

# 中邮核心优势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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（简称：中国农业银行）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	中邮核心优势灵活配置混合
基金主代码	590003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 10 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	357,031,074.84 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理的动态资产配置，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，充分挖掘和利用中国经济结构调整过程中的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	通过对宏观经济形势以及市场状况的深入分析，采用灵活的大类资产配置策略，应用系统化的风险管理工具准确跟踪和全程监控投资组合风险，力求在较低的风险水平上，为投资者提供超越业绩比较基准的收益。本基金重点投资核心优势企业，因为这类企业能够获得持续稳定的发展以及超过行业平均水平的超额利润，投资这类公司能够增强基金对证券市场系统性风险的抵御能力，充分分享中国经济结构调整过程中的投资机会，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深 300 指数，债券部分的业绩比较基准为上证国债指数。 整体业绩比较基准=沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

### 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	中国农业银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	侯玉春	贺倩
	联系电话	010-82295160—157	010-66060069
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010—58511618	95599
传真		010-82295155	010-68121816

## 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	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

## § 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	-12,916,708.11
本期利润	-16,024,862.46
加权平均基金份额本期利润	-0.0436
本期基金份额净值增长率	-3.18%
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	0.3994
期末基金资产净值	499,622,439.89
期末基金份额净值	1.399

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	-5.28%	1.62%	-4.46%	0.77%	-0.82%	0.85%
过去三个月	-5.41%	1.47%	-5.43%	0.68%	0.02%	0.79%
过去六个月	-3.18%	1.43%	-6.72%	0.69%	3.54%	0.74%
过去一年	-12.40%	1.23%	-1.09%	0.57%	-11.31%	0.66%
过去三年	-35.17%	1.82%	-8.16%	0.89%	-27.01%	0.93%
自基金合同 生效起至今	64.79%	1.54%	23.60%	0.89%	41.19%	0.65%

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. 关于业绩基准的说明

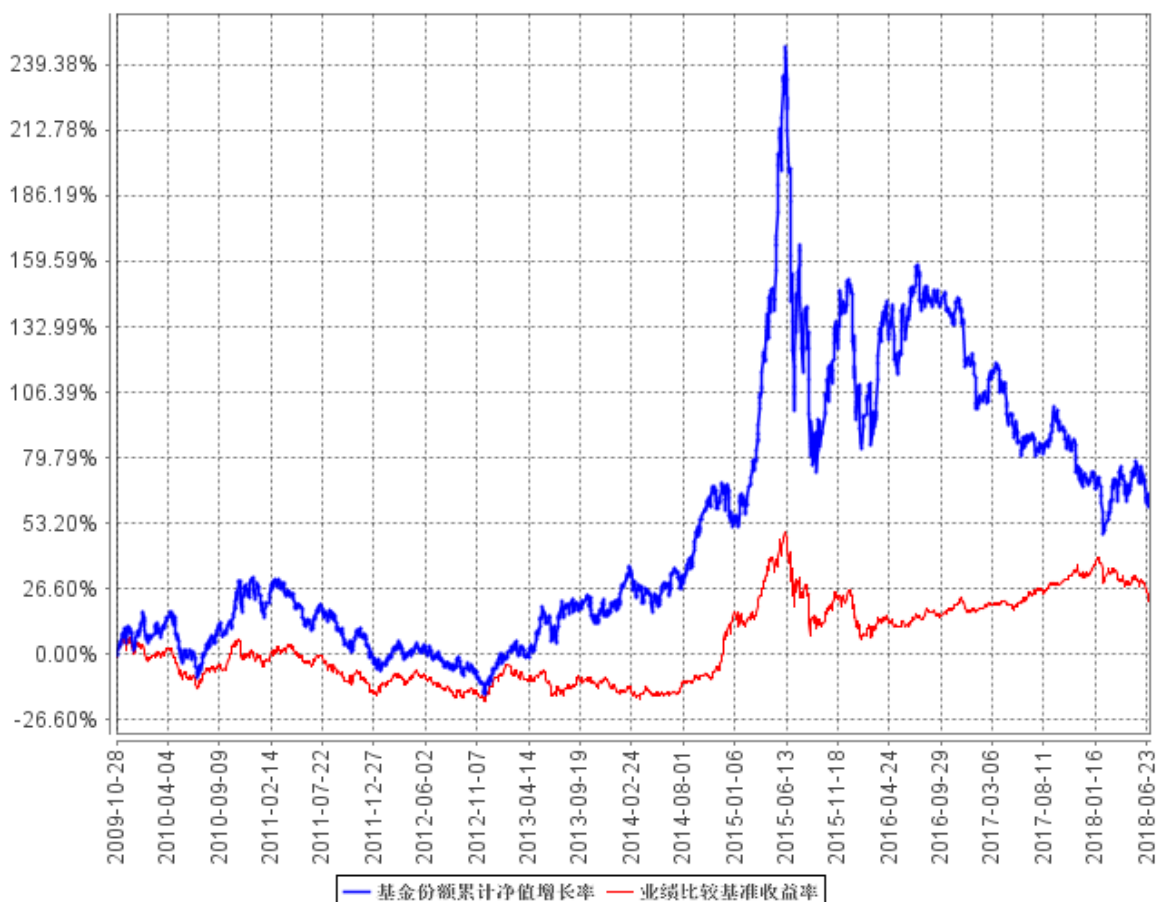
本基金业绩衡量基准 = 沪深 300 指数 × 60% + 上证国债指数 × 40%

沪深 300 指数作为按自由流通股本加权的跨两市蓝筹股指数，其指数样本股市值覆盖了上交所和深交所上市的所有股票市值的 70%，具有较强的代表意义。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数中沪深 300 指数和上海国债指数每日分别计算收益率，然后按 60%、40%的比例采取再平衡，再用循环计算的方式得到基准指数的时间序列。

### 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	2015年3月18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。

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

回过头来看 2018 年上半年，无论是对于主板还是创业板，市场都是经历了一个小反弹然后开始掉头向下。对于主板，年初在房地产销售数据超预期的带动下，房地产及地产产业链相关板块走强，消费板块的蓝筹白马也表现亮眼，春节前后，市场对全球经济数据较为乐观，叠加供给侧改革的深化，周期金融板块也迎来一轮小反弹；紧接着，随着市场风险偏好提升，经济复苏仍需要长期验证，持续了一年多的风格分化使得成长股从 PEG 等角度性价比优势得以体现，外部边际资金的流入以及场内机构资金的换仓使得创业板的行情愈演愈烈。2 季度国内外风险逐步显现或加剧：国内方面在紧信用去杠杆的大趋势下债市风险逐步暴露，信用利差进一步扩大，避险情绪蔓延压制市场风险偏好；国际形势动荡加剧，美朝核谈以及中美贸易战的反反复复，使得市场缺乏稳定预期，而国际油价创新高加剧了宏观经济增长的不确定性。在这一宏观背景下，本基金策略上由此前的进攻性转为偏重防御，在具体操作上，降低了此前偏进攻型的计算机、电子等板块的配置，而主要增加了防御型的医药、酒店等板块，以及业绩增速有保障的阅读板块的配置；另一方面随着各风险因素的进一步发酵，本基金也通过降低股票仓位控制风险。



#### 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 1.399 元，累计净值为 1.579 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.18%，业绩比较基准收益率为-6.72%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

站在当前时点，我们对中美关系及贸易战的演化持悲观观点，而这将长期压制市场风险偏好；国内方面，虽然存在为了对冲贸易战冲击而出台一些边际放松政策，但是在去杠杆的大方向下也仅仅是阶段性节奏的一些变化，政策全面放松缺乏外部环境支持。预计三季度经济下行压力较大，政策趋向稳增长或使四季度经济企稳，下半年债券机会大于股票，行业配置方向上对基建谨慎乐观，更看好制造升级。市场风格角度，对前期涨幅较大白马抱团较多的消费龙头，以及股权质押比例过高容易出现爆仓风险的品种进行回避。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、基金托管协议的约定，对本基金管理人——中邮创业基

基金管理股份有限公司 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人认为，中邮创业基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 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

本托管人认为，中邮创业基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：中邮核心优势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
<b>资产：</b>			
银行存款		31,210,152.53	80,724,542.98
结算备付金		3,459,955.09	1,592,704.70
存出保证金		768,976.27	767,575.01
交易性金融资产		382,752,842.06	422,956,477.92
其中：股票投资		306,234,708.32	337,676,760.92

基金投资		-	-
债券投资		76,518,133.74	85,279,717.00
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		98,000,000.00	72,000,000.00
应收证券清算款		5,191,853.40	53,076.45
应收利息		194,308.48	1,935,948.91
应收股利		-	-
应收申购款		379,339.99	261,411.24
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		521,957,427.82	580,291,737.21
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018年6月30日</b>	<b>上年度末 2017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		9,254,061.98	2,124,231.69
应付赎回款		112,239.38	165,353.55
应付管理人报酬		629,362.35	885,224.01
应付托管费		104,893.74	147,537.36
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		1,376,814.38	959,149.76
应交税费		9,917,690.48	9,917,287.96
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		939,925.62	916,840.18
负债合计		22,334,987.93	15,115,624.51
<b>所有者权益:</b>			
实收基金		357,031,074.84	391,257,011.80
未分配利润		142,591,365.05	173,919,100.90
所有者权益合计		499,622,439.89	565,176,112.70
负债和所有者权益总计		521,957,427.82	580,291,737.21

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.399 元，基金份额总额 357,031,074.84 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮核心优势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
<b>一、收入</b>		-4,423,659.43	-132,967,039.03
1.利息收入		1,290,253.08	4,136,049.28
其中：存款利息收入		414,630.03	1,152,947.53
债券利息收入		707,943.61	2,904,740.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		167,679.44	78,361.14
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,644,120.18	-91,116,489.87
其中：股票投资收益		-2,052,325.08	-93,943,019.53
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-3,325,188.48	-1,117,126.93
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		2,733,393.38	3,943,656.59
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-3,108,154.35	-46,220,548.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		38,362.02	233,950.04
<b>减：二、费用</b>		11,601,203.03	11,084,559.05
1. 管理人报酬		3,884,396.66	7,517,676.07
2. 托管费		647,399.45	1,252,945.97
3. 销售服务费	6.4.8.2.3	-	-
4. 交易费用		6,792,178.52	2,011,242.34
5. 利息支出		10,341.79	15,512.65
其中：卖出回购金融资产支出		10,341.79	15,512.65
6. 税金及附加		1,747.05	-
7. 其他费用		265,139.56	287,182.02
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-16,024,862.46	-144,051,598.08
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-16,024,862.46	-144,051,598.08

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮核心优势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)	391,257,011.80	173,919,100.90	565,176,112.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-16,024,862.46	-16,024,862.46
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)	-34,225,936.96	-15,302,873.39	-49,528,810.35
其中：1.基金申购款	17,151,451.14	7,112,175.57	24,263,626.71
2.基金赎回款	-51,377,388.10	-22,415,048.96	-73,792,437.06
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)	357,031,074.84	142,591,365.05	499,622,439.89
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)	618,007,884.96	522,070,913.34	1,140,078,798.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期净利润)	-	-144,051,598.08	-144,051,598.08
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)	-21,854,177.60	-22,036,488.80	-43,890,666.40
其中：1.基金申购款	111,850,890.10	76,451,437.44	188,302,327.54
2.基金赎回款	-133,705,067.70	-98,487,926.24	-232,192,993.94

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）	596,153,707.36	355,982,826.46	952,136,533.82

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：

<u>曹均</u>	<u>曹均</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

中邮核心优势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[2009]811号《关于核准中邮核心优势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《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于2009年10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3,942,346,068.45元，业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字(2009)第079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，基金托管人为中国农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《中邮核心优势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：股票资产占基金资产的比例为30%-80%，债券资产占基金资产的15%-65%，权证的投资比例为基金资产净值的0%-3%，并保持不低于基金资产5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

### 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
中国农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

## 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

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。

### 6.4.8.2 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	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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	3,884,396.66	7,517,676.07
其中：支付销售机构的客户维护费	984,921.55	1,716,064.95

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人报酬按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，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

#### 6.4.8.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	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	647,399.45	1,252,945.97

注：支付基金托管人中国农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 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：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

#### 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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2009 年 10 月 28 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	961,007.95	961,007.95
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	961,007.95	961,007.95

期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.2700%	0.1600%
-----------------------	---------	---------

#### 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：本报告期末及上年度末，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
中国农业银行 股份有限公司	31,210,152.53	376,869.46	118,114,799.83	1,140,278.59

#### 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：本基金未持有认购新发/增发而于期末流通受限证券。

##### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票 代码	股票 名称	停牌 日期	停 牌 原 因	期 末 估 值 单 价	复 牌 日 期	复 牌 开 盘 单 价	数 量 （ 股 ）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
300266	兴源 环境	2018 年 2月 5日	重大 事项	16.64	2018 年 7月 2日	17.99	1,040,144	27,051,533.32	17,307,996.16	-

注：根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告[2017]13号）等有关规定，对上述300266兴源环境股票估值方法进行调整（详见基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司相关公告）。

### 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银行间市场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交易所市场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	306,234,708.32	58.67
	其中：股票	306,234,708.32	58.67
2	固定收益投资	76,518,133.74	14.66
	其中：债券	76,518,133.74	14.66
	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	98,000,000.00	18.78
	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	34,670,107.62	6.64
7	其他各项资产	6,534,478.14	1.25
8	合计	521,957,427.82	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	221.22	0.00

B	采矿业	-	-
C	制造业	91,917,506.53	18.40
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	3,794.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	61,441,200.00	12.30
H	住宿和餐饮业	3,389.32	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,288,681.96	14.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	25,129,989.01	5.03
L	租赁和商务服务业	41,040.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	2,183,850.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	17,307,996.16	3.46
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,260.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	35,914,780.12	7.19
S	综合	-	-
	合计	306,234,708.32	61.29

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	603096	新经典	425,254	35,627,780.12	7.13
2	300036	超图软件	1,365,000	27,832,350.00	5.57

3	603506	南都物业	748,139	25,129,989.01	5.03
4	002042	华孚时尚	3,310,890	24,633,021.60	4.93
5	002087	新野纺织	5,201,891	23,356,490.59	4.67
6	603868	飞科电器	456,779	22,094,400.23	4.42
7	600115	东方航空	3,250,000	21,515,000.00	4.31
8	600029	南方航空	2,442,000	20,634,900.00	4.13
9	601111	中国国航	2,170,000	19,291,300.00	3.86
10	300377	赢时胜	1,340,000	18,210,600.00	3.64

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	603096	新经典	72,080,166.28	12.75
2	603506	南都物业	56,079,639.30	9.92
3	300612	宣亚国际	55,512,542.50	9.82
4	601012	隆基股份	54,032,299.19	9.56
5	603533	掌阅科技	52,357,038.59	9.26
6	300571	平治信息	51,379,458.80	9.09
7	300556	丝路视觉	41,461,789.94	7.34
8	600115	东方航空	40,126,401.00	7.10
9	300274	阳光电源	39,926,049.75	7.06
10	300232	洲明科技	36,113,386.86	6.39
11	603986	兆易创新	35,050,642.00	6.20
12	600029	南方航空	33,222,679.00	5.88
13	601111	中国国航	33,121,150.80	5.86
14	300083	劲胜精密	30,779,050.00	5.45
15	603019	中科曙光	30,624,740.06	5.42
16	601398	工商银行	29,790,968.70	5.27
17	300630	普利制药	29,752,440.13	5.26
18	002008	大族激光	29,575,248.40	5.23
19	002925	盈趣科技	29,282,237.83	5.18
20	603868	飞科电器	29,109,082.81	5.15

21	600271	航天信息	28,420,843.53	5.03
22	601336	新华保险	28,326,053.00	5.01
23	002916	深南电路	28,280,312.46	5.00
24	601888	中国国旅	27,800,912.74	4.92
25	300036	超图软件	27,492,118.56	4.86
26	300033	同花顺	27,158,303.00	4.81
27	601939	建设银行	27,152,724.90	4.80
28	603658	安图生物	26,755,858.00	4.73
29	601857	中国石油	26,611,148.00	4.71
30	600754	锦江股份	26,401,120.42	4.67
31	002042	华孚色纺	26,220,436.18	4.64
32	300059	东方财富	25,977,425.84	4.60
33	600258	首旅酒店	25,922,196.04	4.59
34	600028	中国石化	25,767,084.40	4.56
35	000651	格力电器	25,520,960.88	4.52
36	002241	歌尔股份	25,172,747.14	4.45
37	002087	新野纺织	24,797,986.12	4.39
38	002508	老板电器	24,506,478.74	4.34
39	600036	招商银行	24,503,030.05	4.34
40	000333	美的集团	24,161,584.00	4.28
41	600887	伊利股份	22,872,601.98	4.05
42	603179	新泉股份	22,580,111.00	4.00
43	601088	中国神华	22,440,021.02	3.97
44	300122	智飞生物	21,640,093.00	3.83
45	002841	视源股份	18,670,043.90	3.30
46	002668	奥马电器	18,160,573.08	3.21
47	300124	汇川技术	17,992,264.98	3.18
48	601225	陕西煤业	17,414,595.00	3.08
49	300377	赢时胜	17,414,048.05	3.08
50	300266	兴源环境	17,316,871.09	3.06
51	002230	科大讯飞	15,646,852.70	2.77
52	002202	金风科技	14,745,279.73	2.61
53	600019	宝钢股份	14,531,437.00	2.57
54	002414	高德红外	14,404,056.36	2.55
55	300607	拓斯达	13,913,914.80	2.46
56	002415	海康威视	13,759,897.38	2.43

57	002129	中环股份	13,574,359.00	2.40
58	002232	启明信息	13,275,198.00	2.35
59	300178	腾邦国际	12,015,605.60	2.13
60	300226	上海钢联	11,605,549.87	2.05

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	300571	平治信息	60,816,285.84	10.76
2	300612	宣亚国际	55,962,391.40	9.90
3	603096	新经典	52,640,301.70	9.31
4	601012	隆基股份	52,442,323.95	9.28
5	002841	视源股份	50,045,884.19	8.85
6	300556	丝路视觉	43,250,777.34	7.65
7	300274	阳光电源	39,815,546.90	7.04
8	603506	南都物业	39,731,147.00	7.03
9	300232	洲明科技	38,628,316.50	6.83
10	603533	掌阅科技	36,882,057.04	6.53
11	603658	安图生物	36,164,311.88	6.40
12	600887	伊利股份	35,160,224.89	6.22
13	603986	兆易创新	34,238,881.96	6.06
14	601888	中国国旅	33,618,399.60	5.95
15	601225	陕西煤业	33,404,818.57	5.91
16	600271	航天信息	32,570,848.20	5.76
17	002008	大族激光	32,570,271.88	5.76
18	603019	中科曙光	31,895,498.03	5.64
19	300083	劲胜精密	31,877,203.55	5.64
20	002466	天齐锂业	31,168,167.60	5.51
21	300630	普利制药	30,821,301.00	5.45
22	601088	中国神华	29,634,196.20	5.24
23	603799	华友钴业	29,448,878.65	5.21
24	600408	*ST 安泰	28,619,592.40	5.06
25	600258	首旅酒店	27,845,524.04	4.93
26	601398	工商银行	27,396,278.95	4.85
27	300059	东方财富	26,945,589.16	4.77
28	000651	格力电器	26,940,046.00	4.77

29	002916	深南电路	26,780,051.00	4.74
30	600146	商赢环球	26,726,078.12	4.73
31	002925	盈趣科技	26,456,208.87	4.68
32	600754	锦江股份	26,141,329.65	4.63
33	601857	中国石油	25,568,993.25	4.52
34	002241	歌尔股份	25,461,080.90	4.50
35	600028	中国石化	25,371,290.00	4.49
36	601939	建设银行	24,877,867.30	4.40
37	603377	东方时尚	24,778,990.31	4.38
38	300142	沃森生物	24,645,887.57	4.36
39	601336	新华保险	24,297,769.23	4.30
40	002508	老板电器	24,083,078.70	4.26
41	000333	美的集团	23,522,876.44	4.16
42	600036	招商银行	22,645,569.95	4.01
43	300033	同花顺	22,119,878.00	3.91
44	002460	赣锋锂业	22,041,043.88	3.90
45	603179	新泉股份	20,873,686.85	3.69
46	300122	智飞生物	19,807,345.00	3.50
47	300124	汇川技术	16,971,649.00	3.00
48	300266	兴源环境	16,770,912.29	2.97
49	002230	科大讯飞	16,636,627.65	2.94
50	002668	奥马电器	16,062,858.60	2.84
51	600115	东方航空	15,442,564.00	2.73
52	300607	拓斯达	15,332,698.40	2.71
53	002232	启明信息	15,131,088.00	2.68
54	002415	海康威视	14,086,438.25	2.49
55	002414	高德红外	13,606,997.58	2.41
56	002202	金风科技	13,025,467.03	2.30
57	600019	宝钢股份	12,911,772.88	2.28
58	002129	中环股份	12,874,560.00	2.28

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	2,216,660,267.03
卖出股票收入（成交）总额	2,239,209,744.30

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	76,518,133.74	15.32
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	76,518,133.74	15.32

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110039	宝信转债	165,600	23,851,368.00	4.77
2	123006	东财转债	131,992	15,874,677.84	3.18
3	128035	大族转债	85,724	9,841,115.20	1.97
4	128028	赣锋转债	91,043	9,465,740.71	1.89
5	123005	万信转债	50,007	7,764,586.89	1.55

## 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

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与股指期货的投资。

## 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	768,976.27
2	应收证券清算款	5,191,853.40
3	应收股利	-
4	应收利息	194,308.48
5	应收申购款	379,339.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,534,478.14

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	110039	宝信转债	23,851,368.00	4.77
2	123006	东财转债	15,874,677.84	3.18
3	128028	赣锋转债	9,465,740.71	1.89
4	123005	万信转债	7,764,586.89	1.55
5	128032	双环转债	1,966,124.30	0.39
6	113015	隆基转债	1,318,222.40	0.26
7	128015	久其转债	468,000.00	0.09
8	128029	太阳转债	12,119.00	0.00
9	110042	航电转债	10,515.00	0.00
10	128024	宁行转债	10,461.00	0.00
11	128016	雨虹转债	10,382.00	0.00
12	113011	光大转债	10,148.00	0.00
13	110040	生益转债	9,956.00	0.00
14	110038	济川转债	9,780.00	0.00
15	113014	林洋转债	9,024.00	0.00
16	110032	三一转债	1,227.40	0.00

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限股票。

### 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
29,979	11,909.37	3,636,670.18	1.02%	353,394,404.66	98.98%

### 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	2,145.98	0.0006%

### 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（2009年10月28日）基金份额总额	3,942,346,068.45
本报告期期初基金份额总额	391,257,011.80
本报告期基金总申购份额	17,151,451.14
减：本报告期基金总赎回份额	51,377,388.10

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	357,031,074.84

## § 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	
招商证券股份有限公司	1	2,145,504,204.27	48.16%	1,998,111.03	48.16%	-
中泰证券股份有限公司	2	1,978,369,147.82	44.41%	1,842,450.47	44.41%	-
长城证券股份有限公司	1	169,805,618.04	3.81%	158,140.74	3.81%	-
渤海证券股份有限公司	1	160,961,297.40	3.61%	149,903.41	3.61%	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申银宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
平安证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	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
招商证券股份有限公司	175,247,603.91	45.99%	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	185,723,560.04	48.74%	34,200,000.00	21.09%	-	-
长城证券股份有限公司	20,075,984.40	5.27%	128,000,000.00	78.91%	-	-
渤海证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
金元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申银宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券有限	-	-	-	-	-	-

责任公司						
中信证券股份 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