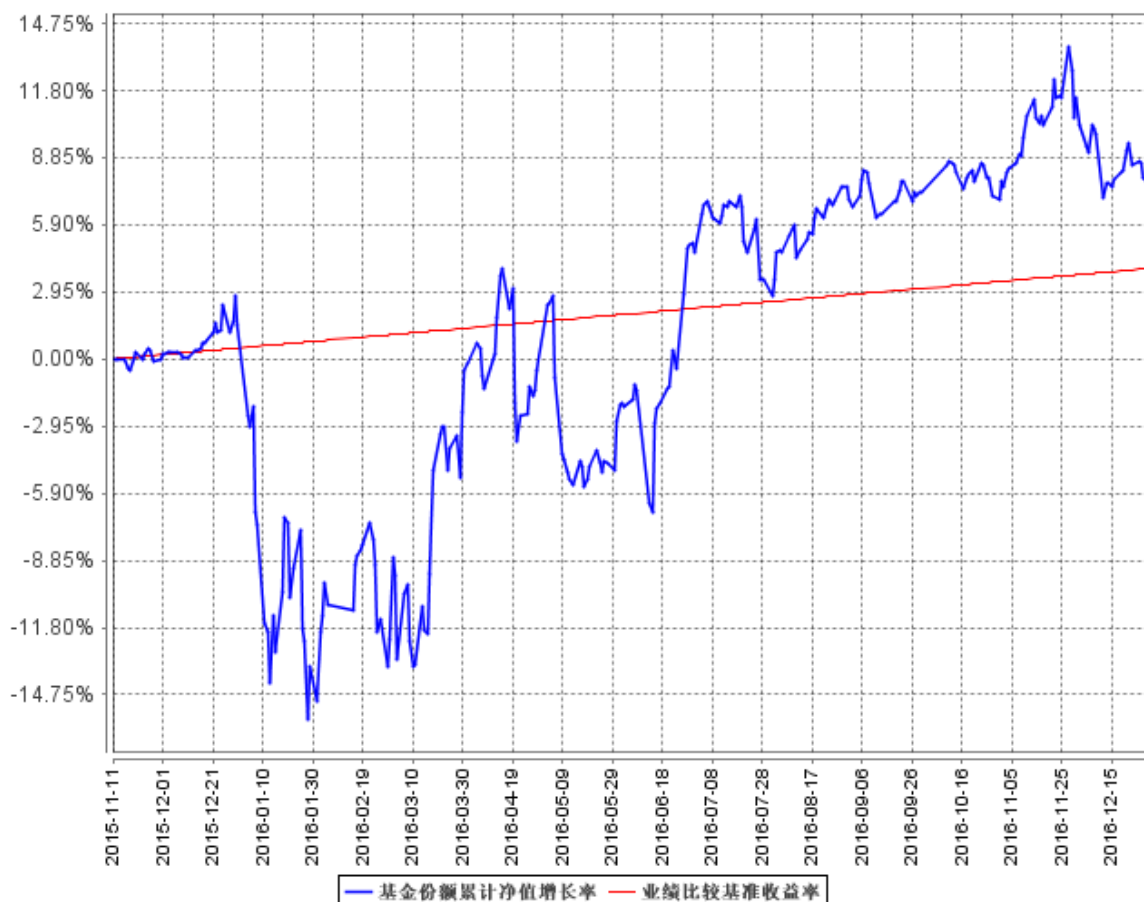
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.47%	0.71%	0.86%	0.01%	-0.39%	0.70%
过去六个月	2.57%	0.67%	1.73%	0.01%	0.84%	0.66%
过去一年	6.21%	1.49%	3.49%	0.01%	2.72%	1.48%
自基金合同生效起至今	7.80%	1.40%	4.00%	0.01%	3.80%	1.39%

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

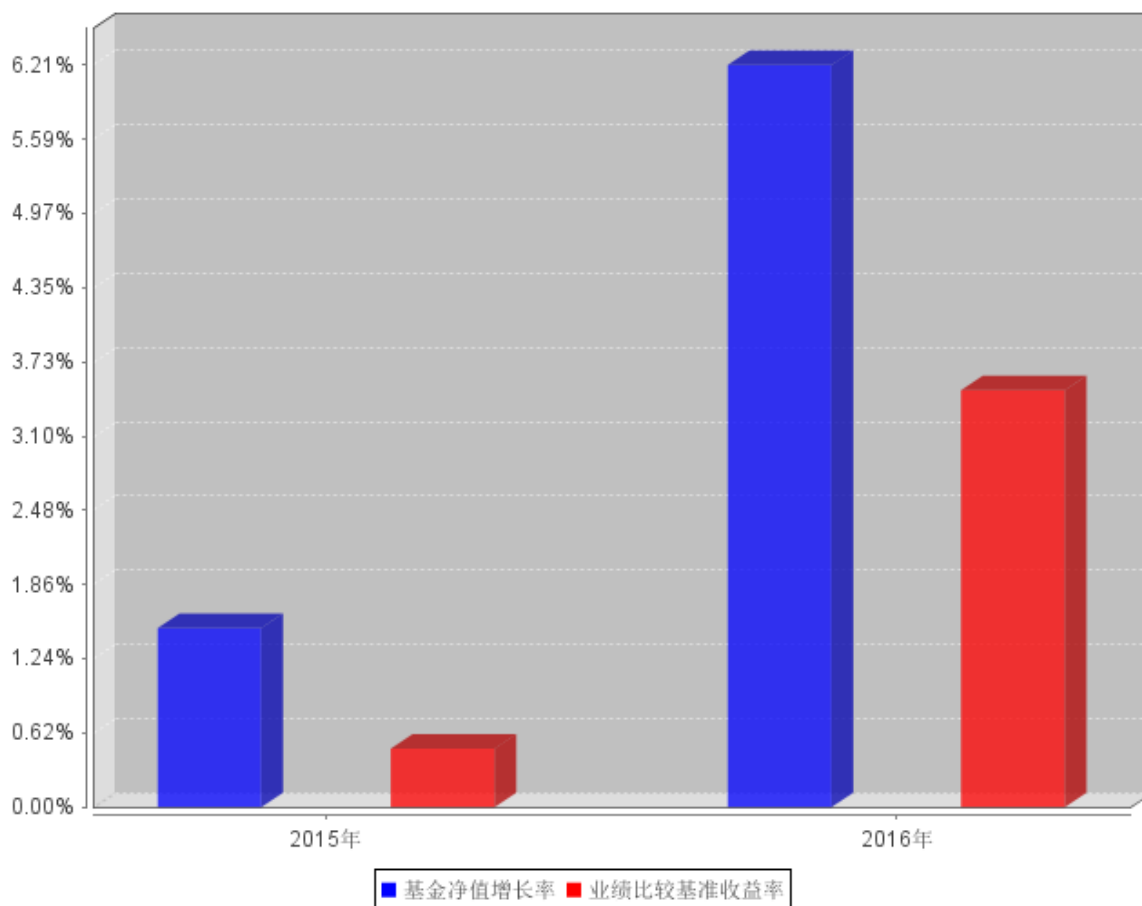


注：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。



### 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

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遵规守信情况的说明

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了培训，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

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未能满足利润分配条件，故未能进行利润分配。

### 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的真实、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
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	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	7.4.7.2	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,971,937.63	13,844,217.17
应收利息	7.4.7.5	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	7.4.7.6	-	-



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
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
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	7.4.7.7	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	7.4.7.8	490,034.82	22,031.12
负债合计		1,248,986.78	2,851,619.03
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	99,724,161.06	302,122,786.84
未分配利润	7.4.7.10	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
<b>一、收入</b>		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	7.4.7.11	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	7.4.7.12	14,731,094.96	2,708,629.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-14,330.00	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	25,180.00	-
股利收益	7.4.7.16	338,138.91	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-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）	7.4.7.18	634,064.01	1,178,611.19
<b>减：二、费用</b>		9,994,212.62	2,065,024.29
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,617,906.38	1,053,869.12
2. 托管费	7.4.10.2.2	436,317.74	175,644.85
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	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	7.4.7.20	499,100.76	22,156.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,162,244.98	5,075,545.25
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		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（本期利	-	4,162,244.98	4,162,244.98

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)	-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 7.1 至 7.4 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

### 7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年度，即从每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计期间。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款、应收款项。除与权证投资有关的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示；与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的各类应收款项等在活跃市场没有报价、回收金额固定或可以确定的非衍生金融资产分类为贷款与应收款项。

#### (2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示，与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金目前持有的金融负债全部为其他金融负债，包括各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。股票投资收益按卖出股票成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出股票的公允价值变动损益转入股票投资收益，卖出股票应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

股票持有期间分派的股票股利，应于除权除息日根据上市公司股东大会决议公告，按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量，在本账户“数量”栏进行记录。因持有股票而享有的配股权，配股除权日在配股缴款截止日之后的，在除权日按所配的股数确认未流通部分的股票投资，与已流通部分分别核算。配股除权日在配股缴款截止日之前的，按照权证的有关原则进行核算。

股票投资应分派的现金股利，在除息日确认为股利收入。

估值日对持有的股票估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

### （2）债券投资

买入债券于交易日确认债券投资；债券投资按交易日债券的公允价值（不含支付价款中所包含的应收利息）入账，应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行资金交收。

持有债券期间，每日确认利息收入，计入应收利息和利息收入科目。

债券派息日，按应收利息金额，与证券登记结算机构进行资金交收。

估值日对持有的债券估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

卖出债券应于交易日确认债券投资收益。债券投资收益按卖出债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该卖出债券的公允价值变动损益转入债券投资收益，卖出债券应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

到期收回债券本金和利息，债券投资收益按收回债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该收回债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

可转换债券转股时，按可转换股票的公允价值计入股票投资科目，按应收取的现金余额返还扣除可转换股票的公允价值后的余额，与可转换债券成本、应收利息和估值增值或减值的差额计入债券投资收益，同时，将原计入该转换债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

### （3）权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

获赠权证（包括配股权证）在除权日应按持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，在本账户“数量”栏进行记录。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益。衍生工具收益按卖出权证成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

权证行权按结算方式分为证券结算方式和现金结算方式，具体核算如下：

#### A、证券结算方式

认购权证以证券结算方式行权时，按股票的公允价值确认股票投资成本，按股票公允价值与权证成本、估值增值或减值、行权价款及相关费用的差额确认衍生工具收益，同时将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

认沽权证以证券结算方式行权时，按认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）确认衍生工具收益，按行权价款扣除费用后的余额与权证投资成本、估值增值或减值、结转的股票投资成本、估值增值或减值、认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）的差额确认股票投资收益，同时，将原计入卖出股票和原计入权证的公允价值变动损益转入股票投资收益和衍生工具收益。

#### B、现金结算方式

权证以现金结算方式行权时，按确定的金额扣减交易费用后的余额与结转的权证成本、估值增值或减值的差额确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

放弃行权，在放弃行权确定日，按结转的权证成本、估值增值或减值，确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

#### （4） 资产支持证券

取得资产支持证券时，按公允价值入账；取得资产支持证券支付的款项时，区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分，将收到的本金部分冲减成本，将收到的收益部分冲减应计利息（若有）后的差额，记入资产支持证券利息收入，其他与资产支持证券投资相关业务的账务处理比照债券投资。

#### （5） 买入返售金融资产和卖出回购金融资产

根据返售协议，按照应付和实际支付的金额确认入账；返售前，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；返售日，按照应收或实际收到的金额与账面余额和应收利息的差额，计算确认利息收入。

根据回购协议，按照应收和实际收到的金额确认入账；融资期限内，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；到期回购时，按

照应付或实际支付的金额与账面余额和应付利息的差额，计算确认利息支出。

#### (6) 股指期货投资

股指期货在买入和卖出合约时，记录初始合约价值。估值日对股指期货估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

买入合约卖出平仓、卖出合约买入平仓或到期交割时，采用移动加权方法结转平仓合约的初始合约价值。日终结算时，对股指期货进行估值，确认平仓损益，进行当日无负债结算，并对合约占用的交易保证金进行调整。

#### (6) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值原则遵循中国证券监督管理委员会 2007 年 6 月 8 日发布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）和中国证券投资基金业协会 2014 年 11 月 13 日发布的《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》的有关规定，具体估值方法如下：

#### (1) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；首次发行未上市的股票采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按交易所上市的同一股票的市价估值；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按下列办法进行估值：

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的



同一股票的市价，应按以下公式确定该股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$

其中：

FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；

C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

D1 为该非公开发行有明确锁定期的股票的锁定其所含的交易日的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易日的交易天数（不含估值日当天）。

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工作小组停牌股票估值的参考方法》的要求，本基金对长期停牌股票按“指数收益法”进行估值。

#### （2）债券投资

上本基金在对银行间和交易所市场的固定收益品种估值时，主要依据由第三方估值机构提供的价格数据。第三方估值机构包括中央国债登记结算公司（以下简称“中央结算公司”）和中证指数有限公司。第三方估值机构根据以下原则确定估值品种公允价值：对于存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

未上市流通的债券在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

#### （3）权证投资

上市权证按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

#### （4）股指期货投资

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

#### (5) 其他投资品种

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

资产支持证券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值。

#### (6) 估值不能客观反映其公允价值的处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

#### (7) 实际投资成本与估值的差异处理

实际投资成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。

### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示不得相互抵销。

### 7.4.4.7 实收基金

本基金单位总额不固定，基金单位总数随时增减。基金合同生效时，实收基金按实际收到的基金单位发行总额入账；基金合同生效后，实收基金应于基金申购、赎回确认日根据基金契约和招募说明书中载明的有关事项进行确认和计量。

### 7.4.4.8 损益平准金

基金管理公司于收到基金投资人申购或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，计算有效申购或转换款中含有的实收基金部分，确认并增加实收基金，按基金申购或转换款与实收基金的差额，确认并增加损益平准金。

基金管理公司于收到基金投资人赎回或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，对基金赎回款或转换转出款中含有的实收基金，确认并减少实收基金，按基金赎回款或转换转出款与实收基金的差额，确认并减少损益平准金。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 股票投资收益

于卖出股票交易日确认，按卖出股票成交总额与其成本的差额入账。

(2) 债券投资收益

于卖出债券交易日确认，按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

(3) 股利收入

于除息日确认，按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

(4) 债券利息收入

在债券实际持有期内逐日计提，按摊余成本和实际利率计算确定的金额入账。

(5) 存款利息收入

逐日计提，按本金与适用的利率计提的金额入账。

(6) 买入返售证券收入

在证券持有期内采用实际利率逐日计提，按计提的金额入账。

(7) 公允价值变动损益

于估值日，对采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的损益进行确认；卖出股票、债券、权证等资产时，将原计入该卖出资产的公允价值变动损益转入股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益等科目。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

(1) 基金管理人报酬

按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率逐日计提。

(2) 基金托管费

按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

(3) 交易费用

对股票、债券、资产支持证券、基金、权证等交易过程中发生的，可直接归属于取得或处置某项基金资产或承担某项基金负债的新增外部成本，包括支付给交易代理机构的规费、佣金、代征的税金及其他必要的可以正确估算的支出，在资产交易日确认各项交易费用。

(4) 利息支出

对银行借款利息支出、交易性金融负债利息支出和卖出回购金融资产支出，在借款期或融资期内按实际利率逐日计提并确认入账。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；每份基金份额享有同等分配权；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 50%，收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，基金期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日	上年度末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	46,092,296.56	154,974,509.71
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	46,092,296.56	154,974,509.71

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	54,002,422.03	53,899,120.75	-103,301.28
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	54,002,422.03	53,899,120.75	-103,301.28
项目	上年度末 2015 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		136,374,618.73	138,538,406.50	2,163,787.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		136,374,618.73	138,538,406.50	2,163,787.77

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	4,854.88	42,039.34
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	16,846.79	807.00
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	1.59
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	137.30	27.30
合计	21,838.97	42,875.23

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

**7.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	572,506.07	539,285.80
银行间市场应付交易费用	175.00	-
合计	572,681.07	539,285.80

**7.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	34.82	2,031.12
预提费用	490,000.00	20,000.00
合计	490,034.82	22,031.12

**7.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	302,122,786.84	302,122,786.84
本期申购	51,975,195.63	51,975,195.63
本期赎回（以“-”号填列）	-254,373,821.41	-254,373,821.41
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	99,724,161.06	99,724,161.06

**7.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,405,138.00	1,979,145.30	4,384,283.30
本期利润	6,429,334.03	-2,267,089.05	4,162,244.98
本期基金份额交易产生的变动数	1,432,289.46	-2,201,517.48	-769,228.02

其中：基金申购款	-380,533.91	1,071,786.46	691,252.55
基金赎回款	1,812,823.37	-3,273,303.94	-1,460,480.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,266,761.49	-2,489,461.23	7,777,300.26

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	390,388.92	223,762.20
定期存款利息收入	-	821,986.12
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	48,499.58	2,340.23
其他	7,006.62	85.83
合计	445,895.12	1,048,174.38

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出股票成交总额	2,151,123,378.47	222,700,843.12
减：卖出股票成本总额	2,136,392,283.51	219,992,213.98
买卖股票差价收入	14,731,094.96	2,708,629.14

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

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
债券投资收益——买卖债券（、债 转股及债券到期兑付）差价收入	-14,330.00	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-



合计	-14,330.00	-
----	------------	---

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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
卖出债券（、债转股及债券到期兑 付）成交总额	10,093,300.43	-
减：卖出债券（、债转股及债券到 期兑付）成本总额	10,057,000.00	-
减：应收利息总额	50,630.43	-
买卖债券差价收入	-14,330.00	-

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期本基金无资产支持证券投资。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期本基金无贵金属投资。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本报告期本基金无权证投资。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2015年11月11日(基金合同生效 日)至2015年12月31日
权证投资收益	-	-
股指期货-投资收益	25,180.00	-

#### 7.4.7.16 股利收益

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

股票投资产生的股利收益	338,138.91	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	338,138.91	-

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	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
1. 交易性金融资产	-2,267,089.05	2,163,787.77
——股票投资	-2,267,089.05	2,163,787.77
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
合计	-2,267,089.05	2,163,787.77

#### 7.4.7.18 其他收入

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
基金赎回费收入	634,064.01	1,178,611.19
合计	634,064.01	1,178,611.19

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。对持续持有期少于7日（不含7日）的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期长于7日（含7日）少于30日（不含30日）的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日（含30日）少于93日（不含93日）的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于93日（含93日）但少于186日的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于186日（含186日）的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

**7.4.7.19 交易费用**

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
交易所市场交易费用	6,440,537.74	813,353.37
银行间市场交易费用	350.00	-
合计	6,440,887.74	813,353.37

**7.4.7.20 其他费用**

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
审计费用	90,000.00	20,000.00
信息披露费	400,000.00	-
银行结算费用	6,100.76	2,156.95
债券帐户维护费	3,000.00	-
合计	499,100.76	22,156.95

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

本报告期内，本基金不存在或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至2017年03月24日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

**7.4.9 关联方关系**

关联方名称	与本基金的关系
中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

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 关联方报酬

###### 7.4.10.1.1 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

###### 7.4.10.1.2 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

##### 7.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

##### 7.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

###### 7.4.10.3.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

###### 7.4.10.3.2 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

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。

**7.4.10.4 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

**7.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

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。

**7.4.10.6 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。

**7.4.11 利润分配情况****7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金**

本报告期内本基金未实施利润分配。

**7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本期末本基金未持有因认购/新发而流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	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	-

### 7.4.12.3 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

信用风险指基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况,从而导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,而且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

##### (1) 风险管理政策

本基金管理人根据中国证监会的要求,建立了科学合理层次分明的内控组织架构、控制程序、控制措施和控制职责。

本基金管理人已建立了一套较为完整的决策流程和业务操作流程,每个员工各司其责,监察稽核部定期对各部门、各业务流程进行监察稽核,充分保证了各项管理制度和业务流程的有效执行。

##### (2) 风险管理组织架构

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

公司上述风险管理职能部门运转正常,充分发挥各自的职能,不断揭示并化解各类风险。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险指基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况,从而导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,而且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的困难而导致损失的风险。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分股票均是交易相对活跃的股票，变现能力较强。

本基金管理人设专人通过独立的检测系统对流动性指标进行监测和分析，并进行动态调整，充分保证本基金有充足的现金流。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具或证券的价值对市场参数变化的敏感性，是基金资产运作中所不可避免地承受因市场任何波动而产生的风险。本基金管理人已建立了一套较完整的系统性风险预警和监控系统，利用设定系统参数对市场风险进行度量和监控。主要通过调整 VaR 的最高和最低限以及日常 VaR 的值，实现对市场风险的控制和管理。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为债券、可转换债券、银行存款等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	46,092,296.56	-	-	-	46,092,296.56
结算备付金	6,457,834.51	-	-	-	6,457,834.51
存出保证金	305,244.59	-	-	-	305,244.59
交易性金融资产	-	-	-	53,899,120.75	53,899,120.75
应收证券清算款	-	-	-	1,971,937.63	1,971,937.63
应收利息	-	-	-	21,838.97	21,838.97
应收申购款	-	-	-	2,175.09	2,175.09

资产总计	52,855,375.66	-	-	55,895,072.44	108,750,448.10
负债					
应付赎回款	-	-	-	22,683.44	22,683.44
应付管理人报酬	-	-	-	140,217.80	140,217.80
应付托管费	-	-	-	23,369.65	23,369.65
应付交易费用	-	-	-	572,681.07	572,681.07
其他负债	-	-	-	490,034.82	490,034.82
负债总计	-	-	-	1,248,986.78	1,248,986.78
利率敏感度缺口	52,855,375.66	-	-	54,646,085.66	107,501,461.32
上年度末 2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	154,974,509.71	-	-	-	154,974,509.71
结算备付金	1,793,255.77	-	-	-	1,793,255.77
存出保证金	60,575.73	-	-	-	60,575.73
交易性金融资产	-	-	-	138,538,406.50	138,538,406.50
应收证券清算款	-	-	-	13,844,217.17	13,844,217.17
应收利息	-	-	-	42,875.23	42,875.23
应收申购款	-	-	-	104,849.06	104,849.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	156,828,341.21	-	-	152,530,347.96	309,358,689.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,616,813.46	1,616,813.46
应付管理人报酬	-	-	-	577,275.97	577,275.97
应付托管费	-	-	-	96,212.68	96,212.68
应付交易费用	-	-	-	539,285.80	539,285.80
其他负债	-	-	-	22,031.12	22,031.12
负债总计	-	-	-	2,851,619.03	2,851,619.03
利率敏感度缺口	156,828,341.21	-	-	149,678,728.93	306,507,070.14

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施



监控。

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）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金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%。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

于 2016 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 12 月 31 日		上年度末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	53,899,120.75	50.14	138,538,406.50	45.20
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	53,899,120.75	50.14	138,538,406.50	45.20

#### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%	
	固定其它市场变量，当本基金基准下降 1%	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2016 年）

		12月31日 )	12月31日 )
	基金净资产变动	4,509,297.20	-3,568,603.89
	基金净资产变动	-4,509,297.20	3,568,603.89

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，无风险收益率取 2016 年 12 月 31 日十年期国债收益率 3.01%，利用 2016 年 7 月 1 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 8.37。

#### 7.4.14 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

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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	300025	华星创业	200,000	2,200,000.00	2.05
12	300142	沃森生物	200,000	2,180,000.00	2.03
13	000852	石化机械	200,000	2,168,000.00	2.02
14	000718	苏宁环球	200,000	1,726,000.00	1.61
15	601857	中国石油	200,000	1,590,000.00	1.48
16	002531	天顺风能	200,000	1,376,000.00	1.28
17	000018	神州长城	100,000	1,070,000.00	1.00
18	300061	康耐特	10,000	230,300.00	0.21
19	002167	东方锆业	10,000	135,500.00	0.13

## 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

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

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所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本期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

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%

### 9.2 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	304,044.53	0.3049%

### 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
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	1	2,613,026,164.19	62.14%	2,433,513.48	62.14%	-
中泰证券	1	1,592,008,007.03	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%	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年1月4日
2	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加北京君德汇富投资咨询有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年1月7日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加深圳众禄金融控股股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年1月8日
4	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加兴业银行股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年1月28日

5	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 2 月 17 日
6	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加华泰证券股份有限公司基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 4 日
7	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加上海汇付金融服务有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 24 日
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 24 日
9	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 30 日
10	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 4 月 6 日
11	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 4 月 7 日
12	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 4 月 13 日
13	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司基金定投及定投	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 4 月 14 日
14	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加上海天天基金销售有限公司基金	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2016 年 4 月



	定投及定投优惠活动的公告	券日报	14 日
15	中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 4 月 21 日
16	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部 分基金参加代销机构基金定投及定投优惠活 动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 5 月 7 日
17	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加珠 海盈米财富管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 5 月 11 日
18	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部 分基金参加兴业证券股份有限公司基金申购 及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 5 月 14 日
19	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部 分基金参加深圳众禄金融控股股份有限公司 基金定投及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 5 月 19 日
20	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部 分基金参加国泰君安证券股份有限公司基金 定投活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 2 日
21	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部 分基金参加上海陆金所资产管理有限公司申 购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 3 日
22	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上 海陆金所资产管理有限公司为代销机构的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 3 日
23	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上 海陆金所资产管理有限公司为代销机构的公 告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 3 日
24	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加华	中国证券报、上海证	2016 年

	泰证券股份有限公司费率优惠的公告	券报、证券时报、证 券日报	6 月 15 日
25	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中信证券股份有限公司和中信证券（山东）有限责任公司基金定投活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 18 日
26	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 22 日
27	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加珠海盈米财富管理有限公司基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 22 日
28	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加华融证券股份有限公司基金定投活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 24 日
29	中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 25 日
30	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 6 月 30 日
31	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通上海陆金所资产管理有限公司基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 7 月 19 日
32	中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2016 年 7 月 19 日
33	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通晋商银行股份有限公司基金定投	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证	2016 年 7 月

	业务的公告	券日报	22 日
34	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加民生银行为代销机构并参加申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 7 月 22 日
35	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海云湾投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 7 月 22 日
36	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 7 月 22 日
37	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加上海云湾投资管理有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 8 月 2 日
38	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售有限公司基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 8 月 12 日
39	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 8 月 13 日
40	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京新浪仓石基金销售有限公司基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 8 月 13 日
41	中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 8 月 25 日
42	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通国信证券股份有限公司基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 9 月 6 日

43	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通东莞证券股份有限公司基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 9 月 9 日
44	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 9 月 21 日
45	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整中国工商银行股份有限公司基金定投起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 9 月 23 日
46	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加华安证券股份有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 9 月 24 日
47	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加民族证券为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 9 月 29 日
48	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通民生银行基金定投业务并参加基金定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 10 月 26 日
49	中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 10 月 26 日
50	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通中证金牛（北京）投资咨询有限公司基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 10 月 31 日
51	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 10 月 31 日
52	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部	中国证券报、上海证	2016 年

	分基金开通北京乐融多源投资咨询有限公司基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	券报、证券时报、证券日报	11月 5日
53	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 11月 5日
54	关于中邮创业基金管理股份有限公司开通网上直销平台基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 11月 8日
55	中邮创业基金管理股份有限公司关于开通网上直销平台的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 11月 8日
56	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京晟视天下投资管理有限公司基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 11月 10日
57	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 11月 10日
58	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通华西证券股份有限公司基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 11月 22日
59	关于中邮创业基金管理股份有限公司开通网上直销平台基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 12月 9日
60	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京钱景财富投资管理有限公司基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年 12月 13日

61	中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 12 月 17 日
62	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 12 月 21 日
63	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中国国际金融股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 12 月 24 日
64	关于中邮创业基金管理股份有限公司开通网上直销平台基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 12 月 24 日
65	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 12 月 30 日
66	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定投及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 12 月 30 日
67	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 12 月 30 日

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照

6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

## 12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：[www.postfund.com.cn](http://www.postfund.com.cn)

中邮创业基金管理股份有限公司  
2017年3月31日