

中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金 2018 年半年度报告 摘要

2018 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：2018 年 8 月 28 日

§ 1 重要提示

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 2018 年 8 月 27 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 2018 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日。

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	212,352,588.65 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> <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。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>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</p>

	<p>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。</p> <p>（五）权证投资策略</p> <p>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。</p> <p>（六）股指期货投资策略</p> <p>本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准构成：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	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		010-58511618	010-67595096
传真		010-82295155	010-66275853

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	www.postfund.com.cn
--------------------	--

网址	
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。

§ 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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	-23,394,664.84
本期利润	-32,123,705.04
加权平均基金份额本期利润	-0.1383
本期基金份额净值增长率	-17.85%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.3645
期末基金资产净值	134,947,749.41
期末基金份额净值	0.635

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

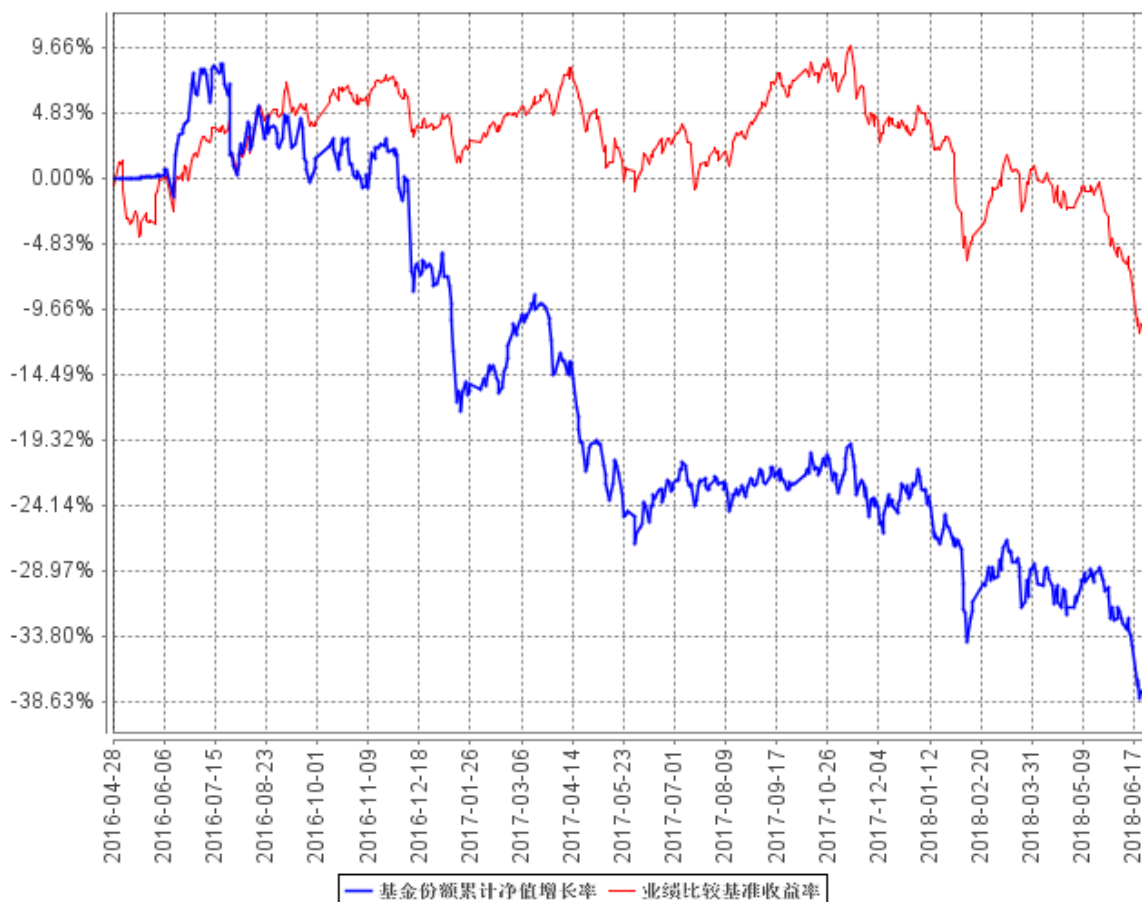
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.03%	1.51%	-6.31%	0.93%	-0.72%	0.58%
过去三个月	-10.69%	1.22%	-11.13%	0.72%	0.44%	0.50%
过去六个月	-17.85%	1.29%	-13.67%	0.78%	-4.18%	0.51%
过去一年	-17.96%	1.09%	-12.96%	0.70%	-5.00%	0.39%
自基金合同生效起至今	-36.50%	1.07%	-10.50%	0.67%	-26.00%	0.40%

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 2018 年 6 月 30 日，本公司共管理 38 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、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、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、中邮睿利增强债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮安泰双核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		
张腾	基金经理	2016年4月28日	-	4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。
吴尚	基金经理	2018年3月21日	-	3年	曾就职于建投投资有限责任公司、就职于中邮创业基金管理股份有限公司担任基金经理助理，现担任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

开年后市场延续了去年年底的蓝筹白马股行情，春节后以科技股为首的成长股板块受益于政策层面的放松及改革预期的提振，市场表现大幅超越蓝筹股，四五月份市场持续震荡，医药及大众消费板块表现较好，进入六月后市场担忧贸易战可能引发中美之间的激烈对抗伤及经济发展，同时去杠杆的逐渐深化也导致诸如债券违约、股权质押平仓等一系列的风险暴露，市场风险偏好急剧下降，导致指数在六月中下旬大跌。

一季度市场运行偏平稳，蓝筹股呈现高开低走行情，而成长股在春节后反弹幅度较大。蓝筹

股板块在本季度后半段持续走低一方面是由于市场修正之前对于蓝筹股年报的过高预期，另一方面前期机构配置蓝筹股过于集中，成长股走强导致机构卖出蓝筹换仓成长也是蓝筹股走弱的一大因素。而成长股的走强主要驱动因素还是利率高位回调风格向成长切换，及市场风险偏好的回升带动资金重回成长。

二季度中美贸易战成为影响市场风险偏好的最大因素，五月下旬至六月份的持续下跌与宏观经济和大多数上市公司的基本面关系较小，主要是受市场情绪的持续悲观所导致。其他诸如债市违约风险、股权质押的平仓风险，人民币汇率的快速贬值引发外资的出逃也是影响二季度市场走势的重要风险因素。总的来看，贸易战及去杠杆预计将是长期与市场伴行的“灰犀牛”，时刻可能引发市场的震动。

上半年基准权重板块中，环保板块受去杠杆政策的影响较大，其重资产模式和现金流较差的缺点受到投资者的回避，季度内表现较差。光伏补贴政策的“黑天鹅”事件引发市场对于依靠政府补贴而发展的行业的担忧，进而导致风电、新能源汽车等相关板块的下跌，二季度新能源板块整体表现也不尽如人意。

上半年，本基金结合市场风险偏好的变化及主题类基金的特点，重点配置了在经济结构转型中，以技术创新或模式创新实现低碳经济的领域，包括人工智能、云计算、工业自动化、先进制造等，同时降低了环保、新能源等领域的配置比例。值得一提的是，年初以来环保及新能源行业整体下跌较多，部分优质公司估值从长期的角度来看已具备吸引力，其短期基本面随受行业政策及市场环境的影响，但长期的发展趋势仍然向好，目前的相对低配是对短期行业不确定因素的规避，我们一直保持对于相关行业的紧密跟踪，一旦行业 and 政策的拐点来临，我们有信心把握住相关投资机会。考虑监管政策及外部因素的不确定性，本基金在上半年内股票仓位在多数时间维持中性水平。

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 0.635 元；本报告期基金份额净值增长率为-17.85%，业绩比较基准收益率为-13.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年中国经济将面临多方面的压力，经济结构转型中的“新动能”短期来看无法弥补“旧经济”的增速下滑，下半年经济增速继续下行已是大概率事件，仍需观察的则是下行的幅度及上层对于经济下行的容忍度，是否会出台“稳增长”的相关政策以及对于房地产行业的态度都是影响市场短中期走势的关键点。贸易战在下半年仍将是影响市场风险偏好的重要因素，需重点关

注中美双方的态度变化及美国中期选举的时间表。整体来看除非政策发生较大幅度的转向，“稳增长”政策超预期，或者外部风险得到较大幅度的改善，下半年市场整体风险大于机会。

板块方面，仍旧看好在经济结构转型中，以技术创新或模式创新实现低碳经济的领域，重点看好云计算、人工智能、半导体等板块。用电量数据年初以来表现强劲，而三季度是全社会用电高峰，电力股有望实现相对收益，且水电和火电板块在经济下行周期体现出一定的防御性及逆周期性，从策略上看也具备配置价值。而如果下半年政策重回放松，则环保及环境工程板块有望反弹，习总书记提出的三大攻坚战中，精准脱贫及污染防治两大主题均与环保板块有关，需重点关注环保相关政策的动向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金公司成立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的真实、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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款		11,876,533.72	23,864,317.57
结算备付金		619,538.38	588,250.31
存出保证金		162,706.18	191,489.64
交易性金融资产		101,040,897.18	166,361,805.54
其中：股票投资		101,040,897.18	166,361,805.54
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		-	20,000,000.00
应收证券清算款		23,137,605.03	-

应收利息		-2,631.51	30,745.58
应收股利		-	-
应收申购款		14,026.33	6,687.97
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		136,848,675.31	211,043,296.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		505,882.71	-
应付赎回款		92,740.73	168,299.27
应付管理人报酬		172,631.18	266,510.77
应付托管费		28,771.84	44,418.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		497,773.50	325,342.87
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		603,125.94	550,322.02
负债合计		1,900,925.90	1,354,893.42
所有者权益:			
实收基金		212,352,588.65	271,091,575.25
未分配利润		-77,404,839.24	-61,403,172.06
所有者权益合计		134,947,749.41	209,688,403.19
负债和所有者权益总计		136,848,675.31	211,043,296.61

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.635 元，基金份额总额 212,352,588.65 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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至 2017年6月30日
一、收入		-28,673,073.34	-57,150,333.54

1.利息收入		186,554.53	273,004.57
其中：存款利息收入		136,065.34	237,304.57
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		50,489.19	35,700.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-20,169,757.41	-71,457,389.16
其中：股票投资收益		-20,600,739.71	-72,585,849.05
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-	-
股利收益		430,982.30	1,128,459.89
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-8,729,040.20	13,881,318.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		39,169.74	152,732.52
减：二、费用		3,450,631.70	4,759,631.13
1. 管理人报酬		1,216,509.78	2,564,986.94
2. 托管费		202,751.62	427,497.82
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		1,770,856.32	1,506,989.81
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用		260,513.98	260,156.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-32,123,705.04	-61,909,964.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-32,123,705.04	-61,909,964.67

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：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	271,091,575.25	-61,403,172.06	209,688,403.19
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-32,123,705.04	-32,123,705.04
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)	-58,738,986.60	16,122,037.86	-42,616,948.74
其中: 1.基金申购款	7,450,450.88	-2,190,126.31	5,260,324.57
2.基金赎回款	-66,189,437.48	18,312,164.17	-47,877,273.31
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)	212,352,588.65	-77,404,839.24	134,947,749.41
项目	上年度可比期间 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(本期净利润)	-	-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

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：

_____ 曹均	_____ 曹均	_____ 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 110ZC0235 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》、财税[2017]56 号《财政部 国家税务总局 关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《财政部 国家税务总局 关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1. 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。

基金增值税应税行为包括贷款服务和金融商品转让。采用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。基金管理人运营基金提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：

(1) 提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；(2) 转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,216,509.78	2,564,986.94
其中：支付销售机构的客户维护费	353,451.26	835,242.93

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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	202,751.62	427,497.82

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。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期及上年度可比期间，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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期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。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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	11,876,533.72	127,496.66	22,497,455.59	228,489.36

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2018 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

注：本基金未持有因认购新发/增发而于期末流通受限股票。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 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。

6.4.10 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	101,040,897.18	73.83
	其中：股票	101,040,897.18	73.83
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	12,496,072.10	9.13
7	其他各项资产	23,311,706.03	17.03
8	合计	136,848,675.31	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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	69,235,929.18	51.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	4,434,239.00	3.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务	14,629,879.00	10.84

	业		
J	金融业	2,929,000.00	2.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,593,600.00	3.40
M	科学研究和技术服务业	3,323,250.00	2.46
N	水利、环境和公共设施管理业	1,895,000.00	1.40
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	101,040,897.18	74.87

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

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	300628	亿联网络	100,000	6,591,000.00	4.88
2	002236	大华股份	250,000	5,637,500.00	4.18
3	002027	分众传媒	480,000	4,593,600.00	3.40
4	600009	上海机场	79,925	4,434,239.00	3.29
5	300523	辰安科技	65,000	4,048,200.00	3.00
6	002371	北方华创	80,000	3,973,600.00	2.94
7	603799	华友钴业	40,000	3,898,800.00	2.89
8	603803	瑞斯康达	300,000	3,885,000.00	2.88
9	300750	宁德时代	50,000	3,598,000.00	2.67
10	603259	药明康德	35,000	3,323,250.00	2.46

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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	603799	华友钴业	16,153,248.26	7.70
2	300015	爱尔眼科	13,081,589.03	6.24
3	002460	赣锋锂业	12,698,115.45	6.06
4	600887	伊利股份	12,165,162.77	5.80
5	300607	拓斯达	10,687,368.70	5.10
6	300628	亿联网络	10,099,549.00	4.82
7	002466	天齐锂业	9,793,658.10	4.67
8	002027	分众传媒	9,667,042.00	4.61
9	600036	招商银行	9,262,454.70	4.42
10	600466	蓝光发展	9,206,660.00	4.39
11	601012	隆基股份	9,142,184.00	4.36
12	600340	华夏幸福	8,510,076.00	4.06
13	300124	汇川技术	8,485,631.00	4.05
14	300383	光环新网	8,032,742.00	3.83
15	002185	华天科技	7,984,216.00	3.81
16	300523	辰安科技	7,650,082.61	3.65
17	000961	中南建设	7,614,850.00	3.63
18	600584	长电科技	7,277,985.00	3.47
19	002341	新纶科技	7,216,560.44	3.44
20	002008	大族激光	7,205,983.00	3.44
21	600426	华鲁恒升	7,184,262.60	3.43
22	002371	北方华创	7,003,475.96	3.34
23	000066	中国长城	6,911,541.00	3.30
24	600056	中国医药	6,774,977.50	3.23
25	300148	天舟文化	6,543,087.50	3.12
26	601111	中国国航	6,514,223.98	3.11
27	600030	中信证券	6,296,496.00	3.00
28	300750	宁德时代	6,250,025.90	2.98
29	002146	荣盛发展	6,154,100.18	2.93
30	002236	大华股份	5,996,127.00	2.86

31	300474	景嘉微	5,988,103.00	2.86
32	000858	五粮液	5,872,928.00	2.80
33	603259	药明康德	5,817,535.00	2.77
34	002142	宁波银行	5,807,728.80	2.77
35	601398	工商银行	5,600,000.00	2.67
36	600585	海螺水泥	5,334,657.00	2.54
37	601009	南京银行	5,302,940.00	2.53
38	002668	奥马电器	5,218,923.00	2.49
39	600048	保利地产	5,129,230.28	2.45
40	603803	瑞斯康达	5,097,643.90	2.43
41	002222	福晶科技	4,997,981.75	2.38
42	600188	兖州煤业	4,910,801.50	2.34
43	002410	广联达	4,901,400.78	2.34
44	601899	紫金矿业	4,824,100.00	2.30
45	000997	新大陆	4,788,258.00	2.28
46	000651	格力电器	4,721,133.00	2.25
47	600009	上海机场	4,584,944.52	2.19
48	300418	昆仑万维	4,424,998.00	2.11
49	002271	东方雨虹	4,395,917.00	2.10
50	000960	锡业股份	4,364,870.00	2.08
51	002174	游族网络	4,324,392.00	2.06
52	000538	云南白药	4,298,931.56	2.05
53	002313	日海智能	4,270,808.31	2.04
54	002714	牧原股份	4,242,032.00	2.02

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	600887	伊利股份	15,865,048.20	7.57
2	300015	爱尔眼科	14,820,115.29	7.07
3	600499	科达洁能	13,431,025.00	6.41
4	603799	华友钴业	12,222,684.00	5.83
5	300137	先河环保	10,895,202.42	5.20
6	002460	赣锋锂业	10,662,710.00	5.09
7	600388	龙净环保	10,454,835.87	4.99

8	002202	金风科技	10,126,214.20	4.83
9	603938	三孚股份	9,960,064.22	4.75
10	600036	招商银行	9,169,917.30	4.37
11	601888	中国国旅	8,909,480.00	4.25
12	300607	拓斯达	8,834,337.20	4.21
13	300274	阳光电源	8,754,209.64	4.17
14	002466	天齐锂业	8,714,973.62	4.16
15	600466	蓝光发展	8,660,584.00	4.13
16	002573	清新环境	8,267,790.56	3.94
17	300630	普利制药	8,220,911.09	3.92
18	002456	欧菲科技	8,140,721.36	3.88
19	300662	科锐国际	8,126,742.07	3.88
20	002185	华天科技	7,857,561.00	3.75
21	000961	中南建设	7,778,450.00	3.71
22	002008	大族激光	7,778,347.50	3.71
23	601012	隆基股份	7,571,474.00	3.61
24	600056	中国医药	6,909,063.00	3.29
25	600340	华夏幸福	6,857,673.00	3.27
26	002341	新纶科技	6,768,237.00	3.23
27	603757	大元泵业	6,766,127.40	3.23
28	000066	中国长城	6,679,250.06	3.19
29	600584	长电科技	6,604,958.00	3.15
30	002415	海康威视	6,598,730.05	3.15
31	002668	奥马电器	6,440,096.00	3.07
32	300523	辰安科技	6,256,451.20	2.98
33	300383	光环新网	5,996,309.00	2.86
34	300124	汇川技术	5,850,368.00	2.79
35	000826	启迪桑德	5,837,986.00	2.78
36	000858	五粮液	5,625,394.99	2.68
37	601111	中国国航	5,567,369.00	2.66
38	002142	宁波银行	5,399,449.80	2.57
39	300266	兴源环境	5,308,338.00	2.53
40	002027	分众传媒	5,278,907.29	2.52
41	600030	中信证券	5,258,817.08	2.51
42	002812	创新股份	5,227,756.00	2.49
43	000997	新大陆	5,205,192.81	2.48
44	002146	荣盛发展	5,071,011.00	2.42
45	002222	福晶科技	5,066,333.25	2.42

46	600585	海螺水泥	5,053,973.00	2.41
47	300148	天舟文化	4,964,670.00	2.37
48	600426	华鲁恒升	4,953,519.86	2.36
49	300122	智飞生物	4,893,281.64	2.33
50	002410	广联达	4,891,428.46	2.33
51	002174	游族网络	4,762,096.00	2.27
52	000651	格力电器	4,758,908.12	2.27
53	002313	日海智能	4,705,229.00	2.24
54	600048	保利地产	4,568,374.00	2.18
55	601398	工商银行	4,542,650.00	2.17
56	601009	南京银行	4,443,934.00	2.12
57	300418	昆仑万维	4,443,852.60	2.12
58	000538	云南白药	4,414,584.87	2.11

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	558,598,968.94
卖出股票收入（成交）总额	594,590,097.39

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

注：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

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

注：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

注：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	162,706.18
2	应收证券清算款	23,137,605.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-2,631.51
5	应收申购款	14,026.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,311,706.03

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

金注：本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

§ 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
5,457	38,913.80	6,235,940.30	2.94%	206,116,648.35	97.06%

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	0.00	0.0000%

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

§ 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	271,091,575.25
本报告期基金总申购份额	7,450,450.88
减：本报告期基金总赎回份额	66,189,437.48
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	212,352,588.65

§ 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 2018 年 5 月 22 日起，孔军先生、朱宗树先生任本基金管理人副总经理；自 2018 年 5 月

22 日起，张静女士、李小丽女士不再担任本基金管理人副总经理。

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	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	
光大证券股份有限公司	1	530,461,725.70	46.00%	494,020.64	46.00%	-
国信证券股份有限公司	1	444,746,760.16	38.57%	414,193.33	38.57%	-
长城证券股份有限公司	1	177,980,580.47	15.43%	165,753.80	15.43%	-

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	-	-	90,000,000.00	100.00%	-	-
长城证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

§ 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
2018 年 8 月 28 日