

# 中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2017 年半年度报告

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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更正。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2017 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

## 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	22
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47
7.7 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.....	47
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>51</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>62</b>
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.....	62

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮低碳经济灵活配置混合
基金主代码	001983
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 4 月 28 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	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	366,377,771.22 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注从事或受益于低碳经济主题的上市公司，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的个券投资策略相结合的方法进行投资。</p> <p>（一）低碳经济主题的定义</p> <p>本基金管理人认为，低碳经济是指通过技术创新、产业升级、产业结构调整等多种手段，尽可能的达到经济社会发展与生态环境保护双赢的一种经济发展形态。本基金重点关注随着未来人口结构变化、经济的发展、环境与资源的制约以及国家政策目标和国际承诺的兑现带来的低碳经济主题相关的投资机会；以及其他各种有利于低碳经济发展的新产业、新技术、新商业模式带来的中长期的投资机会。</p> <p>（二）大类资产配置策略</p>

本基金将根据对宏观经济、政策、市场和行业发展阶段判定当前所处的经济周期，进而科学地指导大类资产配置。通过对各类资产的市场趋势和预期风险收益特征的判定，来确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。

### （三）股票投资策略

本基金采用主题投资策略围绕低碳经济这一主题进行投资，选择具有长期持续增长能力的、具有核心竞争力的低碳经济主题的上市公司股票进行投资。

### （四）债券投资策略

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

### （五）权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

### （六）股指期货投资策略

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期

	货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准构成为：中证环保指数×60%+上证国债指数×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	田青
	联系电话	010-82295160—157	010-67595096
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		010-58511618	010-66275865
传真		010-82295155	010-67595096
注册地址		北京市东城区和平里中街乙16号	北京市西城区金融大街25号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙16号	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		100013	100033
法定代表人		曹均	王洪章



## 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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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	-75,791,283.20
本期利润	-61,909,964.67
加权平均基金份额本期利润	-0.1505
本期加权平均净值利润率	-17.98%
本期基金份额净值增长率	-16.05%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-82,729,741.43
期末可供分配基金份额利润	-0.2258
期末基金资产净值	283,648,029.79
期末基金份额净值	0.774
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-22.60%

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	3.06%	1.11%	2.30%	0.62%	0.76%	0.49%
过去三个月	-9.58%	1.14%	-2.08%	0.70%	-7.50%	0.44%

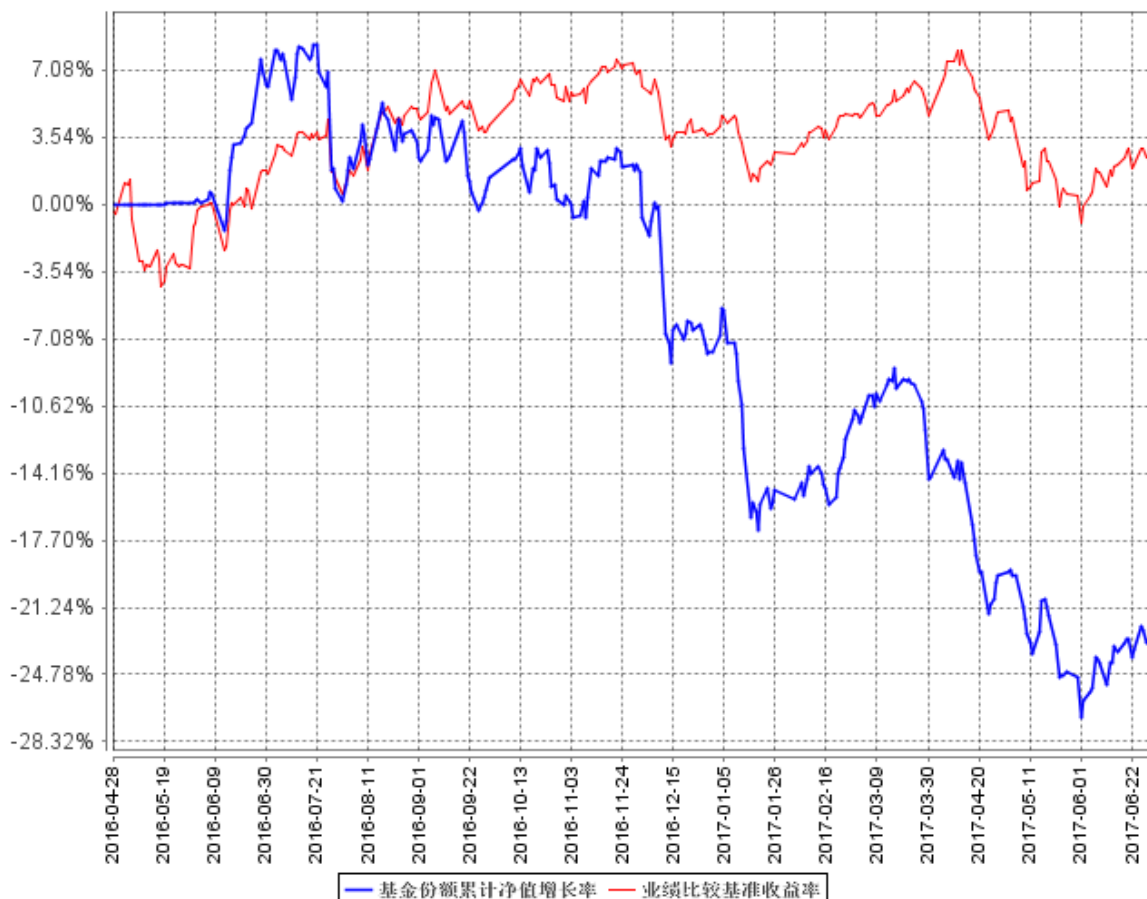
过去六个月	-16.05%	1.13%	-0.90%	0.57%	-15.15%	0.56%
过去一年	-27.19%	1.11%	0.98%	0.58%	-28.17%	0.53%
自基金合同 生效起至今	-22.60%	1.06%	2.82%	0.64%	-25.42%	0.42%

注：1、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。

2、本基金基金合同生效日为 2016 年 04 月 28 日。本基金整体业绩比较基准构成为：中证环保指数×60%+上证国债指数×40%

### 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。

## §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		
张腾	基金经理	2016 年 4 月 28 日	-	3 年	工学硕士，曾任申银万国证券研究所研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼

					行业研究员，现任中邮核心优势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。

### 4.3.2 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

一季度，市场风格切换为追求业绩确定性和有估值支撑的白马股及其它价值型股票，而本基金在持仓上仍延续了此前的投资思路，以符合低碳经济发展的成长型个股为主，持股结构没有及时作出调整，另一方面在年初市场回调中，出于谨慎性的原则和对市场恐慌的过度反应，在回调的最底部将仓位降到了基金历史上偏低的水平，而且在之后的回暖中仓位迟迟没有加上来。二季度市场风格延续了一季度对价值型股票的偏好，特别是随着一季报业绩的披露及半年报业绩预计的展望，业绩增速较低或大幅低预期的个股暴跌更证实了市场对业绩增长确定性的看重。二季度中期，市场开始逐步担忧六月底的半年度 MPA 考核将进一步加剧金融监管带来的流动性紧张，也推动了市场风格朝低风险流动性好的白马股的配置，虽然最终季节性资金紧张在央行的呵护下顺利过渡。相应的，成长型股票板块则因为流动性较差和资金净流出效应表现普遍欠佳。

本基金在结合流动性，业绩确定性及基金主题性规模大小等前提下，择机降仓或调仓至一些业绩增速较好而估值不高的新能源汽车、银行非银及消费板块的优质个股，给基金净值带来了正的贡献，但由于之前重仓股的流动性较差，调仓带来的正收益未能弥补原有持仓的下跌，报告期内整个组合表现仍差强人意。截止报告期末，本基金除一停牌个股外，其余个股持仓均在 1-3% 持股比例，而且考虑到本基金规模偏小，个股流动性的危机基本得到解决。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.774 元；本报告期基金份额净值增长率为-16.05%，业绩比较基准收益率为-0.90%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

二季度经济增长略超预期，但从前瞻性指标及可寻迹象判断来看，后续几个季度或将温和放缓，但也不宜太过悲观，我们认为当前环境下“经济维稳”仍然是一条重要的底线，后续也有相应的对冲政策储备。

较为宽松的货币环境和通胀预期，有望给大消费及一些主题投资带来合适的投资时机。结合本基金主题性，下半年我们将侧重关注新能源汽车主题、PPP 主题、苹果创新等。有部分行业和主题经过上半年的大幅调整，已经处于历史的底部，需要边际改善的预期或者催化剂来驱动板块反弹，我们将密切跟踪这类主题、行业，一旦出现正面催化，行业有望迎来底部反弹。

#### 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，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，中国建设银行股份有限公司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、托管协议和其他有关规定，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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。



## §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：中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

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	6.4.7.1	22,497,455.59	56,908,498.37
结算备付金		1,625,627.60	1,108,476.68
存出保证金		171,222.72	361,350.21
交易性金融资产	6.4.7.2	261,197,186.15	323,485,104.30
其中：股票投资		261,197,186.15	323,485,104.30
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		10,659.36	15,790,373.86
应收利息	6.4.7.5	6,056.42	7,768.12
应收股利		-	-
应收申购款		70,754.67	55,420.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		285,578,962.51	397,716,991.57
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b> <b>2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末</b> <b>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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,000.00	-
应付赎回款		486,061.36	476,802.35
应付管理人报酬		349,635.53	549,222.57
应付托管费		58,272.57	91,537.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	472,114.92	544,543.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	563,848.34	321,435.31
负债合计		1,930,932.72	1,983,541.29
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	366,377,771.22	429,439,890.44
未分配利润	6.4.7.10	-82,729,741.43	-33,706,440.16
所有者权益合计		283,648,029.79	395,733,450.28
负债和所有者权益总计		285,578,962.51	397,716,991.57

注：报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.774 元，基金份额总额 366,377,771.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

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 4 月 28 日(基 金合同生效日)至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-57,150,333.54	73,850,264.28
1.利息收入		273,004.57	4,536,020.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	237,304.57	4,536,020.87
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		35,700.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-71,457,389.16	3,357,817.96
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-72,585,849.05	3,117,284.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,128,459.89	240,533.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	13,881,318.53	62,115,370.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	152,732.52	3,841,055.18
<b>减：二、费用</b>		4,759,631.13	5,549,100.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,564,986.94	3,947,711.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	427,497.82	657,952.03
3. 销售服务费		-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	1,506,989.81	855,470.48
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	260,156.56	87,966.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-61,909,964.67	68,301,163.88
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-61,909,964.67	68,301,163.88

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 04 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 04 月 28 日至 2016 年 06 月 30 日。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金

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）	429,439,890.44	-33,706,440.16	395,733,450.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-61,909,964.67	-61,909,964.67
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）	-63,062,119.22	12,886,663.40	-50,175,455.82

其中：1.基金申购款	34,916,081.71	-5,409,838.28	29,506,243.43
2.基金赎回款	-97,978,200.93	18,296,501.68	-79,681,699.25
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）	366,377,771.22	-82,729,741.43	283,648,029.79
项目	上年度可比期间		
	2016年4月28日(基金合同生效日)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）	1,861,411,280.10	-	1,861,411,280.10
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	68,301,163.88	68,301,163.88
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）	-987,588,345.39	-13,564,873.31	-1,001,153,218.70
其中：1.基金申购款	21,289,771.61	980,366.90	22,270,138.51
2.基金赎回款	-1,008,878,117.00	-14,545,240.21	-1,023,423,357.21
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）	873,822,934.71	54,736,290.57	928,559,225.28

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 04 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 04 月 28 日至 2016 年 06 月 30 日。

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：

<u>周克</u>	<u>周克</u>	<u>吕伟卓</u>
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

中邮低碳经济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] 2435 号《关于准予中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准，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《中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2016 年 4 月 28 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 1,861,411,280.10 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字（2016）第 1107C0235 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

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

## 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 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2017 年 6 月 30 日	
活期存款	22,497,455.59	
定期存款	—	
其中：存款期限 1-3 个月	—	
其他存款	—	
合计：	22,497,455.59	

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动



股票		276,234,737.16	261,197,186.15	-15,037,551.01
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		276,234,737.16	261,197,186.15	-15,037,551.01

#### 6.4.7.3 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。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末，未持有各项买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 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。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	5,328.27
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	658.35
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	0.41
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	69.39
合计	6,056.42

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	472,114.92
银行间市场应付交易费用	-
合计	472,114.92

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	863.08
预提审计费用	124,630.98
预提信息披露费	438,354.28
其他	-
合计	563,848.34

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	429,439,890.44	429,439,890.44
本期申购	34,916,081.71	34,916,081.71
本期赎回(以“-”号填列)	-97,978,200.93	-97,978,200.93
本期末	366,377,771.22	366,377,771.22

#### 6.4.7.10 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	17,692,781.12	-51,399,221.28	-33,706,440.16
本期利润	-75,791,283.20	13,881,318.53	-61,909,964.67
本期基金份额交易产生的变动数	2,925,023.32	9,961,640.08	12,886,663.40
其中：基金申购款	-112,251.10	-5,297,587.18	-5,409,838.28
基金赎回款	3,037,274.42	15,259,227.26	18,296,501.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-55,173,478.76	-27,556,262.67	-82,729,741.43

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	228,489.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	7,336.97

其他	1,478.24
合计	237,304.57

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	497,274,088.52
减：卖出股票成本总额	569,859,937.57
买卖股票差价收入	-72,585,849.05

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本期本基金无债券投资。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本报告期间，本基金无资产支持证券投资。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期间，本基金无贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期本基金无衍生工具投资。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,128,459.89
基金投资产生的股利收益	-

合计	1, 128, 459. 89
----	-----------------

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	13, 881, 318. 53
——股票投资	13, 881, 318. 53
——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	13, 881, 318. 53

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	152, 732. 52
其他	-
合计	152, 732. 52

注：赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对持续持有期小于 30 日（不含 30 日）的，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日（含 30 日）但少于 93 日的，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，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，将不低于赎回费总额的 25% 归基金财产。其余用于注册登记费和其他必要的手续费。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,506,989.81
银行间市场交易费用	-
合计	1,506,989.81

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	198,354.28
银行结算费用	8,171.30
债券帐户维护费	9,000.00
上清所债券账户维护费	-
其他	-
合计	260,156.56

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

本报告期内本基金不存在或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至 2017 年 08 月 24 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司	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

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 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，本基金未通过关联方交易单元进行交易；本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 4 月 28 日至 2016 年 6 月 30 日。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 6 月 30 日	2016 年 4 月 28 日 (基金合同生效日) 至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,564,986.94	3,947,711.81
其中：支付销售机构的客户维护费	835,242.93	991,732.61

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 4 月 28 日至 2016 年 6 月 30 日。

#### 6.4.10.2.2 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4月28日(基金合同生效日) 至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	427,497.82	657,952.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付。

本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 4 月 28 日至 2016 年 6 月 30 日。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间，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；本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 4 月 28 日至 2016 年 6 月 30 日。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 4 月 28 日至 2016 年 6 月 30 日。

##### 6.4.10.4.2 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

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。本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 4 月 28 日至 2016 年 6 月 30 日。



**6.4.10.5 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 4 月 28 日(基金合同生效日) 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
	中国建设银行股份有限公司	22,497,455.59	228,489.36	228,827,283.13

注：本基金基金合同生效日为 2016 年 4 月 28 日，上年度可比期间为：2016 年 4 月 28 日至 2016 年 6 月 30 日。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期本基金未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2017 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券****6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 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	2017 年	2017	新股流	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20	-

	羽	6 月 19 日	年 7 月 17 日	通受限						
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	-
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	-

#### 6.4.12.2 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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002499	科林环保	2017 年 4 月 20 日	重大 事项	27.83	2017 年 7 月 11 日	26.03	690,000	18,332,376.00	19,202,700.00	-
600146	商赢环球	2017 年 1 月 5 日	重大 事项	32.36	-	-	150,000	4,257,104.29	4,854,000.00	-
002418	康盛股	2017 年 3 月	重大 事项	8.01	2017 年 7 月	9.30	5,100	53,251.87	40,851.00	-

	份	20 日	项		10 日				
--	---	------	---	--	------	--	--	--	--

注：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，上述股票（002499）科林环保、（600146）商赢环球、（002418）康盛股份，按“指数收益法”进行估值。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

### 6.4.13.3 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。

### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1 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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	22,497,455.59	-	-	-	22,497,455.59
结算备付金	1,625,627.60	-	-	-	1,625,627.60
存出保证金	171,222.72	-	-	-	171,222.72
交易性金融资产	-	-	-	261,197,186.15	261,197,186.15

衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	10,659.36	10,659.36
应收利息	-	-	-	6,056.42	6,056.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	70,754.67	70,754.67
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>24,294,305.91</b>	-	-	<b>-261,284,656.60</b>	<b>285,578,962.51</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	1,000.00	1,000.00
应付赎回款	-	-	-	486,061.36	486,061.36
应付管理人报酬	-	-	-	349,635.53	349,635.53
应付托管费	-	-	-	58,272.57	58,272.57
应付交易费用	-	-	-	472,114.92	472,114.92
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	563,848.34	563,848.34
<b>负债总计</b>	-	-	-	<b>1,930,932.72</b>	<b>1,930,932.72</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>24,294,305.91</b>	-	-	<b>-259,353,723.88</b>	<b>283,648,029.79</b>
<b>上年度末</b>					
<b>2016年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	56,908,498.37	-	-	-	56,908,498.37
结算备付金	1,108,476.68	-	-	-	1,108,476.68
存出保证金	361,350.21	-	-	-	361,350.21
交易性金融资产	-	-	-	323,485,104.30	323,485,104.30
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	15,790,373.86	15,790,373.86
应收利息	-	-	-	7,768.12	7,768.12
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	55,420.03	55,420.03
其他资产	-	-	-	-	-
<b>资产总计</b>	<b>58,378,325.26</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>339,338,666.31</b>	<b>397,716,991.57</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	476,802.35	476,802.35
应付管理人报酬	-	-	-	549,222.57	549,222.57
应付托管费	-	-	-	91,537.09	91,537.09
应付交易费用	-	-	-	544,543.97	544,543.97
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	321,435.31	321,435.31
<b>负债总计</b>				<b>1,983,541.29</b>	<b>1,983,541.29</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>58,378,325.26</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-337,355,125.02</b>	<b>395,733,450.28</b>

#### 6.4.13.4.1.2 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。

#### 6.4.13.4.2 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占基金资产的比例为 5%-100%, 其中权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%; 扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 本基金持有的单只中小企业私募债券, 其市值不得超过基金资产净值的 10%。本基金投资于低碳经济主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。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 2017 年 06 月 30 日, 本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	261,197,186.15	92.08	323,485,104.30	81.74
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	261,197,186.15	92.08	323,485,104.30	81.74

**6.4.13.4.2.2 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，当本基金基准下跌 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 （2017 年 6 月 30 日 ）	上年度末 （2016 年 12 月 31 日 ）	
		基金净资产变动	4,126,955.02	5,138,944.23
		基金净资产变动	-4,126,955.02	-5,138,944.23

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 2017 年 6 月 30 日十年期国债收益率 3.56%，利用 2017 年 1 月 3 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 1.58。

**6.4.14 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	261,197,186.15	91.46
	其中：股票	261,197,186.15	91.46
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	24,123,083.19	8.45
7	其他各项资产	258,693.17	0.09
8	合计	285,578,962.51	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项金额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（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	171,277,234.70	60.38
D	电力、热力、燃气及水生产和供应	9,097,200.00	3.21

	业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	7,239,252.00	2.55
G	交通运输、仓储和邮政业	1,055,336.00	0.37
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,541,668.32	2.66
J	金融业	53,278,610.97	18.78
K	房地产业	34,960.00	0.01
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	11,672,924.16	4.12
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	261,197,186.15	92.08

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。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本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	002499	科林环保	690,000	19,202,700.00	6.77
2	300266	兴源环境	379,978	11,672,924.16	4.12
3	002341	新纶科技	550,000	10,257,500.00	3.62
4	300274	阳光电源	849,901	9,425,402.09	3.32

5	002414	高德红外	464,578	8,501,777.40	3.00
6	601877	正泰电器	400,000	8,036,000.00	2.83
7	002765	蓝黛传动	705,294	7,680,651.66	2.71
8	300556	丝路视觉	230,610	7,534,028.70	2.66
9	000728	国元证券	600,000	7,332,000.00	2.58
10	300081	恒信移动	585,700	7,239,252.00	2.55
11	000725	京东方 A	1,700,000	7,072,000.00	2.49
12	300356	光一科技	801,550	6,981,500.50	2.46
13	002074	国轩高科	210,000	6,625,500.00	2.34
14	600369	西南证券	999,902	5,609,450.22	1.98
15	300048	合康变频	1,000,000	5,250,000.00	1.85
16	601555	东吴证券	450,000	5,053,500.00	1.78
17	600146	商赢环球	150,000	4,854,000.00	1.71
18	600999	招商证券	280,000	4,821,600.00	1.70
19	000686	东北证券	450,000	4,522,500.00	1.59
20	002169	智光电气	600,000	4,512,000.00	1.59
21	600837	海通证券	300,000	4,455,000.00	1.57
22	000581	威孚高科	149,996	3,884,896.40	1.37
23	002202	金风科技	249,940	3,866,571.80	1.36
24	600109	国金证券	320,000	3,750,400.00	1.32
25	601616	广电电气	800,000	3,736,000.00	1.32
26	300068	南都电源	200,000	3,368,000.00	1.19
27	600674	川投能源	340,000	3,338,800.00	1.18
28	002407	多氟多	150,000	3,298,500.00	1.16
29	600884	杉杉股份	199,991	3,293,851.77	1.16
30	002532	新界泵业	400,000	3,260,000.00	1.15
31	002434	万里扬	200,000	3,184,000.00	1.12
32	600900	长江电力	200,000	3,076,000.00	1.08

33	002176	江特电机	350,000	3,052,000.00	1.08
34	002516	旷达科技	550,000	3,019,500.00	1.06
35	000957	中通客车	250,000	2,925,000.00	1.03
36	000750	国海证券	499,981	2,749,895.50	0.97
37	600416	湘电股份	200,000	2,740,000.00	0.97
38	300351	永贵电器	150,000	2,734,500.00	0.96
39	002706	良信电器	229,919	2,731,437.72	0.96
40	000400	许继电气	150,000	2,694,000.00	0.95
41	600030	中信证券	150,000	2,553,000.00	0.90
42	601766	中国中车	250,000	2,530,000.00	0.89
43	300258	精锻科技	150,000	2,476,500.00	0.87
44	300424	航新科技	50,000	2,358,500.00	0.83
45	601377	兴业证券	300,000	2,229,000.00	0.79
46	601179	中国西电	400,000	2,224,000.00	0.78
47	601688	华泰证券	120,000	2,148,000.00	0.76
48	002816	和科达	70,000	2,065,000.00	0.73
49	002023	海特高新	199,933	2,053,311.91	0.72
50	601012	隆基股份	120,000	2,052,000.00	0.72
51	601211	国泰君安	100,000	2,051,000.00	0.72
52	601601	中国太保	60,000	2,032,200.00	0.72
53	000601	韶能股份	280,000	1,996,400.00	0.70
54	002736	国信证券	149,937	1,986,665.25	0.70
55	601318	中国平安	40,000	1,984,400.00	0.70
56	600875	东方电气	200,000	1,916,000.00	0.68
57	002536	西泵股份	150,000	1,857,000.00	0.65
58	601126	四方股份	180,000	1,699,200.00	0.60
59	300001	特锐德	100,000	1,676,000.00	0.59
60	600869	智慧能源	200,000	1,346,000.00	0.47

61	002357	富临运业	100,700	1,055,336.00	0.37
62	600310	桂东电力	100,000	686,000.00	0.24
63	600089	特变电工	46,875	484,218.75	0.17
64	002880	卫光生物	998	75,548.60	0.03
65	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
66	002418	康盛股份	5,100	40,851.00	0.01
67	300456	耐威科技	1,000	37,280.00	0.01
68	002271	东方雨虹	1,000	37,100.00	0.01
69	600053	九鼎投资	1,000	34,960.00	0.01
70	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
71	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01
72	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
73	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.01
74	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
75	300041	回天新材	1,000	12,720.00	0.00
76	002445	中南文化	766	9,843.10	0.00
77	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
78	603703	盛洋科技	131	2,354.07	0.00

## 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	002765	蓝黛传动	21,445,208.77	5.42
2	000725	京东方A	21,399,368.00	5.41
3	002499	科林环保	18,332,376.00	4.63
4	300356	光一科技	17,832,416.97	4.51
5	600729	重庆百货	16,607,350.00	4.20

6	300556	丝路视觉	16,483,824.80	4.17
7	601888	中国国旅	15,484,356.66	3.91
8	300196	长海股份	14,340,173.58	3.62
9	603703	盛洋科技	13,199,340.00	3.34
10	600682	南京新百	10,603,984.80	2.68
11	002532	新界泵业	10,391,959.28	2.63
12	002341	新纶科技	9,563,905.00	2.42
13	300083	劲胜精密	9,027,900.34	2.28
14	300266	兴源环境	8,986,735.48	2.27
15	300274	阳光电源	8,305,357.14	2.10
16	000728	国元证券	8,078,801.50	2.04
17	601012	隆基股份	7,641,351.00	1.93
18	601877	正泰电器	7,605,516.70	1.92
19	000860	顺鑫农业	7,495,063.00	1.89
20	300424	航新科技	6,826,355.00	1.72

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	603703	盛洋科技	37,395,880.51	9.45
2	300424	航新科技	35,484,717.16	8.97
3	002445	中南文化	26,489,263.97	6.69
4	300041	回天新材	26,118,771.00	6.60
5	300356	光一科技	25,852,884.04	6.53
6	300456	耐威科技	22,879,807.27	5.78
7	300556	丝路视觉	21,950,944.65	5.55

8	300266	兴源环境	21,125,321.30	5.34
9	002357	富临运业	19,839,050.98	5.01
10	300081	恒信移动	19,506,791.32	4.93
11	601888	中国国旅	16,169,316.56	4.09
12	000725	京东方 A	15,706,000.00	3.97
13	600729	重庆百货	14,702,037.55	3.72
14	002455	百川股份	13,736,603.19	3.47
15	300196	长海股份	13,420,286.90	3.39
16	002418	康盛股份	12,817,022.00	3.24
17	002765	蓝黛传动	10,644,132.77	2.69
18	300083	劲胜精密	9,723,679.53	2.46
19	600682	南京新百	9,579,584.20	2.42
20	300215	电科院	9,302,699.64	2.35

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	493,690,700.89
卖出股票收入（成交）总额	497,274,088.52

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，不考虑相关费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的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。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

## 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

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前



一年内受到公开谴责、处罚。

### 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	171,222.72
2	应收证券清算款	10,659.36
3	应收股利	-
4	应收利息	6,056.42
5	应收申购款	70,754.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	258,693.17

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金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	002499	科林环保	19,202,700.00	6.77	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
8,257	44,371.78	6,235,940.30	1.70%	360,141,830.92	98.30%

### 8.2 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	88,942.31	0.0243%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	0~10

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016年4月28日）基金份额总额	1,861,411,280.10
本报告期期初基金份额总额	429,439,890.44
本报告期基金总申购份额	34,916,081.71
减：本报告期基金总赎回份额	97,978,200.93
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	366,377,771.22

## §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

本报告期内本基金聘请致同会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金的审计机构。

### 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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
光大证券股 份有限公司	1	712,724,216.16	72.00%	663,761.49	72.00%	-
国信证券股 份有限公司	1	277,178,548.74	28.00%	258,135.19	28.00%	-
长城证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

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

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

2、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金不存在交易单元退租情况。

## 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

光大证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股 份有限公司	-	-	60,000,000.00	100.00%	-	-
长城证券股 份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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东亚银行（中国）有限公司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	2017年1月3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	2017年1月4日
3	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基煜基金销售有限公司基金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	2017年1月12日
4	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通和耕传承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	2017年1月12日
5	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万得	中国证券报、上海证券报、证券时报、	2017年1月12日

	投资顾问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	证券日报	
6	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通奕丰金融服务（深圳）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	2017 年 1 月 12 日
7	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加和耕传承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	2017 年 1 月 12 日
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海基煜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	2017 年 1 月 12 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海万得投资顾问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	2017 年 1 月 12 日
10	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微动利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	2017 年 1 月 12 日
11	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）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	2017 年 1 月 12 日
12	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微动利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	2017 年 1 月 19 日

13	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通浙江金观诚财富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	2017 年 1 月 19 日
14	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加浙江金观诚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	2017 年 1 月 19 日
15	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京微动利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	2017 年 1 月 19 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首创证券有限责任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	2017 年 1 月 21 日
17	中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报	2017 年 1 月 21 日
18	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华信证券有限责任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	2017 年 2 月 15 日
19	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海华信证券有限责任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	2017 年 2 月 15 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上海天天基金销售有限公司基金定投及定	中国证券报、上海证券报、证券时报、 证券日报	2017 年 2 月 16 日



	投优惠活动的公告		
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	2017 年 2 月 23 日
22	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通金惠家保险代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	2017 年 3 月 16 日
23	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加金惠家保险代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	2017 年 3 月 16 日
24	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通宜信普泽投资顾问（北京）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	2017 年 3 月 16 日
25	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格上富信投资顾问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	2017 年 3 月 21 日
26	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京格上富信投资顾问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	2017 年 3 月 21 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中国工商银行股份有限公司基金申购费率	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报	2017 年 3 月 30 日

	优惠活动的公告		
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东亚银行（中国）有限公司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	2017 年 3 月 31 日
29	中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 3 月 31 日
30	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通济安财富（北京）资本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	2017 年 4 月 6 日
31	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加济安财富（北京）资本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	2017 年 4 月 6 日
32	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整济安财富（北京）资本管理有限公司基金申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 4 月 8 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上海凯石财富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	2017 年 4 月 13 日
34	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通泰诚财富基金销售（大连）有限公司基金定投业务并参加申购及定投费率	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 4 月 13 日

	优惠活动的公告		
35	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加上海凯石财富基金销售 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	2017 年 4 月 13 日
36	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加泰诚财富基金销售（大 连）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	2017 年 4 月 13 日
37	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加天津万家财富资产管理 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	2017 年 4 月 18 日
38	中邮低碳经济灵活配置混合型证 券投资基金 2017 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	2017 年 4 月 21 日
39	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	2017 年 4 月 22 日
40	中邮创业基金管理股份有限公司 关于参加广发证券股份有限公司 申购费率优惠的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报	2017 年 4 月 26 日
41	关于中邮创业基金管理股份有限 公司旗下部分基金开通联储证券 有限责任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	2017 年 5 月 5 日
42	中邮创业基金管理股份有限公司 关于开通广发证券股份有限公司 基金定投业务并参加定投申购费 率优惠的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报	2017 年 5 月 5 日

43	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加联储证券有限责任公司 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	2017 年 5 月 5 日
44	关于中邮创业基金管理股份有限 公司开通官方微信平台基金定投 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	2017 年 5 月 18 日
45	中邮创业基金管理股份有限公司 关于代销机构调整基金申购费率 的公告	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报	2017 年 5 月 24 日
46	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泰证券 股份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	2017 年 6 月 8 日
47	中邮低碳经济灵活配置混合型证 券投资基金更新招募说明书 (2017 年第 1 号)	中国证券报、上海 证券报、证券时报、 证券日报	2017 年 6 月 9 日
48	关于中邮创业基金管理股份有限 公司旗下部分基金调整上海长量 基金销售投资顾问有限公司基金 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	2017 年 6 月 22 日
49	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肯特 瑞财富投资管理有限公司基金定 投业务并参加认、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	2017 年 6 月 29 日
50	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加北京肯特瑞财富投资管	中国证券报、上海 证券报、证券时报、	2017 年 6 月 29 日

	理有限公司为代销机构的公告	证券日报	
51	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加东亚银行（中国）有限公司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	2017 年 6 月 30 日
52	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	2017 年 6 月 30 日

## **§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。

## §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低碳经济灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮低碳经济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8月29日