

中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 26 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 2019 年 08 月 23 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 2019 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.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
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.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	35
7.1 期末基金资产组合情况.....	35
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	35
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.....	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	37
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	40
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.....	40
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.....	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	40
7.12 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	42
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.....	42
§9 开放式基金份额变动.....	43
§10 重大事件揭示.....	44
10.1 基金份额持有人大会决议.....	44
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.....	44
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	44
10.4 基金投资策略的改变.....	44
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	44
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.....	44
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	44
10.8 其他重大事件.....	45
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	48

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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录.....	49
12.1 备查文件目录.....	49
12.2 存放地点.....	49
12.3 查阅方式.....	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮中小盘灵活配置混合
基金主代码	590006
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 5 月 10 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	442,489,543.51 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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，重点挖掘中小盘股票中的投资机会，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>1、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，结合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灵活的大类资产配置。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。本基金采用全球视野，将全球经济作为一个整体进行分析，从整体上把握全球一体化形势下的中国经济走势，从而做出投资在股票、债券、现金三大类资产之间的资产配置决策</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金针对中小盘股票及中小市值上市公司的特殊性，采用自下而上的股票投资策略，通过流动性筛选、定量筛选和定性分析相结合的方法寻找具有投资价值的个股，分享这类企业带来的较高回报。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>1) 平均久期配置</p> <p>本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。当预期市场利率上升时，本基金将缩短债券投资组合久期，以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时，本基金将拉长债券投资组合久期，以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。</p>

	<p>2) 期限结构配置</p> <p>结合对宏观经济形势和政策的判断, 运用统计和数量分析技术, 本基金对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析, 预测收益率曲线的变化趋势, 制定组合的期限结构配置策略。在预期收益率曲线趋向平坦化时, 本基金将采取哑铃型策略, 重点配置收益率曲线的两端。当预期收益率曲线趋向陡峭化时, 采取子弹型策略, 重点配置收益率曲线的中部。当预期收益率曲线不变或平行移动时, 则采取梯形策略, 债券投资资产在各期限间平均配置。</p> <p>3) 类属配置</p> <p>本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析, 研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势, 制定债券类属配置策略, 确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。</p> <p>4) 回购套利</p> <p>本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内, 适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率。</p> <p>4、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。</p>
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准构成为: 中证 700 指数×60%+中国债券总指数×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
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100013	100031
法定代表人	曹均	周慕冰

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
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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	75,422,457.71
本期利润	98,044,221.85
加权平均基金份额本期利润	0.2455
本期加权平均净值利润率	16.66%
本期基金份额净值增长率	17.68%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	95,508,577.83
期末可供分配基金份额利润	0.2158
期末基金资产净值	668,448,162.06
期末基金份额净值	1.511
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	81.25%

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	4.42%	1.04%	1.34%	0.76%	3.08%	0.28%
过去三个月	-6.27%	1.37%	-5.30%	1.02%	-0.97%	0.35%
过去六个月	17.68%	1.37%	13.26%	1.03%	4.42%	0.34%
过去一年	2.72%	1.23%	1.28%	0.99%	1.44%	0.24%
过去三年	-7.15%	1.12%	-3.49%	0.75%	-3.66%	0.37%
自基金合同生效起至今	81.25%	1.50%	23.13%	0.98%	58.12%	0.52%

注：1. 本基金基金合同生效日为 2011 年 5 月 10 日。

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

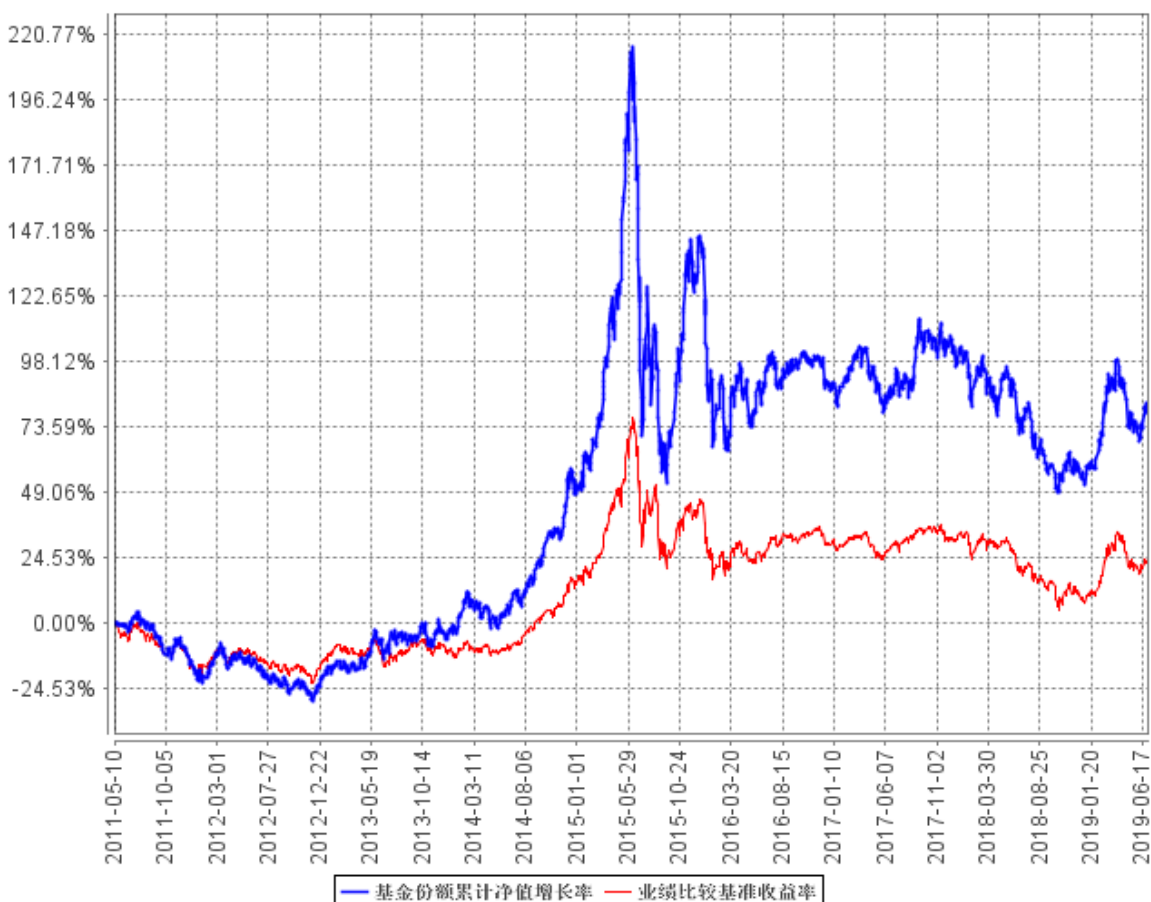
所列数字。

3. 关于业绩基准的说明

本基金业绩衡量基准=中证 700 指数×60%+中国债券总指数×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 2019 年 6 月 30 日，本公司共管理 43 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、中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放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		
杨欢	基金经理	2018 年 10 月 12 日	-	10 年	曾担任中国银河证券股份有限公司投资研究部分析师、中邮创业基金管理股份有限公司投资研究部行

					业研究员、基金经理助理、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮趋势精选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基金经理，现担任中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮中小盘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、中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
尚杰	基金经理	2019年1月9日	-	7年	曾任派特博恩生物技术有限公司市场部安徽地区大区经理、中邮创业基金管理股份有限公司投资研究部研究员、基金经理助理、皓玥资本管理有限公司权益投资部投资经理、鹏华基金管理有限公司权益投资二部投资经理、中邮双动力混合型证券投资基金、中邮增力债券型证券投资基金基金经理助理。现担任中邮增力债券型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮风格轮动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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规及本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

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有关法律法规和基金合同的规定和约定；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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过制度流程和信息技术手段以保证实现公平交易原则。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（1日内、3日、5日）同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度进行分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人所管理的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%。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

2019 年上年度市场呈现回调的态势。整体来看，上证指数上涨 19.45%，创业板指数上涨 20.87%。

从板块来看，表现居前的五个板块：食品饮料（中信）上涨 60.90%，非银行金融（中信）上涨 44.69%，农林牧渔（中信）上涨 43.28%，家电（中信）上涨 39.80%，计算机（中信）33.01%。表现倒数五名的板块：建筑（中信）上涨 6.59%，传媒（中信）上涨 7.97%，汽车（中信）上涨 9.85%，钢铁（中信）上涨 10.24%，纺织服装（中信）上涨 11.49%。

当前主要配置集中在由核心竞争力的科技股，以计算机、高端制造、军工、大金融为主，同

时伴随 5 月份市场开始调整，基金也随之调整了仓位，同时减少了部分化工持仓。

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 1.511 元，累计净值为 1.843 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.68%，业绩比较基准收益率为 13.26%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019 年中国经济环境的特点是经济有下行压力，但在政策稳增长的支撑下有望逐渐触底，目前仍在下行寻底过程中。

在该背景下，我们认为未来流动性环境会保持相对宽松，有利于 A 股市场的估值修复。此外政策底已经出现，业绩底仍需等待，因此认为未来行业仅存在结构性机会。同时认为本轮刺激不再走投资驱动老路，新的增长动能来自于科技创新、高端制造和消费升级。

结合全球需求较弱的背景下，外部贸易摩擦以及内部金融去杠杆对风险偏好的扰动会持续出。

配置方向主要沿以下两个方向进行：

(1) 自下而上精选个股：主要选择产品市场空间大，具备核心技术，依靠研发+渠道做大的企业。

(2) 受益于逆周期政策宽松以及行业自身景气度向上的行业：主要是高端制造，医疗 it，信息安全，券商等领域。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理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、专业胜任能力和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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、托管协议的约定，对本基金基金管理人——中邮创业基金管理有限公司 2019 年 1 月 1 日至 2019 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、基金费用开支及利润分配等问题上，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：中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	129,046,833.20	112,657,159.24
结算备付金		715,596.27	2,664,071.82
存出保证金		401,372.62	498,902.33
交易性金融资产	6.4.7.2	545,791,853.51	413,593,537.42
其中：股票投资		535,112,853.51	402,884,537.42
基金投资		-	-
债券投资		10,679,000.00	10,709,000.00
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	489,424.56	254,025.50
应收股利		-	-
应收申购款		43,546.67	50,622.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		676,488,626.83	529,718,318.81
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		5,480,533.29	-
应付赎回款		237,397.99	65,061.71
应付管理人报酬		739,516.88	773,739.02
应付托管费		123,252.81	128,956.49
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	587,927.04	1,433,058.90
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	871,836.76	848,423.55
负债合计		8,040,464.77	3,249,239.67
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	442,489,543.51	410,096,995.51
未分配利润	6.4.7.10	225,958,618.55	116,372,083.63
所有者权益合计		668,448,162.06	526,469,079.14
负债和所有者权益总计		676,488,626.83	529,718,318.81

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.511 元，基金份额总额 442,489,543.51 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		105,860,495.12	-74,748,148.95
1.利息收入		1,374,804.03	1,945,598.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,125,867.05	1,695,414.25
债券利息收入		248,936.98	250,184.62
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		81,784,236.15	-29,706,275.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	80,501,847.98	-32,400,288.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	490,252.08
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	1,282,388.17	2,203,761.30
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	22,621,764.14	-47,135,894.50
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	79,690.80	148,422.01
减：二、费用		7,816,273.27	9,711,266.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,363,525.90	6,447,249.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	727,254.27	1,074,541.57
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-

4. 交易费用	6.4.7.19	2,461,158.03	1,908,790.33
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	264,335.07	280,685.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		98,044,221.85	-84,459,415.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		98,044,221.85	-84,459,415.90

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	410,096,995.51	116,372,083.63	526,469,079.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	98,044,221.85	98,044,221.85
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）	32,392,548.00	11,542,313.07	43,934,861.07
其中：1.基金申购款	95,444,987.42	45,520,514.26	140,965,501.68
2.基金赎回款	-63,052,439.42	-33,978,201.19	-97,030,640.61
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）	442,489,543.51	225,958,618.55	668,448,162.06
项目	上年度可比期间 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)	558,772,447.83	544,561,906.45	1,103,334,354.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-84,459,415.90	-84,459,415.90
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)	-47,667,430.83	-53,960,364.46	-101,627,795.29
其中：1.基金申购款	60,040,847.02	38,341,543.76	98,382,390.78
2.基金赎回款	-107,708,277.85	-92,301,908.22	-200,010,186.07
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)	-	-165,388,579.94	-165,388,579.94
五、期末所有者权益(基金净值)	511,105,017.00	240,753,546.15	751,858,563.15

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：

 孔军 孔军 佟姍
 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

中邮中小盘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[2011]40号《关于核准中邮中小盘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《中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于2011年5月10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1,707,836,788.97元，业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字(2011)第0063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《中邮中小盘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、权证、资产支持证券、以及法律法规和证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 0%-65%，权证占基金资产净值的 0%-3%，并保持现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值 5%。

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)变动表等有关信息。

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、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 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

本报告期内本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

6.4.6 税项

1.1.1 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. 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。

5. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019年6月30日
活期存款	129,046,833.20
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：	129,046,833.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	523,043,709.88	535,112,853.51	12,069,143.63	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	-	-	
	银行间市场	10,399,100.00	10,679,000.00	279,900.00
	合计	10,399,100.00	10,679,000.00	279,900.00
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	533,442,809.88	545,791,853.51	12,349,043.63	

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 2019年6月30日
应收活期存款利息	57,114.69
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	289.80
应收债券利息	431,857.53
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	162.54
合计	489,424.56

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	587,927.04
银行间市场应付交易费用	-
合计	587,927.04

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	523.66
预提费用	842,985.26
其他	28,327.84

合计	871,836.76
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	410,096,995.51	410,096,995.51
本期申购	95,444,987.42	95,444,987.42
本期赎回(以“-”号填列)	-63,052,439.42	-63,052,439.42
- 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	442,489,543.51	442,489,543.51

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	11,470,402.83	104,901,680.80	116,372,083.63
本期利润	75,422,457.71	22,621,764.14	98,044,221.85
本期基金份额交易产生的变动数	8,615,717.29	2,926,595.78	11,542,313.07
其中：基金申购款	19,580,319.11	25,940,195.15	45,520,514.26
基金赎回款	-10,964,601.82	-23,013,599.37	-33,978,201.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	95,508,577.83	130,450,040.72	225,958,618.55

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	1,107,471.79
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	11,636.41
其他	6,758.85

合计	1,125,867.05
----	--------------

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
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	800,360,780.76
减：卖出股票成本总额	719,858,932.78
买卖股票差价收入	80,501,847.98

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期无贵金属投资。

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
	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,282,388.17
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,282,388.17

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	22,621,764.14
——股票投资	22,651,764.14
——债券投资	-30,000.00
——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	22,621,764.14

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	79,690.80
合计	79,690.80

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,461,158.03
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,461,158.03

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	198,354.28
债券帐户维护费	9,000.00
银行费用	2,749.81
上清所债券账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	264,335.07

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 2019 年 8 月 20 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
中国邮政集团公司	基金管理人的股东
三井住友银行股份有限公司	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易的情况。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,363,525.90	6,447,249.62
其中：支付销售机构的客户维护费	2,095,723.78	3,193,031.03

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 1.50% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	727,254.27	1,074,541.57

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的 0.25% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，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。

6.4.10.3 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.3.1 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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
基金合同生效日（2011年5月10日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	955,541.47	955,541.47
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份	-	-

额		
报告期末持有的基金份额	955,541.47	955,541.47
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2200%	0.1900%

6.4.10.3.2 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。

6.4.10.4 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	
	2019年1月1日至2019年6月30日		2018年1月1日至2018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	129,046,833.20	1,107,471.79	250,852,592.02	1,664,015.71

6.4.10.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.6 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

本报告期内本基金为发生利润分配。

6.4.12 期末（2019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

本期末本基金未持有因认购新发/增发证券流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

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

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控和可承受。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理组织架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助进行风险管理决策，以实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险限度，及时对各种风险进行监督、分析和评估，并制定应对措施，将风险控制在预期可承受的范围

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的信用风险状况进行评级，并对交易对手设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	10,679,000.00	10,709,000.00
合计	10,679,000.00	10,709,000.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

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。在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。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进行持续监测。

在负债端，基金管理人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

市场风险指因受各种因素影响而引起的证券及其衍生品市场价格不利波动，使投资组合资产、公司资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控分析，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	129,046,833.20	-	-	-	129,046,833.20
结算备付金	715,596.27	-	-	-	715,596.27
存出保证金	401,372.62	-	-	-	401,372.62
交易性金融资产	-	-	10,679,000.00	535,112,853.51	545,791,853.51

应收利息	-	-	-	489,424.56	489,424.56
应收申购款	-	-	-	43,546.67	43,546.67
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	130,163,802.09	-	10,679,000.00	535,645,824.74	676,488,626.83
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	5,480,533.29	5,480,533.29
应付赎回款	-	-	-	237,397.99	237,397.99
应付管理人报酬	-	-	-	739,516.88	739,516.88
应付托管费	-	-	-	123,252.81	123,252.81
应付交易费用	-	-	-	587,927.04	587,927.04
其他负债	-	-	-	871,836.76	871,836.76
负债总计	-	-	-	8,040,464.77	8,040,464.77
利率敏感度缺口	130,163,802.09	-	10,679,000.00	527,605,359.97	668,448,162.06
上年度末 2018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	112,657,159.24	-	-	-	112,657,159.24
结算备付金	2,664,071.82	-	-	-	2,664,071.82
存出保证金	498,902.33	-	-	-	498,902.33
交易性金融资产	-	-	10,709,000.00	402,884,537.42	413,593,537.42
应收利息	-	-	-	254,025.50	254,025.50
应收申购款	-	-	-	50,622.50	50,622.50
资产总计	115,820,133.39	-	10,709,000.00	403,189,185.42	529,718,318.81
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	65,061.71	65,061.71
应付管理人报酬	-	-	-	773,739.02	773,739.02
应付托管费	-	-	-	128,956.49	128,956.49
应付交易费用	-	-	-	1,433,058.90	1,433,058.90
其他负债	-	-	-	848,423.55	848,423.55
负债总计	-	-	-	3,249,239.67	3,249,239.67
利率敏感度缺口	115,820,133.39	-	10,709,000.00	399,939,945.75	526,469,079.14

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变	
	市场利率下降 25 个基点且其他市场变量保持不变	
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（2019年6月30日）

	基金净资产变动	-114,443.99	-127,032.47
	基金净资产变动	117,776.21	131,011.59

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（包括中小板和创业板）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券、以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围；如法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制的，基金管理人可依据相关规定履行适当程序后调整本基金的投资比例规定。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%~80%，债券、权证、资产支持证券、以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 0%~65%，权证占基金资产净值的 0%~3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于中小盘股票比例不低于基金股票资产的 80%。

于 2019 年 6 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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	535,112,853.51	80.05	402,884,537.42	76.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	10,679,000.00	1.60	10,709,000.00	2.03
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	545,791,853.51	81.65	413,593,537.42	78.56

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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	基金净资产变动	6,769,412.90	4,956,492.17
	基金净资产变动	-6,769,412.90	-4,956,492.17

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 2019 年 6 月 28 日十年期国债收益率 3.2254%，利用 2019 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 1.24。

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	535,112,853.51	79.10
	其中：股票	535,112,853.51	79.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,679,000.00	1.58
	其中：债券	10,679,000.00	1.58
	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	129,762,429.47	19.18
8	其他各项资产	934,343.85	0.14
9	合计	676,488,626.83	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项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 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	324,151,455.27	48.49
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	13,682,400.00	2.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	149,114,295.75	22.31
J	金融业	35,405,289.45	5.30
K	房地产业	12,759,413.04	1.91
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	-	-

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	535,112,853.51	80.05

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	300747	锐科激光	365,875	51,226,158.75	7.66
2	300454	深信服	515,785	45,151,818.90	6.75
3	300451	创业慧康	2,202,893	32,933,250.35	4.93
4	300450	先导智能	869,961	29,230,689.60	4.37
5	300395	菲利华	1,599,913	28,302,460.97	4.23
6	300271	华宇软件	1,299,961	24,699,259.00	3.70
7	300188	美亚柏科	1,200,000	21,396,000.00	3.20
8	000547	航天发展	2,008,692	19,203,095.52	2.87
9	600486	扬农化工	339,937	18,594,553.90	2.78
10	600038	中直股份	449,946	18,456,784.92	2.76
11	002415	海康威视	599,910	16,545,517.80	2.48
12	000977	浪潮信息	650,000	15,509,000.00	2.32
13	300750	宁德时代	210,000	14,464,800.00	2.16
14	600030	中信证券	599,985	14,285,642.85	2.14
15	002912	中新赛克	150,000	14,080,500.00	2.11
16	000063	中兴通讯	399,960	13,010,698.80	1.95
17	600048	保利地产	999,954	12,759,413.04	1.91
18	600372	中航电子	800,000	11,872,000.00	1.78
19	601688	华泰证券	500,000	11,160,000.00	1.67
20	300595	欧普康视	304,272	10,832,083.20	1.62
21	600893	航发动力	449,907	10,217,387.97	1.53
22	600837	海通证券	700,000	9,933,000.00	1.49
23	002025	航天电器	400,000	9,752,000.00	1.46
24	300567	精测电子	154,691	8,124,371.32	1.22

25	601233	桐昆股份	514,840	7,985,168.40	1.19
26	601111	中国国航	720,000	6,890,400.00	1.03
27	600480	凌云股份	780,000	6,825,000.00	1.02
28	600570	恒生电子	99,960	6,812,274.00	1.02
29	002352	鼎泰新材	200,000	6,792,000.00	1.02
30	600201	生物股份	399,948	6,275,184.12	0.94
31	002236	大华股份	400,000	5,808,000.00	0.87
32	600760	中航沈飞	200,000	5,806,000.00	0.87
33	300628	亿联网络	50,000	5,353,500.00	0.80
34	300124	汇川技术	200,000	4,582,000.00	0.69
35	300046	台基股份	210,000	4,229,400.00	0.63
36	300770	新媒股份	46,719	4,041,193.50	0.60
37	600346	恒力石化	160,000	1,945,600.00	0.29
38	600958	东方证券	2,495	26,646.60	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	000977	浪潮信息	37,336,206.16	7.09
2	300750	宁德时代	32,790,477.14	6.23
3	300395	菲利华	32,551,714.43	6.18
4	300659	中孚信息	30,224,511.70	5.74
5	300450	先导智能	29,622,031.28	5.63
6	300188	美亚柏科	29,129,027.63	5.53
7	601688	华泰证券	28,892,055.34	5.49
8	300747	锐科激光	28,750,809.00	5.46
9	300454	深信服	23,547,001.00	4.47
10	600958	东方证券	22,068,055.95	4.19
11	600837	海通证券	21,249,087.00	4.04
12	600486	扬农化工	20,580,576.79	3.91
13	600048	保利地产	20,057,701.10	3.81
14	600030	中信证券	19,231,224.75	3.65
15	000063	中兴通讯	18,137,714.56	3.45
16	600201	生物股份	16,804,859.70	3.19

17	002415	海康威视	15,870,501.00	3.01
18	300451	创业慧康	15,506,088.00	2.95
19	603160	汇顶科技	14,914,090.00	2.83
20	002321	华英农业	14,122,612.83	2.68
21	601233	桐昆股份	14,019,129.23	2.66
22	002027	分众传媒	13,866,730.58	2.63
23	600760	中航沈飞	13,615,077.63	2.59
24	002912	中新赛克	13,526,308.20	2.57
25	300567	精测电子	13,183,077.44	2.50
26	002236	大华股份	12,423,457.25	2.36
27	601555	东吴证券	12,318,586.00	2.34
28	601009	南京银行	11,552,327.00	2.19
29	300369	绿盟科技	11,514,514.40	2.19

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	600271	航天信息	42,401,366.91	8.05
2	300659	中孚信息	33,728,784.40	6.41
3	600570	恒生电子	28,342,817.85	5.38
4	000977	浪潮信息	27,403,733.67	5.21
5	600958	东方证券	23,671,447.75	4.50
6	300567	精测电子	22,592,835.01	4.29
7	000063	中兴通讯	20,777,365.77	3.95
8	300699	光威复材	20,729,950.01	3.94
9	600048	保利地产	19,314,760.20	3.67
10	603160	汇顶科技	19,110,089.00	3.63
11	600837	海通证券	18,246,941.00	3.47
12	002281	光迅科技	17,867,393.51	3.39
13	603826	坤彩科技	17,391,259.30	3.30
14	600498	烽火通信	17,216,341.50	3.27
15	300750	宁德时代	16,054,851.20	3.05
16	601688	华泰证券	15,962,975.00	3.03
17	300284	苏交科	15,868,551.40	3.01
18	300059	东方财富	15,184,070.00	2.88

19	002321	华英农业	14,059,847.00	2.67
20	300498	温氏股份	13,249,381.31	2.52
21	600038	中直股份	13,207,780.00	2.51
22	300369	绿盟科技	12,900,152.00	2.45
23	601555	东吴证券	12,798,346.00	2.43
24	601009	南京银行	11,799,612.25	2.24
25	002027	分众传媒	11,204,161.06	2.13
26	000002	万科A	10,807,415.15	2.05
27	002368	太极股份	10,712,090.00	2.03

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	829,435,484.73
卖出股票收入（成交）总额	800,360,780.76

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	10,679,000.00	1.60
	其中：政策性金融债	10,679,000.00	1.60
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	10,679,000.00	1.60

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	140222	14 国开 22	100,000	10,679,000.00	1.60

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	401,372.62
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	489,424.56
5	应收申购款	43,546.67
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	934,343.85

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 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
28,051	15,774.47	194,067,348.65	43.86%	248,422,194.86	56.14%

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（2011年5月10日）基金份额总额	1,707,836,788.97
本报告期期初基金份额总额	410,096,995.51
本报告期基金总申购份额	95,444,987.42
减：本报告期基金总赎回份额	63,052,439.42
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	442,489,543.51

§ 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

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东吴证券	2	441,740,706.79	27.10%	411,393.91	27.13%	-
申万宏源	1	320,974,663.90	19.69%	298,924.27	19.71%	-
华安证券	1	287,690,794.69	17.65%	267,924.75	17.67%	-
长江证券	1	211,608,060.79	12.98%	197,071.44	13.00%	-
新时代证券	2	197,837,575.84	12.14%	184,246.10	12.15%	-
招商证券	1	157,209,236.96	9.65%	144,943.36	9.56%	-
银河证券	1	12,735,226.52	0.78%	11,860.24	0.78%	-
国海证券	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。

(4) 债券现货、债券回购、企业债券交易、权证和证券投资基金不收交易佣金。

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：本报告期内本基金新增东吴证券的交易单元，新增数量为 2；新增新时代证券的交易单元，新增数量为 2。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东吴证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-

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并参加基金申购费	中国证券报	2019 年 1 月 3 日

	率优惠活动的公告		
2	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳前海财厚基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报	2019 年 1 月 3 日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于网上直销平台、官方微信平台申购及定投费率优惠的公告	中国证券报	2019 年 1 月 4 日
4	中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	中国证券报	2019 年 1 月 10 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东海证券基金定投业务单笔最低限额的公告	中国证券报	2019 年 1 月 18 日
6	中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金 2018 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	2019 年 1 月 22 日
7	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报	2019 年 2 月 20 日
8	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通国信证券股份有限公司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	2019 年 3 月 4 日
9	中邮创业基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报	2019 年 3 月 5 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基金定投业务并参加基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2019 年 3 月 5 日
11	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2019 年 3 月 7 日
12	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为代销机构的公告	中国证券报	2019 年 3 月 7 日
13	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	中国证券报	2019 年 3 月 12 日
14	中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金 2018 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2019 年 3 月 28 日

		券日报	
15	中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报	2019 年 4 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开通上海天天基金销售有限公司基金定投业务并参加基金定投费率优惠活动的公告	中国证券报	2019 年 5 月 15 日
17	中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金定期定额投资金额下限的公告	中国证券报	2019 年 5 月 17 日
18	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加海银基金销售有限公司等机构为代销机构的公告	中国证券报	2019 年 5 月 22 日
19	中邮创业基金管理股份有限公司直销平台认购费率及申购费率优惠的公告	中国证券报	2019 年 5 月 24 日
20	中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书	中国证券报	2019 年 6 月 15 日
21	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	中国证券报	2019 年 6 月 21 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	98,368,334.63	0.00	0.00	98,368,334.63	22.23%
个人	-	-	-	-	-	-	-
-	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%引起的风险，主要是由于持有人结构相对集中，机构同质化，资金呈现“大进大出”特点，在市场突变情况下，赎回行为高度一致，给基金投资运作可能会带来较大压力，使得基金资产的变现能力和投资者赎回管理的匹配与平衡可能面临较大考验，继而可能给基金带来潜在的流动性风险。							

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中小盘灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮中小盘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

中邮创业基金管理股份有限公司

2019年8月26日