

中邮核心科技创新灵活配置混合型 证券投资基金 2018 年半年度报告

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2018 年 8 月 28 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金-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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：邮储银行）根据本基金合同规定，于 2018 年 08 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新。

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。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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.....	9
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	10
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
§4 管理人报告	12
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
§5 托管人报告	16
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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
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.....	19

6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
§8 基金份额持有人信息.....	44
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
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.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮科技创新
基金主代码	000966
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 2 月 11 日
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	220,322,214.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注在我国经济转型中受益于科技创新的企业，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”的股票投资策略相结合的方法进行投资。</p> <p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，本基金通过对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金将重点关注在中国经济转型过程中，由科技创新带来的具有广阔市场空间及持续成长能力的优质企业，采用自下而上个股精选的股票投资策略，精选上市公司股票。本基金所指的科技创新主要分为科技制造创新和科技服务创新两方面。</p> <p>1、科技创新主题的界定</p> <p>（1）科技制造创新</p> <p>我国未来经济发展的重要立足点在于能够实现由制造大国向制造强国的转变，科学技术的创新是实现制造强国的重要手段。随着我国人口红利的逐渐结束，传统制造业面临劳动力成本上涨的困境，因此依靠科技创新颠覆传统的生产制造方式，提高生产效率和制造的附加值将是制造业未来的发展趋势。</p> <p>高端装备制造业是科技制造创新的典型代表。高端装</p>

备制造业是制造业的先导产业，具有高、精、专的特点，同时高端装备制造业既是科技创新的成果，也是推动科技创新的主要动力之一，因此高端装备制造业是本基金投资科技创新的主要方向之一。

（2）科技服务创新

伴随着人口结构的改变及消费升级，科技服务逐渐成为消费的重要方向之一，科技服务的创新也正在改变着人们的生活方式。

互联网行业是科技服务创新的重要体现。在互联网行业与各行业的融合和碰撞过程中，用户体验的提升，商业模式的重塑，新的盈利增长点的诞生，都是本基金主要关注的方向。

本基金管理人将持续跟踪国家相关政策、关注科技创新的发展状况、科研成果和技术工艺的重大突破新等因素的变化，对科技创新的范畴进行动态调整。

2、核心科技创新主题的个股特征

具体来说，本基金将重点筛选具有如下“核心科技创新”特征的企业：

（1）提供全新的产品或服务、开创新的产业领域，或以以前所未有的方式提供已有的产品或服务，并且产品或服务具有核心竞争优势；

（2）应用新知识、新技术、新工艺、新思维，大幅降低生产成本、提高产品质量和产量；

（3）在技术边界上提高生产技术手段、强化工艺流程，在业务边界上改进产品和服务体验，在运作边界上扩大产业活动基础平台，在市场边界上增强产品和服务的竞争力；

（4）在商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等诸多方面的变化和创新，通过这些创新实现了企业成本的降低、盈利的增加和竞争实力的提高；

（5）改善人类生活质量、推动经济的发展和社会的进步。

（三）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。

（四）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

	<p>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>（五）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，特别是在科技创新受经济环境、政策监管等外部重要因素影响时相应行业的上市公司股价变化可能出现一定程度的波动，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	<p>本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%</p> <p>本基金股票投资的业绩比较基准为沪深 300 指数，债券投资的业绩比较基准为上证国债指数，主要基于以下原因：</p> <p>沪深 300 指数是由上海和深圳证券交易所中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性和市场流动性。沪深 300 指数与市场整体表现具有较高的相关性，且指数历史表现强于市场平均收益水平，具有良好的投资价值。该指数由中证指数公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护，编制方法的透明度高，具有独立性。</p> <p>上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。上证国债指数编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性，能够满足本基金的投资管理需要。</p> <p>随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒介上刊登公告。</p>
风险收益特征	<p>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。</p>

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	田东辉
	联系电话	010-82295160—157	010-68858113
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		010-58511618	95580
传真		010-82295155	010-68858120
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 3 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		100013	100808
法定代表人		曹均	李国华

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住所。

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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	7,779,430.50
本期利润	-8,133,495.11
加权平均基金份额本期利润	-0.0359
本期加权平均净值利润率	-3.79%
本期基金份额净值增长率	-4.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-19,334,221.31
期末可供分配基金份额利润	-0.0878
期末基金资产净值	200,987,993.68
期末基金份额净值	0.912
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-8.80%

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）。

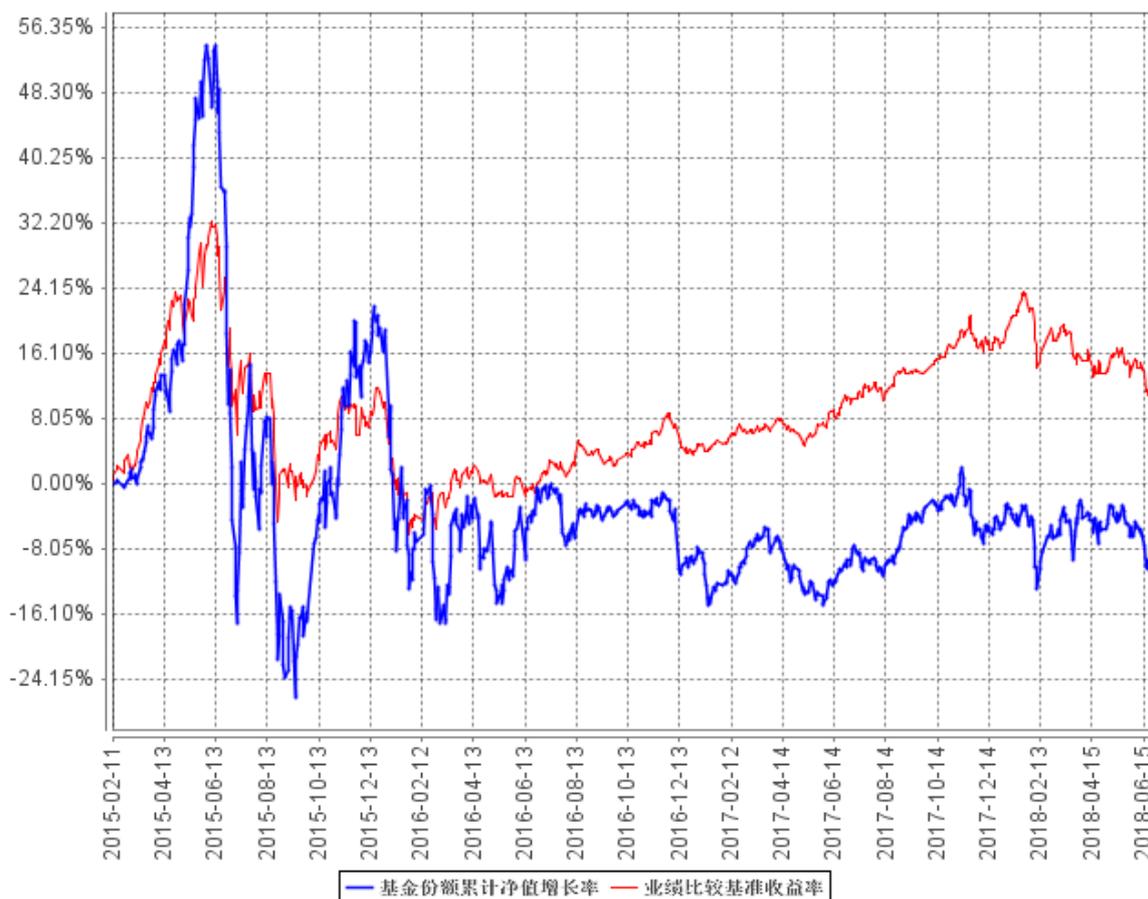
3.2 基金净值表现

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	-3.70%	1.14%	-4.46%	0.77%	0.76%	0.37%
过去三个月	-6.37%	1.03%	-5.43%	0.68%	-0.94%	0.35%
过去六个月	-4.10%	1.21%	-6.72%	0.69%	2.62%	0.52%
过去一年	0.77%	1.02%	-1.09%	0.57%	1.86%	0.45%
过去三年	-20.07%	1.99%	-8.16%	0.89%	-11.91%	1.10%
自基金合同生效起至今	-8.80%	2.00%	9.51%	0.96%	-18.31%	1.04%

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：按基金合同和招募说明书的约定，本基金合同生效日起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规定。

§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		
曹思	基金经理	2015 年 2 月 11 日	-	9 年	经济学硕士，曾任中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理，现任

					中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心科技创新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

在报告期内，受到国内整体大的去杠杆和中美贸易战的影响，市场各主要指数均出现不同程度的调整。从各指数行业上半年的市场表现来看，餐饮旅游、食品饮料、医药、计算机等消费和科技领域板块涨幅较高。同时和中美贸易战相关性较高的通信板块、受到事件性影响的传媒板块

以及和宏观经济周期波动相关性较高的电力设备、机械等调整幅度居前。

在市场震荡的过程中对基金产品仓位和持仓结构进行了一定程度调整，首先是对整体仓位进行了下降，其次增加了部分行业龙头个股以及低估值滞涨品种的持仓。在投资策略方面，2018 年上半年度依然坚持自下而上精选个股和自上而下精选行业结合的投资思路，重点配置了业绩增长确定性相对较高，估值安全边际相对较高的个股。

在行业配置方面，我们认为能够穿越周期的更多是代表未来经济发展方向的具备科技创新属性的行业和个股，因此重点配置方向为高端制造、民参军、医药、电子以及新能源汽车产业链。

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 0.912 元；本报告期基金份额净值增长率为-4.10%，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

首先从宏观经济基本面看，经济大幅超市场预期和低于市场预期的空间和概率都相对较小，市场的关注重点也逐渐从经济增长的增速转为经济增长的结构和质量，经济具备较强的韧性。进入 2018 年下半年预计整体经济增速将会有所回落。流动性将成为主导市场波动的核心变量，市场流动性的角度主要受到货币层面和信用层面的影响。首先货币层面，美国持续加息将会导致国内货币政策调节的空间相对较小，利率维持相对高位，向下的概率和空间都相对较小。信用层面，随着金融去杠杆的推进并取得阶段性成果，预计信用层面将会逐步从之前的紧信用向稳定信用转变，边际出现改善。因此进入三下半年市场将会出现分子分母同时向下的情况，在这种背景下我们看好分子端相对下降较慢或者不下降的行业和个股。将主要依据上市公司中报业绩以及三季报业绩指引业绩情况选择估值和业绩增速匹配度和确定性较高的方向和个股进行适当布局。最后，中美贸易战的不断摩擦升级也使得大国角力成为常态，因此将重点关注相关受益产业链，择机进行布局。

在行业配置方面，主要还是看好具备核心竞争力的代表中国未来科技发展方向的产业，目前重点看好两条投资逻辑，第一，科技方向，重点配置高端制造产业、新能源汽车产业、以及半导体相关产业链。第二，消费方向，重点配置医药产业、传媒行业以及新零售板块。同时会根据市场的走势对各细分行业龙头公司进行一定比例的配置。

另外我们将根据整体宏观经济的运行以及市场走势的变化，及时对仓位进行调整，力争为投资者带来良好的投资回报。

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，故未进行利润分配。

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

基金托管人依据本基金合同和托管协议，自 2015 年 2 月 11 日起托管本基金的全部资产。

本报告期内，本托管人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人依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。

二〇一八年八月二十七日

§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：中邮核心科技创新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	6.4.7.1	64,624,903.13	80,013,718.35
结算备付金		656,119.60	338,127.89
存出保证金		269,052.65	141,811.99
交易性金融资产	6.4.7.2	98,189,104.12	153,995,767.62
其中：股票投资		98,189,104.12	153,995,767.62
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		40,038,169.88	32,323.20
应收利息	6.4.7.5	3,551.40	14,785.42
应收股利		-	-
应收申购款		8,034.45	16,763.64
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		203,788,935.23	234,553,298.11
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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		1,282,944.78	3,492,914.87
应付赎回款		12,293.11	110,872.10
应付管理人报酬		250,511.78	293,165.13
应付托管费		41,751.98	48,860.85
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	435,442.66	233,595.99

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	777,997.24	725,045.94
负债合计		2,800,941.55	4,904,454.88
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	220,322,214.99	241,589,487.89
未分配利润	6.4.7.10	-19,334,221.31	-11,940,644.66
所有者权益合计		200,987,993.68	229,648,843.23
负债和所有者权益总计		203,788,935.23	234,553,298.11

注：报告截止日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.912 元，基金份额总额 220,322,214.99 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮核心科技创新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		-4,468,204.11	3,323,398.27
1.利息收入		279,945.33	263,555.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	250,915.19	257,588.23
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		29,030.14	5,967.12
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,153,594.27	-3,566,032.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	10,521,226.59	-4,578,051.49
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	6.4.7.13.5	-	-
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	632,367.68	1,012,019.28
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-15,912,925.61	6,600,894.94
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	11,181.90	24,980.19
减：二、费用		3,665,291.00	3,318,884.97
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,591,817.05	1,981,566.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	265,302.83	330,261.05
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,565,185.86	764,072.19
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	6.4.7.20	242,985.26	242,985.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,133,495.11	4,513.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,133,495.11	4,513.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮核心科技创新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）	241,589,487.89	-11,940,644.66	229,648,843.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-8,133,495.11	-8,133,495.11
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）	-21,267,272.90	739,918.46	-20,527,354.44
其中：1.基金申购款	6,597,272.76	-440,444.91	6,156,827.85
2.基金赎回款	-27,864,545.66	1,180,363.37	-26,684,182.29
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)	220,322,214.99	-19,334,221.31	200,987,993.68
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)	308,199,964.90	-29,107,772.21	279,092,192.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	4,513.30	4,513.30
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)	-21,021,338.72	1,903,750.90	-19,117,587.82
其中: 1.基金申购款	9,101,129.37	-979,937.37	8,121,192.00
2.基金赎回款	-30,122,468.09	2,883,688.27	-27,238,779.82
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)	287,178,626.18	-27,199,508.01	259,979,118.17

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

中邮核心科技创新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”)证监许可[2014]1363号《关于准予中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准募集,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《中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起,并于

2015年2月11日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集941,247,382.79元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字（2015）第110ZC0072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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮核心科技创新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%。本基金投资于科技创新主题的证券不低于非现金基金资产的80%。

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模板第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

本报告期本基金所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期本基金无差错更正。

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 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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	64,624,903.13
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	64,624,903.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,494,098.15	98,189,104.12	5,695,005.97
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	92,494,098.15	98,189,104.12	5,695,005.97

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2018年6月30日
应收活期存款利息	15,899.94
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	265.77
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-12,723.30
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	108.99
合计	3,551.40

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告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 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	435,442.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	435,442.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11.98
预提费用	777,985.26
合计	777,997.24

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	241,589,487.89	241,589,487.89
本期申购	6,597,272.76	6,597,272.76
本期赎回(以“-”号填列)	-27,864,545.66	-27,864,545.66
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	220,322,214.99	220,322,214.99

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	-3,996,900.35	-7,943,744.31	-11,940,644.66
本期利润	7,779,430.50	-15,912,925.61	-8,133,495.11
本期基金份额交易产生的变动数	-113,572.45	853,490.91	739,918.46
其中：基金申购款	119,491.91	-559,936.82	-440,444.91
基金赎回款	-233,064.36	1,413,427.73	1,180,363.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,668,957.70	-23,003,179.01	-19,334,221.31

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	242,670.97
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	6,485.90
其他	1,758.32
合计	250,915.19

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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	531,843,259.17
减：卖出股票成本总额	521,322,032.58
买卖股票差价收入	10,521,226.59

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**

本基金本报告期末未持有债券投资。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
股票投资产生的股利收益	632,367.68
基金投资产生的股利收益	-
合计	632,367.68

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
1. 交易性金融资产	-15,912,925.61
——股票投资	-15,912,925.61
——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	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-15,912,925.61

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
基金赎回费收入	11,181.90
合计	11,181.90

注：对持续持有期少于7日（不含7日）的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期长于7日（含7日）少于30日（不含30日）的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金资产；对持续持有期长于30日（含30日）少于93日（不含93日）的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金资产；对持续持有期长于93日（含93日）少于186日的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金资产；对持续持有期长于186日（含186日）的投资人，应当将不低于赎回费总额的

25%计入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
交易所市场交易费用	1,565,185.86
银行间市场交易费用	-
合计	1,565,185.86

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	198,354.28
合计	242,985.26

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2018年8月22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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金管理人股东控股的公司、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

6.4.10 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，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

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 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	1,591,817.05	1,981,566.47
其中：支付销售机构的客户维护费	651,303.51	802,878.32

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

1.5%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×1.5% / 当年天数

6.4.10.2.2 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	265,302.83	330,261.05

注：支付基金托管人中国邮政储蓄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：

日基金托管费=前一日基金资产净值×0.25% / 当年天数

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，本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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（2015年2月11日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	1,952,631.46	1,952,631.46
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	1,952,631.46	1,952,631.46
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.8900%	0.6800%

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

本报告期及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	64,624,903.13	242,670.97	55,192,223.16	252,413.55

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生在承销期内参与认购关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2018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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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
300740	御家汇	2018年6月19日	重大事项	29.91	-	-	30,000	918,511.00	897,300.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金在运作过程中未发生过流动性风险情况。公司建立了防范流动性风险的有效机制。公司每日跟踪监测本基金持有资产的交易量、持仓集中度、流通受限资产占比、可流通资产变现天数、7 日可变现资产比例、信用债券和逆回购质押券最新主体及债项评级、利率债券组合久期、基金杠杆率等涉及资产流动性风险的指标，并设置合理有效的风控阈值；详细分析本基金投资者类型、投资者结构、投资者风险偏好和历史申购与赎回数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者赎回需求，制定了健全有效的流动性风险压力测试方法。当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整基金投资策略，预留充足现金头寸、确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。如果遇到极端市场情形或发生巨额赎回情形，公司将采取本基金合同约定的巨额赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下潜在流动性风险。

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，并按照合约规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 2018年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	64,624,903.13	-	-	-	64,624,903.13
结算备付金	656,119.60	-	-	-	656,119.60
存出保证金	269,052.65	-	-	-	269,052.65
交易性金融资产	-	-	-	98,189,104.12	98,189,104.12
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	0.00
应收证券清算款	-	-	-	40,038,169.88	40,038,169.88
应收利息	-	-	-	3,551.40	3,551.40
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	8,034.45	8,034.45
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	65,550,075.38	0.00	0.00	138,238,859.85	203,788,935.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,282,944.78	1,282,944.78
应付赎回款	-	-	-	12,293.11	12,293.11
应付管理人报酬	-	-	-	250,511.78	250,511.78
应付托管费	-	-	-	41,751.98	41,751.98
应付交易费用	-	-	-	435,442.66	435,442.66
应交税费	-	-	-	-	0.00
应付利息	-	-	-	-	0.00
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	777,997.24	777,997.24
负债总计	-	-	-	2,800,941.55	2,800,941.55
利率敏感度缺口	65,550,075.38	0.00	0.00	135,437,918.30	200,987,993.68
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	80,013,718.35	-	-	-	80,013,718.35
结算备付金	338,127.89	-	-	-	338,127.89

存出保证金	141,811.99	-	-	-	141,811.99
交易性金融资产	-	-	-	-153,995,767.62	153,995,767.62
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	32,323.20	32,323.20
应收利息	-	-	-	14,785.42	14,785.42
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	16,763.64	16,763.64
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	80,493,658.23	-	-	-154,059,639.88	234,553,298.11
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,492,914.87	3,492,914.87
应付赎回款	-	-	-	110,872.10	110,872.10
应付管理人报酬	-	-	-	293,165.13	293,165.13
应付托管费	-	-	-	48,860.85	48,860.85
应付交易费用	-	-	-	233,595.99	233,595.99
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	725,045.94	725,045.94
负债总计	-	-	-	4,904,454.88	4,904,454.88
利率敏感度缺口	80,493,658.23	-	-	-149,155,185.00	229,648,843.23

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%。本基金投资于科技创新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 2018 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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	98,189,104.12	48.85	153,995,767.62	67.06
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	98,189,104.12	48.85	153,995,767.62	67.06

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	基金净资产变动	1,275,856.65	1,973,510.07
	基金净资产变动	-1,275,856.65	-1,973,510.07

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 2018 年 6 月 29 日十年期国

债收益率 3.51%，利用 2018 年 1 月 1 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 1.30。

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	98,189,104.12	48.18
	其中：股票	98,189,104.12	48.18
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	65,281,022.73	32.03
8	其他各项资产	40,318,808.38	19.78
9	合计	203,788,935.23	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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	71,663,554.12	35.66
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	5,374,000.00	2.67
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,446,290.00	5.20
J	金融业	1,325,600.00	0.66
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,518,000.00	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	6,861,660.00	3.41
S	综合	-	-
	合计	98,189,104.12	48.85

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

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	300450	先导智能	235,000	7,106,400.00	3.54
2	002327	富安娜	615,000	6,666,600.00	3.32
3	300567	精测电子	55,000	4,378,000.00	2.18
4	300073	当升科技	120,000	4,087,200.00	2.03
5	603096	新经典	48,000	4,021,440.00	2.00
6	300373	扬杰科技	140,000	4,004,000.00	1.99
7	300559	佳发安泰	133,000	3,954,090.00	1.97
8	002410	广联达	140,000	3,882,200.00	1.93
9	600104	上汽集团	100,000	3,499,000.00	1.74
10	603228	景旺电子	70,000	3,460,800.00	1.72
11	002563	森马服饰	240,000	3,432,000.00	1.71
12	603877	太平鸟	99,985	3,332,500.05	1.66
13	600038	中直股份	82,000	3,279,180.00	1.63
14	002008	大族激光	60,000	3,191,400.00	1.59
15	603156	养元饮品	50,000	3,103,000.00	1.54

16	002024	苏宁易购	220,000	3,097,600.00	1.54
17	600426	华鲁恒升	170,000	2,990,300.00	1.49
18	002572	索菲亚	90,000	2,896,200.00	1.44
19	300251	光线传媒	279,000	2,840,220.00	1.41
20	300545	联得装备	120,000	2,780,400.00	1.38
21	600315	上海家化	70,000	2,774,100.00	1.38
22	002373	千方科技	200,000	2,610,000.00	1.30
23	600884	杉杉股份	115,000	2,541,500.00	1.26
24	000710	贝瑞基因	50,000	2,518,000.00	1.25
25	300413	快乐购	60,000	2,276,400.00	1.13
26	300316	晶盛机电	169,983	2,259,074.07	1.12
27	002236	大华股份	100,000	2,255,000.00	1.12
28	600760	中航沈飞	40,000	1,441,600.00	0.72
29	600030	中信证券	80,000	1,325,600.00	0.66
30	300296	利亚德	100,000	1,288,000.00	0.64
31	300740	御家汇	30,000	897,300.00	0.45

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	600048	保利地产	10,423,092.00	4.54
2	601233	桐昆股份	10,109,445.00	4.40
3	600019	宝钢股份	9,775,178.00	4.26
4	300545	联得装备	9,355,485.00	4.07
5	300142	沃森生物	8,917,427.00	3.88
6	002327	富安娜	7,632,741.32	3.32
7	300567	精测电子	7,162,107.00	3.12
8	600884	杉杉股份	7,031,596.42	3.06
9	000002	万科A	6,961,970.32	3.03
10	600801	华新水泥	6,886,857.94	3.00
11	600030	中信证券	6,202,405.00	2.70
12	600340	华夏幸福	6,156,076.76	2.68
13	600346	恒力股份	5,941,743.00	2.59
14	002142	宁波银行	5,767,429.20	2.51

15	300251	光线传媒	5,568,481.00	2.42
16	600258	首旅酒店	5,551,636.57	2.42
17	601998	中信银行	5,487,951.00	2.39
18	000821	京山轻机	5,481,386.00	2.39
19	002925	盈趣科技	5,427,277.90	2.36
20	300558	贝达药业	5,415,370.00	2.36
21	300308	中际装备	5,378,517.72	2.34
22	000651	格力电器	5,369,044.00	2.34
23	600115	东方航空	5,353,950.00	2.33
24	600315	上海家化	5,282,145.32	2.30
25	600104	上汽集团	5,185,931.00	2.26
26	300316	晶盛机电	5,078,622.72	2.21
27	603096	新经典	4,950,057.00	2.16
28	300523	辰安科技	4,881,344.39	2.13
29	002390	信邦制药	4,830,337.23	2.10
30	000710	贝瑞基因	4,778,452.00	2.08
31	002751	易尚展示	4,630,172.00	2.02
32	600383	金地集团	4,629,914.64	2.02
33	002024	苏宁易购	4,629,428.75	2.02
34	300559	佳发安泰	4,622,609.20	2.01
35	002812	创新股份	4,622,363.00	2.01
36	300073	当升科技	4,622,159.00	2.01
37	603367	辰欣药业	4,615,246.80	2.01
38	002343	慈文传媒	4,606,233.00	2.01

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填写，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	600048	保利地产	11,651,826.00	5.07
2	600030	中信证券	11,399,644.17	4.96
3	002812	创新股份	10,521,100.38	4.58
4	300450	先导智能	10,405,295.56	4.53
5	300142	沃森生物	9,949,930.95	4.33
6	300456	耐威科技	9,621,424.00	4.19
7	601233	桐昆股份	9,343,964.95	4.07

8	600176	中国巨石	9,263,115.84	4.03
9	300558	贝达药业	9,137,321.13	3.98
10	600019	宝钢股份	9,120,498.27	3.97
11	603806	福斯特	8,718,881.00	3.80
12	601398	工商银行	8,665,763.00	3.77
13	600104	上汽集团	8,607,389.08	3.75
14	600887	伊利股份	7,730,906.96	3.37
15	300373	扬杰科技	7,508,226.31	3.27
16	600115	东方航空	7,331,224.47	3.19
17	000858	五粮液	7,315,042.00	3.19
18	002925	盈趣科技	7,215,375.46	3.14
19	603799	华友钴业	6,892,867.00	3.00
20	300316	晶盛机电	6,710,366.50	2.92
21	300523	辰安科技	6,617,025.68	2.88
22	000002	万科A	6,511,680.00	2.84
23	300545	联得装备	6,459,064.00	2.81
24	600346	恒力股份	6,269,455.75	2.73
25	600801	华新水泥	6,209,939.80	2.70
26	600066	宇通客车	5,861,787.00	2.55
27	600340	华夏幸福	5,830,485.01	2.54
28	300203	聚光科技	5,753,362.00	2.51
29	600258	首旅酒店	5,693,950.42	2.48
30	002142	宁波银行	5,606,027.00	2.44
31	603367	辰欣药业	5,495,061.00	2.39
32	601998	中信银行	5,309,045.70	2.31
33	601636	旗滨集团	5,260,222.61	2.29
34	000651	格力电器	5,255,966.42	2.29
35	300604	长川科技	5,158,696.80	2.25
36	002833	弘亚数控	5,075,913.00	2.21
37	000821	京山轻机	5,065,820.00	2.21
38	600487	亨通光电	5,016,493.00	2.18
39	300308	中际装备	4,996,084.44	2.18
40	603899	晨光文具	4,925,649.77	2.14
41	002343	慈文传媒	4,762,278.00	2.07
42	600383	金地集团	4,696,812.70	2.05
43	000977	浪潮信息	4,683,803.54	2.04

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	481,428,294.69
卖出股票收入（成交）总额	531,843,259.17

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

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

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，特别是在科技创新受经济环境、政策监管等外部重要因素影响时相应行业的上市公司股价变化可能出现一定程度的波动，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	269,052.65
2	应收证券清算款	40,038,169.88
3	应收股利	-
4	应收利息	3,551.40
5	应收申购款	8,034.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,318,808.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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
8,162	26,993.66	1,952,631.46	0.89%	218,369,583.53	99.11%

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	541,946.86	0.2460%

注：本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 50~100 万份。

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	10~50

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人、基金经理持有本基金份额总量的数
量区间为 10-50 万份。

2、本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 10-50 万份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年2月11日）基金份额总额	941,247,382.79
本报告期期初基金份额总额	241,589,487.89
本报告期基金总申购份额	6,597,272.76
减：本报告期基金总赎回份额	27,864,545.66
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	220,322,214.99

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有召开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

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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

本报告期内本基金管理人和托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
国信证券	1	580,367,414.57	57.29%	540,497.36	57.29%	-
兴业证券	1	432,699,345.03	42.71%	402,972.63	42.71%	-
华福证券	1	-	-	-	-	-

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
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	80,000,000.00	100.00%	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 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调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年1月16日
2	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司、华瑞保险销售有限公司、北京植信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	2018年1月16日
3	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金 2017 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	2018年1月20日
4	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年1月31日
5	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整北京展恒基金销售股份有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基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	2018年2月1日
6	中邮创业基金管理股份有限公司关于开通上海利得基金销售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	2018年2月6日
7	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年2月6日
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳市前海排排网基金销售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	2018年2月6日
9	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整一路财富（北京）信息科技股份有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月13日

10	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月23日
11	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限公司、北京坤元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	2018年3月23日
12	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书(2018年第1号)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月26日
13	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月28日
14	关于修改中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同等法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月29日
15	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月29日
16	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月29日
17	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同内容摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月29日
18	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金招募说明书(更新)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月29日
19	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加东海证券股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月30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中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018年3月30日
21	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加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	2018年3月30日

22	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金 2017 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 30 日
23	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金所持中兴通讯股票（000063）估值调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 4 月 19 日
24	中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金 2018 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	2018 年 4 月 23 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银河证券基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 5 月 18 日
26	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加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	2018 年 6 月 29 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交通银行股份有限公司基金网上银行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	2018 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核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮核心科技创新灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮核心科技创新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住所。

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

中邮创业基金管理股份有限公司

2018年8月28日