

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式  
证券投资基金  
2017 年半年度报告 摘要

2017 年 6 月 30 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示

### 1.1 重要提示

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金管理人—中邮创业基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 08 月 28 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。

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 06 月 30 日止。

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

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	中邮绝对收益策略定期开放混合型
基金主代码	002224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 12 月 30 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	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	460,462,147.04 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。</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</p>

	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。
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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	吴荣
	联系电话	010-82295160—157	021-52629999-213117
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	011693@cib.com.cn
客户服务电话		010-58511618	95561
传真		010-82295155	021-62535823

## 2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.postfund.com.cn">http://www.postfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2017年1月1日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	-14,953,632.08
本期利润	-9,431,337.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0171
本期基金份额净值增长率	-2.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)

期末可供分配基金份额利润	-0.1035
期末基金资产净值	412,802,018.65
期末基金份额净值	0.896

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）。

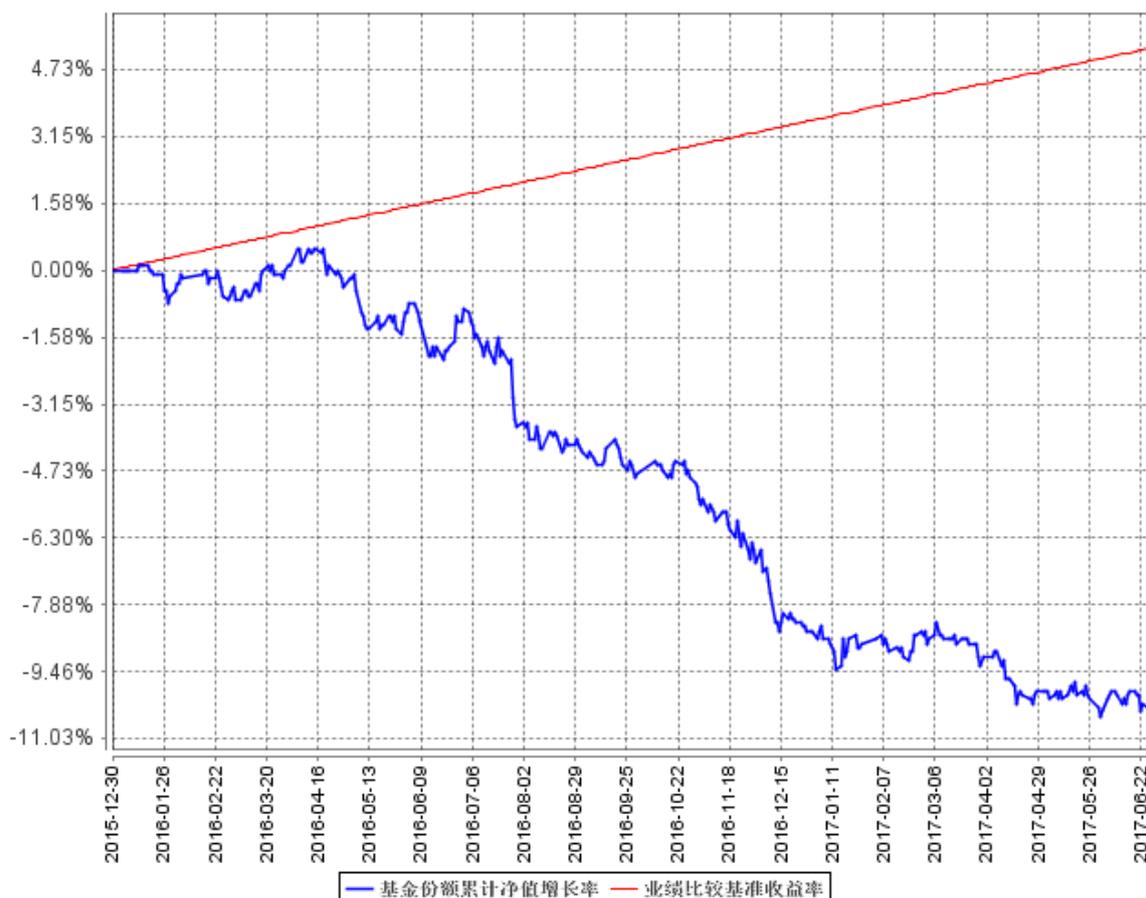
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去一个月	-0.11%	0.18%	0.27%	0.01%	-0.38%	0.17%
过去三个月	-1.43%	0.19%	0.84%	0.01%	-2.27%	0.18%
过去六个月	-2.08%	0.20%	1.68%	0.01%	-3.76%	0.19%
过去一年	-9.31%	0.22%	3.44%	0.01%	-12.75%	0.21%
自基金合同生效起至今	-10.40%	0.21%	5.26%	0.01%	-15.66%	0.20%

### 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



## § 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 8 日，截至 2017 年 6 月 30 日，本公司共管理 34 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中

邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创业新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动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、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、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、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金。

#### 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		
俞科进	基金经理	2015 年 12 月 30 日	-	8 年	经济学硕士，曾任安徽省池州市殷汇中学教师、中国人保寿险有限公司职员、长江证券股份有限公司金融工程分析师、中邮创业基金管理股份有限公司金融工程研究员、中邮核心竞争力灵活配置混合型基金基金经理助理、量化投资部员工，现任中邮创业基金管理股份有限公司量化投资部副总经理兼中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。
任泽松	基金经理	2015 年 12 月 30 日	-	7 年	生物学硕士，曾任毕马威华振会计师事务所审计员、北京源乐晟资产管理有限公司行业研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部行业研究员，中邮创业基金管理有限公司中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理兼行业研究员，现任中邮创业基金管理股份有限公司任

					泽松投资工作室总负责人、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、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、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、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、中邮增力债券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《关于基金经理注册通知》、《关于基金经理变更通知》、《关于基金经理注销通知》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。

### 4.3.2 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，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

2017 年一季度工业经济有一定程度的回暖迹象，其中因为持续的供给侧改革带动的资源品价格上涨因素是其主要推手，另外 2016 年全民加杠杆买房抬高房价不仅带动地产投资提升也使得地产相关消费行业在 2017 年一季度有了相对明确的业绩预期。海外市场美国新一届政府大选期间提出的政策不但未有实质性举措落地反而部分进程推行力度低于预期，同时欧洲主要经济体开始进入大选及换届的关键时期，全球市场波动加大，人民币汇率压力暂时有所降低。在国内经济基本面需要继续观察而海外市场不明朗的环境下，投资者风险偏好继续处于低位，短期交易明显，钢铁、煤炭等低估值周期行业及家电、白酒等消费行业受到市场的认可。进入二季度，经济回暖的预期没有得到证实，补库存暂告一段落，资源品价格受基本面改善预期驱动的部分难以持续，但在供给侧改革影响下，行业龙头继续在竞争格局中相对占优。海外市场美元指数因为在加息预期兑现后计划提前缩表呈现相对弱势，人民币汇率压力降低，国内去杠杆收缩流动性的进度继续推进，虽然其中有部分干扰因素但总体来说基本没有大的变化，投资者风险偏好难以明显提高。成长板块部分个股虽然估值已处于相对合理区间，但其业绩确定性受到市场怀疑，未能出现趋势性行情的机会，而以上证 50 为代表的大盘蓝筹受到追捧，之后资金扩散到部分业绩确定性高、估值相对合理的二线蓝筹板块。总的来说 2017 年上半年股票市场分化严重，虽然相对占优的板块中既有周期也有消费行业，但各行业内主要以龙头股为主，业绩确定性而非成长性占优，偏重业绩成长性的股票组合难以获取超额收益，而股指期货经历几度监管放松传言终于在 2 月份小幅开禁，在此过程中贴水波动较大，初上市贴水幅度相对前期有所降低上市但收敛速度加快。

2017 年上半年中邮绝对收益秉持获取绝对收益的原则，采取低仓位运行，股票多头逢低买入少量符合长期投资理念的战略性品种，股指期货空头部分根据股票组合特征及合约升贴水变化等因素优化选择合适的期货合约建立对冲仓位。一季度保持 25%左右的股票仓位，二季度初加配了部分上证 50 成分股，并在按照基金合同要求进行对冲的情况下保留了少量风险敞口，由于本基金在成长风格上的风险暴露相对较高，股票组合虽有部分超额收益但仍未能完全覆盖贴水损失，基金净值有所回撤。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.896 元，累计净值 0.896 元。本报告期基金份额净值增长率为-2.08%，业绩比较基准收益率为 1.68%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预期 2017 年下半年在一些重要的时间节点前后保持稳定是政府各项工作压倒一切的目标，而降杠杆去泡沫是控制风险的必由之路，各项具有针对性的监管政策应该会继续得到严格执行，保持稳健的货币政策和适当的财政政策成为必然。另外海外市场美国特朗普政府施政力度未达之前预期，美联储后续加息频率及提前缩表计划也未足以让市场形成强烈预期，而欧洲经济向好的趋势仍处于进行时，因此美元继续在区间内波动的可能性较大，人民币汇率压力继续处于相对温和阶段，这一点也在一定程度上为中国政府去泡沫提供了缓冲期。考虑到当前主要以行政措施为主的改革逐渐显现部分负面效应，在总体基调保持一贯连续性的前提下部分策略有调整的可能性也在提高，流动性继续收紧的可能性不大。总的来说下半年业绩确定性继续主导市场的概率较大，在政策微调的过程中弹性较大板块也会有一定的机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金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。

#### 4.7 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，本基金未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，本托管人在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他相关规定，不存在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

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

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金  
报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款		122,950,464.20	137,285,582.39
结算备付金		92,530,129.31	170,395,388.54
存出保证金		27,634,942.40	22,653,883.00

交易性金融资产		170,872,528.68	132,764,868.62
其中：股票投资		170,872,528.68	132,764,868.62
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		-	100,000,000.00
应收证券清算款		25,871.62	82,976.20
应收利息		197,057.81	288,788.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		414,210,994.02	563,471,486.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年6月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		-	-
应付管理人报酬		358,776.59	532,205.83
应付托管费		89,694.13	133,051.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		197,519.39	140,284.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		762,985.26	520,000.00
负债合计		1,408,975.37	1,325,541.29
<b>所有者权益：</b>			
实收基金		460,462,147.04	614,610,604.12
未分配利润		-47,660,128.39	-52,464,658.52
所有者权益合计		412,802,018.65	562,145,945.60
负债和所有者权益总计		414,210,994.02	563,471,486.89

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8960 元，基金份额总额 460462147.04 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-5,705,542.04	-6,791,590.80
1.利息收入		3,065,311.81	9,146,982.49
其中：存款利息收入		2,398,023.36	6,986,378.09
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		667,288.45	2,160,604.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-14,381,187.58	-7,591,947.57
其中：股票投资收益		-8,965,140.10	-2,921,712.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-6,387,733.68	-4,985,144.00
股利收益		971,686.20	314,908.84
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		5,522,294.41	-9,271,481.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		88,039.32	924,855.89
<b>减：二、费用</b>		3,725,795.63	7,635,637.89
1.管理人报酬		2,490,188.49	5,693,999.44
2.托管费		622,547.16	1,423,499.87
3.销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4.交易费用		350,484.72	258,202.08
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用		262,575.26	259,936.50
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-9,431,337.67	-14,427,228.69
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-9,431,337.67	-14,427,228.69

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	614,610,604.12	-52,464,658.52	562,145,945.60
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	-9,431,337.67	-9,431,337.67
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)	-154,148,457.08	14,235,867.80	-139,912,589.28
其中：1.基金申购款	109,395.29	-9,930.84	99,464.45
2.基金赎回款	-154,257,852.37	14,245,798.64	-140,012,053.73
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)	460,462,147.04	-47,660,128.39	412,802,018.65
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	1,239,463,253.94	69,103.67	1,239,532,357.61
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期净利润)	-	-14,427,228.69	-14,427,228.69
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)	-304,704,943.70	3,433,647.08	-301,271,296.62

其中：1.基金申购款	3,934,135.07	-22,517.47	3,911,617.60
2.基金赎回款	-308,639,078.77	3,456,164.55	-305,182,914.22
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）	934,758,310.24	-10,924,477.94	923,833,832.30

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

周克	周克	吕伟卓
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015] 2683号《关于准予中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》批准进行募集，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》发起，并于2015年12月30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1,239,463,253.94元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字（2015）第110ZC0679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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。在正常市场情况下，本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在80%~120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头

寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

## 6.4.2 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。

## 6.4.3 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。

## 6.4.4 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.4.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

### 6.4.4.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

### 6.4.4.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

## 6.4.5 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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。

## 6.4.6 关联方关系

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

本报告期未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

### 6.4.6.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中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
兴业银行股份有限公司	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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金管理人股东控股的公司
首创京都期货有限公司	基金管理人股东控股的公司

## 6.4.7 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.7.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

## 6.4.7.2 关联方报酬

### 6.4.7.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,490,188.49	5,693,999.44
其中：支付销售机构的客户维护费	778,363.68	1,741,481.75

注：支付基金管理人中邮创业基金管理有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值的

1.0%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

### 6.4.7.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	622,547.16	1,423,499.87

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

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

### 6.4.7.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

## 6.4.7.4 各关联方投资本基金的情况

### 6.4.7.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2015 年 12 月 30 日）持有	9,999,000.00	9,999,000.00

的基金份额		
期初持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	9,999,000.00	9,999,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	2.1700%	1.0700%

#### 6.4.7.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.7.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年6月 30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行股份有限公司	122,950,464.20	1,281,982.64	667,777,356.92	6,676,286.16

#### 6.4.7.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.8 期末（2017年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.8.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.10.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002879	长缆科技	2017年6月7日	2017年7月7日	新股流通受限	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26	-
002882	金龙羽	2017年6月19日	2017年7月17日	新股流通受限	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-
603933	睿能科技	2017年6月	2017年7月	新股流通受限	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40	-

		30 日	6 日							
300670	大烨智能	2017 年 6 月 28 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87	-
603331	百达精工	2017 年 6 月 29 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37	-
300671	富满电子	2017 年 6 月 29 日	2017 年 7 月 5 日	新股流通受限	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62	-
603617	君禾股份	2017 年 6 月 27 日	2017 年 7 月 3 日	新股流通受限	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76	-

#### 6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300104	乐视网	2017 年 4 月 17 日	重大事项	28.62	-	-	300,000	15,983,338.82	8,586,000.00	-
300267	尔康制药	2017 年 5 月 10 日	重大事项	12.05	-	-	300,000	4,387,674.81	3,615,000.00	-
300364	中文在线	2017 年 2 月 13 日	重大事项	33.42	-	-	85,000	4,462,152.38	2,840,700.00	-
300367	东方网力	2016 年 12 月 15 日	重大事项	20.64	2017 年 7 月 3 日	18.01	134,900	3,944,250.93	2,784,336.00	-
601989	中国重工	2017 年 5 月 31 日	重大事项	6.21	-	-	128,600	1,011,786.00	798,606.00	-
601088	中国神华	2017 年 6 月	重大事项	22.29	-	-	29,300	565,489.00	653,097.00	-

		5 日								
600643	爱建集团	2017 年 4 月 17 日	重大 事项	14.98	2017 年 8 月 2 日	16.48	36,000	498,400.00	539,280.00	-
002426	胜利精密	2017 年 1 月 16 日	重大 事项	8.09	-	-	58,000	500,540.00	469,220.00	-
600100	同方股份	2017 年 4 月 21 日	重大 事项	14.12	-	-	24,300	360,484.00	343,116.00	-

注：1. 按照证监会公告[2008]38号-《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及《中国证券业协会基金估值小组停牌股票估值的参考方法》的要求，上述股票中乐视网（300104）、尔康制药（300267）、中文在线（300364）、东方网力（300367）、胜力精密（002426）均按“指数收益法”进行估值。

2. 上述股票自其复牌之日起且其交易体现了活跃市场交易特征后，将按市场价格进行估值。

#### 6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.9 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	170,872,528.68	41.25
	其中：股票	170,872,528.68	41.25
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	215,480,593.51	52.02
7	其他各项资产	27,857,871.83	6.73
8	合计	414,210,994.02	100.00

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

## 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,090,561.00	0.51
C	制造业	62,774,628.58	15.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	520,146.00	0.13
E	建筑业	3,999,899.00	0.97
F	批发和零售业	1,634,950.00	0.40
G	交通运输、仓储和邮政业	1,147,621.00	0.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,865,710.61	9.42
J	金融业	43,192,055.49	10.46
K	房地产业	1,584,047.00	0.38
L	租赁和商务服务业	495,006.00	0.12
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	417,760.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,004,944.00	0.97
R	文化、体育和娱乐业	10,145,200.00	2.46
S	综合	-	-

	合计	170,872,528.68	41.39
--	----	----------------	-------

注：由于四舍五入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。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未投资港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002019	亿帆鑫富	600,000	10,008,000.00	2.42
2	600079	人福医药	500,000	9,810,000.00	2.38
3	300287	飞利信	1,000,000	9,180,000.00	2.22
4	300104	乐视网	300,000	8,586,000.00	2.08
5	601318	中国平安	164,800	8,175,728.00	1.98
6	600036	招商银行	320,000	7,651,200.00	1.85
7	300144	宋城演艺	350,000	7,304,500.00	1.77
8	300059	东方财富	600,000	7,212,000.00	1.75
9	300115	长盈精密	200,000	5,836,000.00	1.41
10	601398	工商银行	919,900	4,829,475.00	1.17

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002019	亿帆鑫富	10,211,435.00	1.82
2	600036	招商银行	6,042,071.00	1.07
3	601318	中国平安	5,932,813.00	1.06
4	600070	浙江富润	4,925,489.00	0.88
5	601398	工商银行	4,418,817.00	0.79
6	600079	人福医药	4,198,147.00	0.75

7	600098	广州发展	3,424,137.12	0.61
8	002291	星期六	3,257,945.00	0.58
9	601166	兴业银行	3,187,440.00	0.57
10	600016	民生银行	2,954,641.70	0.53
11	600519	贵州茅台	2,889,139.50	0.51
12	601328	交通银行	2,538,200.00	0.45
13	601668	中国建筑	2,040,280.00	0.36
14	600000	浦发银行	2,036,638.00	0.36
15	601288	农业银行	1,895,720.00	0.34
16	600030	中信证券	1,870,640.00	0.33
17	601336	新华保险	1,753,350.00	0.31
18	600837	海通证券	1,741,998.00	0.31
19	601169	北京银行	1,726,228.00	0.31
20	600887	伊利股份	1,694,617.00	0.30

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。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300104	乐视网	15,056,023.00	2.68
2	002642	荣之联	14,434,725.29	2.57
3	300113	顺网科技	6,009,468.54	1.07
4	002739	万达院线	5,612,202.92	1.00
5	002291	星期六	3,409,028.00	0.61
6	300015	爱尔眼科	3,379,797.00	0.60
7	601166	兴业银行	3,144,000.00	0.56
8	600016	民生银行	2,871,369.00	0.51
9	600098	广州发展	2,819,868.40	0.50
10	002230	科大讯飞	1,623,084.27	0.29
11	601601	中国太保	1,206,183.70	0.21
12	002707	众信旅游	950,478.70	0.17
13	002174	游族网络	935,960.00	0.17
14	300136	信维通信	673,817.00	0.12
15	002573	清新环境	664,455.00	0.12
16	002475	立讯精密	651,809.15	0.12
17	600487	亨通光电	625,680.00	0.11

18	600867	通化东宝	603,810.00	0.11
19	002002	鸿达兴业	582,217.31	0.10
20	603355	莱克电气	547,888.30	0.10

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。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	124,264,843.70
卖出股票收入（成交）总额	89,762,172.27

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

#### 7.5 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。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1707	IC1707	-38	-46,382,800.00	-1,340,640.00	-
IF1707	IF1707	-32	-35,015,040.00	-1,177,636.00	-
IH1707	IH1707	-74	-56,112,720.00	-1,717,800.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-4,236,076.00
股指期货投资本期收益（元）					-6,387,733.68
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-7,047,834.32

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。目前衍生品投资策略主要是股指期货套利，即采用股指期货套利的对冲策略积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

#### 1) 期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

#### 2) 跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他绝对收益策略。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本基金投资的中信证券（600030），中信证券股份有限公司于二〇一七年五月二十四日发布《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》，违反了《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的规定，未按照规定与客户签订业务合同；收到了中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》（处罚字【2017】57 号），对公司及相关责任人给予拟处罚的决定。除此，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、处罚的情形。

### 7.12.2

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,634,942.40
2	应收证券清算款	25,871.62
3	应收股利	-
4	应收利息	197,057.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	27,857,871.83

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 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	300104	乐视网	8,586,000.00	2.08	重大事项

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
7,814	58,927.84	9,999,000.00	2.17%	450,463,147.04	97.83%

### 8.3 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	497,017.89	0.1079%

### 8.4 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

### 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总 数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总 数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承诺 持有期限
基金管理人固有资 金	9,999,000.00	2.17	9,999,000.00	2.17	不少于 3 年
基金管理人高级管 理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	9,999,000.00	2.17	9,999,000.00	2.17	不少于 3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 12 月 30 日）基金份额总额	1,239,463,253.94
本报告期期初基金份额总额	614,610,604.12
本报告期基金总申购份额	109,395.29
减：本报告期基金总赎回份额	154,257,852.37
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	460,462,147.04

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 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。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2017 年 1 月 10 日起，唐亚明先生任本基金管理人副总经理；自 2017 年 6 月 19 日起，曹均先生新任本基金管理人董事长。本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东北证券	2	212,090,467.11	100.00%	197,519.39	100.00%	-

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东北证券	-	-	1,680,000,000.00	100.00%	-	-

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

无

## 11.2影响投资者决策的其他重要信息

无
---

中邮创业基金管理股份有限公司  
2017 年 8 月 29 日