

# 中邮信息产业灵活配置混合型证券投资 基金 2015 年年度报告

2015 年 12 月 31 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：2016 年 3 月 26 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

中邮信息产业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 2016 年 03 月 25 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。

本报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2015 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	11
2.4 信息披露方式.....	11
2.5 其他相关资料.....	11
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>11</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2 基金净值表现.....	12
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>14</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	20
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	22
4.9 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.....	22
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	22
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.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	23
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>24</b>
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	26
7.4 报表附注.....	28
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 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.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 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.....	57

8.7 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 .....	57
8.8 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 .....	57
8.9 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 .....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	58
8.12 投资组合报告附注 .....	58
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>59</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	59
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	59
9.3 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 .....	59
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>59</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	60
11.2 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 .....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	60
11.4 基金投资策略的改变 .....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
11.8 其他重大事件 .....	62
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	66

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮信息产业灵活配置混合
基金主代码	001227
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月14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	8,217,471,725.10份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注国家信息产业发展过程中带来的投资机会，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>本基金将根据对宏观经济、政策、市场和行业发展阶段判定当前所处的经济周期，进而科学地指导大类资产配置。通过对各类资产的市场趋势和预期风险收益特征的判定，来确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。本基金采用的分析因素有：</p> <p>1、宏观经济指标：通过对证券市场基本面产生普遍影响的宏观经济环境进行分析，研判宏观经济运行趋势以及对证券市场的影响。分析的主要指标包括：年度及季度GDP增长率、居民消费价格指数(CPI)、生产者价格指数(PPI)、货币供应量(M0, M1, M2)、进出口数据、工业用电量等；</p> <p>2、政策层面因素：通过对国家政策的前瞻性分析，研究不同政策发布对不同类别资产的影响。分析的主要指标包括：货币政策、财政政策、产业政策的变化趋势、税收、政府购买总量以及转移支付水平等财政政策,利率水平、货币净投放等货币政策等；</p> <p>3、市场层面因素：包括资金供求变化、总体估值水平相对于历史均值的偏离度、不同主题或行业的市场轮动情况等；</p> <p>4、行业层面因素：包括产业发展政策、行业生命周期、国际比较、产业投资情况等。</p> <p>本基金将综合运用定量和定性分析手段，从宏观、中观、微观等多个角度，综合考虑整体资产组合的风险、收益、流动性及各类资产相关性等因素，对大类资产配置比例进行灵活优化，精选具有内在价值和成长潜力的股票和流动性好、到期收益率与信用质量相对较高的债券等资产构建投资组合。</p> <p>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>本基金采用主题投资策略，通过对国家信息产业发展状况持续跟踪，分析信息</p>

产业的变化趋势和新技术的发展方向，选择具有领先优势、创新能力及增长潜力的好的上市公司进行投资，不断挖掘属于信息产业的投资主题及相关股票，分享这类企业带来的较高回报。

### 1、信息产业的界定

信息产业是指国民经济活动中，为经济发展和公共社会需求，从事信息资源的研究、开发与利用，以信息及其设备、设施等产品为主要产出，生产信息产品和提供信息服务的各个行业的集合。

本基金对信息产业主题范畴的投资范围界定为：

(1) 属于传统信息产业的行业：主要包含通信（电信运营、动力设备、通信终端及配件、网络覆盖优化与运维、网络接配及塔设、系统设备、线缆、增值服务等领域）、传媒（平面媒介、广播电视、电影动画、整体营销、互联网等领域）、电子元器件（半导体、电子设备及其他元器件等领域）、计算机（计算机硬件、PC 及服务器硬件、专用计算机设备、基础软件及套装软件、行业应用软件、IT 外包服务、系统集成及 IT 咨询等领域）等领域；

(2) 受益于信息化进程的行业：指通过信息化手段提升效率、降低成本和控制风险的相关行业，包括但不限于金融、医疗、教育、军工、汽车、零售、物流等受益于信息化进程的行业或相应主题；

(3) 当前非主营业务提供的产品或服务隶属于信息产业，且未来这些产品或服务有望成为主要利润来源的行业。

本基金投资于信息产业主题的证券不低于非现金资产的 80%，若未来由于技术进步或政策变化导致本基金信息产业主题相关行业和公司相关业务的覆盖范围发生变动，基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

### 2、信息产业的投资主题挖掘

在确定了信息产业的范畴之后，本基金将进行主题挖掘和主题配置，通过深入分析宏观经济指标和不同行业自身的周期变化特征以及在国民经济中所处的位置，确定在当前宏观背景下适宜投资的重点行业。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。

基金管理人定期召开投资决策委员会会议，由宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员和基金经理对主题进行评估，综合考虑主题发展阶段、主题催化因素、主题市场容量、主题估值水平等因素，确定每个主题的配置权重范围，从而进行主题配置。

### 3、个股选择

第一步，通过主题相关度筛选，构建信息产业股票库。

在确定了信息产业范畴和相关投资主题之后，基金管理人每半年末根据股票“主题相关度”指标打分情况，确定信息产业相关股票。在此期间对于未被纳入最近一次筛选范围的股票(如新股上市等)，如果其“主题相关度”可满足标准，也称为信息产业相关股票。

本基金主要根据公司战略定位、公司营业收入和利润能够受惠于投资主题的程度来确定“主题相关度”。具体来说，就是由研究员衡量主题因素对企业的主营业务收入、主营业务利润等财务指标的影响程度并打分，作为企业和投资主题的相关度标准。打分的依据主要有以下几个方面：

- (1) 公司战略定位；
- (2) 公司所处行业受宏观经济环境和国家产业政策的影响程度；
- (3) 公司主营业务收入和利润受此主题驱动的变动幅度；

(4) 公司的盈利模式;

(5) 公司竞争力分析, 包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等;

(6) 公司财务状况及财务管理能力, 包括财务安全性指标, 反映行业特性的主要财务指标、公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等。还特别关注公司投资信息产业相关公司股权情况。

本基金将信息产业相关股票纳入信息产业股票库。本基金投资于信息产业相关证券的比例不低于非现金资产的 80%。

第二步, 综合考虑企业成长、价值及盈利特性, 构建股票备选库。

本基金重点选择市场估值合理、盈利能力出色且营业收入和利润稳定增长的股票进入备选库。研究员对上市公司的财务报表和经营数据进行分析预测, 分别评估企业成长、价值及盈利特性。通过对各项指标设定一定的权重进行加权打分排序, 选取排名在前 50% 的个股进入股票备选库。

建立股票备选库参考指标包括:

(1) 成长特性指标: 包括营业利润同比增长率、经营性现金流同比增长率、净利润同比增长率、营业收入同比增长率等;

(2) 价值特性指标: 包括市盈率、市净率、PEG、市销率等;

(3) 盈利特性指标: 包括净资产收益率、总资产净利率、投入资本回报率、销售净利率等。

由于公司经营状况和市场环境在不断发生变化, 基金将实时跟踪上市公司风险因素和成长性因素的变动, 对分析指标及其权重设置进行动态调整。

第三步, 个股定性分析, 构建股票精选库。

在股票备选库的基础上, 本基金从公司治理结构、公司经营运行等方面对个股进行定性分析, 构建股票精选库。

精选库股票在公司治理结构方面需满足以下标准:

(1) 主要股东资信良好, 持股结构相对稳定, 注重中小股东利益, 无非经营性占款;

(2) 公司主营业务突出, 发展战略明晰, 具有良好的创新能力和优良的核心竞争力, 信息披露透明;

(3) 管理规范, 企业家素质突出, 具有合理的管理层激励与约束机制, 建立科学的管理与组织架构。

精选库股票在公司经营运行方面需满足以下标准:

(1) 具有持续经营能力和偿债能力, 资产负债率合理。具有持续的成长能力, 通过对公司商业模式的全方位分析判断公司成长动力来源和持续性;

(2) 主营业务稳定运行, 收入及利润保持合理增长, 资产盈利能力较高;

(3) 净资产收益率处在领先水平;

(4) 财务管理能力较强, 现金收支安排有序;

(5) 公司拥有创新能力、专有技术、特许权、品牌、渠道优势、重要客户等。

(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, 并结合对未来信息产业主题及相关行业的基本面判断, 选择具有良好投资价值的债券品种进行投资, 确定债券的投资组合。

1、久期策略

根据国内外的宏观经济形势、经济周期、国家的货币政策、汇率政策等经济因素，对未来利率走势做出准确预测，并确定本基金投资组合久期的长短。考虑到收益率变动对久期的影响，若预期利率将持续下行，则增加信用投资组合的久期；相反，则缩短信用投资组合的久期。组合久期选定之后，要根据各相关经济因素的实时变化，及时调整组合久期。考虑信用溢价对久期的影响，若经济下行，预期利率持续下行的同时，长久期产品比短久期产品将面临更多的信用风险，信用溢价要求更高。因此应缩短久期，并尽量配置更多的信用级别较高的产品。

## 2、期限结构策略

本基金根据国际国内经济形势、国家的货币政策、汇率政策、货币市场的供需关系、投资者对未来利率的预期等因素，对收益率曲线的变动趋势及变动幅度做出预测。收益率曲线的变动趋势包括：向上平行移动、向下平行移动、曲线趋缓转折、曲线陡峭转折、曲线正蝶式移动和曲线反蝶式移动等。本基金根据变动趋势及变动幅度预测来决定信用投资产品组合的期限结构，然后选择采取相应期限结构的策略：子弹策略、杠铃策略或梯式策略。若预期收益曲线平行移动，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小，宜采用子弹策略；若预期收益曲线做趋缓转折，宜采用杠铃策略；若预期收益曲线做陡峭转折，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小宜采用子弹策略。用做判断依据的具体正向及负向变动幅度临界点，需要运用测算模型进行测算。

## 3、个券选择策略

### (1) 特定跟踪策略

特定是指某类或某个信用产品具有某种特别的特点，这种特点会造成此类信用产品的价值被高估或者低估。特定跟踪策略，就是要根据特定信用产品的特定特点，进行跟踪和选择。在所有的信用产品中，寻找在持有期内级别上调可能性比较大的产品，并进行配置；对在持有期内级别下调可能性比较大的产品，要进行规避。判断的基础就是对信用产品进行持续内部跟踪评级及对信用评级要素进行持续跟踪与判断，简单的做法就是跟踪特定事件：国家特定政策及特定事件变动态势、行业特定政策及特定事件变动态势、公司特定事件变动态势，并对特定政策及事件对于信用产品的级别变化影响程度进行评估，从而决定对于特定信用产品的取舍。

### (2) 相对价值策略

本策略的宗旨是要找到价值被低估的信用产品。属于同一个行业、类属同一个信用级别且具有相近期限的不同债券，由于息票因素、流动性因素及其他因素的影响程度不同，可能具有不同的收益水平和收益变动趋势，对同类债券的利差收益进行分析，找到影响利差的因素，并对利差水平的未来走势做出判断，找到价值被低估的个券，进而相应地进行债券置换。本策略实际上是某种形式上的债券互换，也是寻求相对价值的一种投资选择策略。

这种投资策略的一个切实可行的操作方法是：在一级市场上，寻找并配置在同等行业、同等期限、同等信用级别下拥有较高票面利率的信用产品；在二级市场上，寻找并配置同等行业、同等信用级别、同等票面利率下具有较低二级市场信用溢价（价值低估）的信用产品并进行配置。

## 4、中小企业私募债投资策略

利用自下而上的公司、行业层面定性分析，结合 Z-Score、KMV 等数量分析模型，测算中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异，根据自上而下的宏观经济及行业特性分析，从行业层面对中小



	<p>企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异，结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。</p> <p>（四）权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。</p> <p>（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。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准构成为：中证信息技术指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	林葛
	联系电话	010-82295160-157	010-66060069
	电子邮箱	houyuc@postfund.com.cn	tgxxpl@abchian.com
客户服务电话		010-58511618	95599
传真		010-82295155	010-68121816
注册地址		北京市海淀区西直门北大街60号首钢国际大厦10层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		北京市海淀区西直门北大街60号首钢国际大厦10层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码		100082	100031
法定代表人		吴涛	刘士余

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙人）	北京市建国门外大街 22 号赛特广场五层
注册登记机构	中邮创业基金管理股份有限公司	北京市海淀区西直门北大街 60 号首钢国际大厦 10 层

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)-2015 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-514,206,433.08
本期利润	-230,235,225.44
加权平均基金份额本期利润	-0.0221
本期加权平均净值利润率	-2.48%
本期基金份额净值增长率	4.70%
3.1.2 期末数据和指标	2015 年末
期末可供分配利润	-341,132,132.01
期末可供分配基金份额利润	-0.0415
期末基金资产净值	8,605,223,534.01
期末基金份额净值	1.047
3.1.3 累计期末指标	2015 年末
基金份额累计净值增长率	4.70%

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

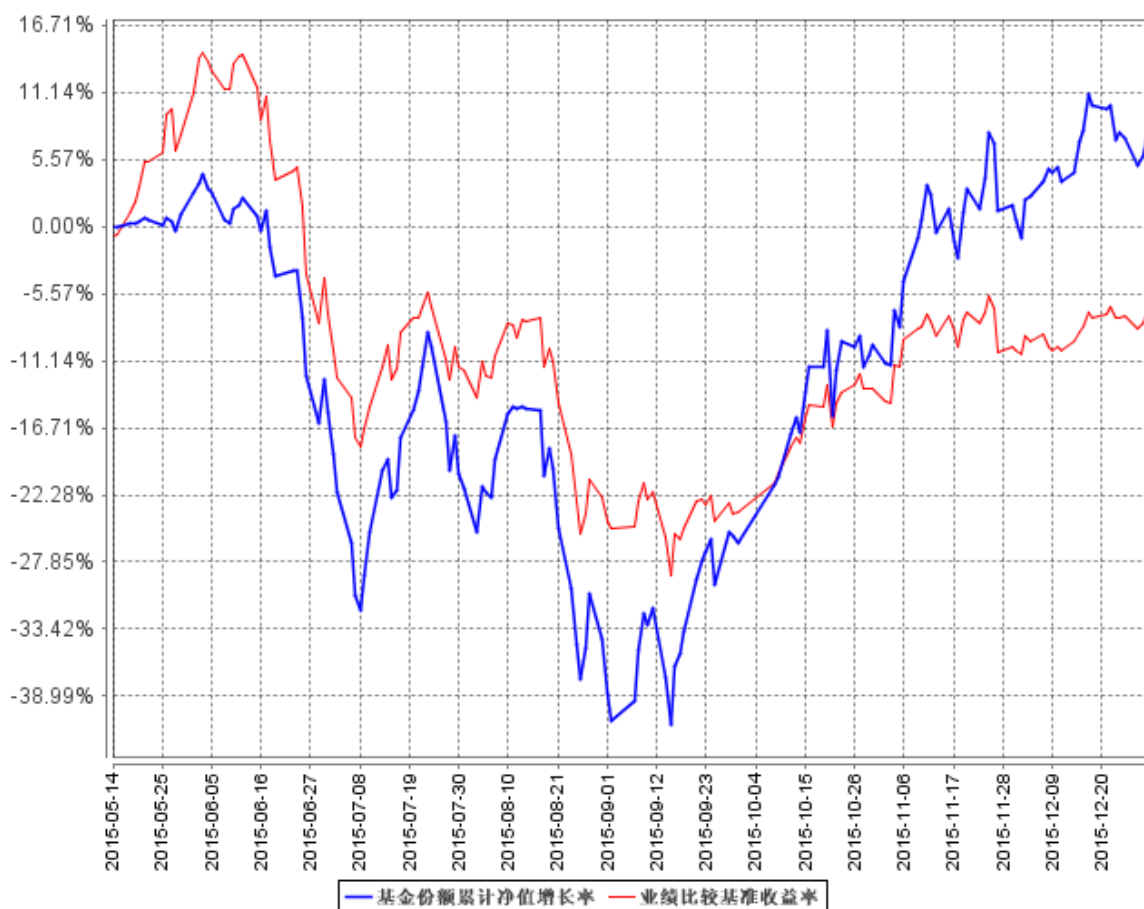
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	41.87%	2.57%	19.85%	1.47%	22.02%	1.10%
过去六个月	19.93%	3.63%	-4.43%	2.10%	24.36%	1.53%
自基金合同生效起至今	4.70%	3.35%	-8.52%	2.13%	13.22%	1.22%

注：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。

本基金业绩衡量基准 = 中证信息技术指数 × 60% + 上证国债指数 × 40%

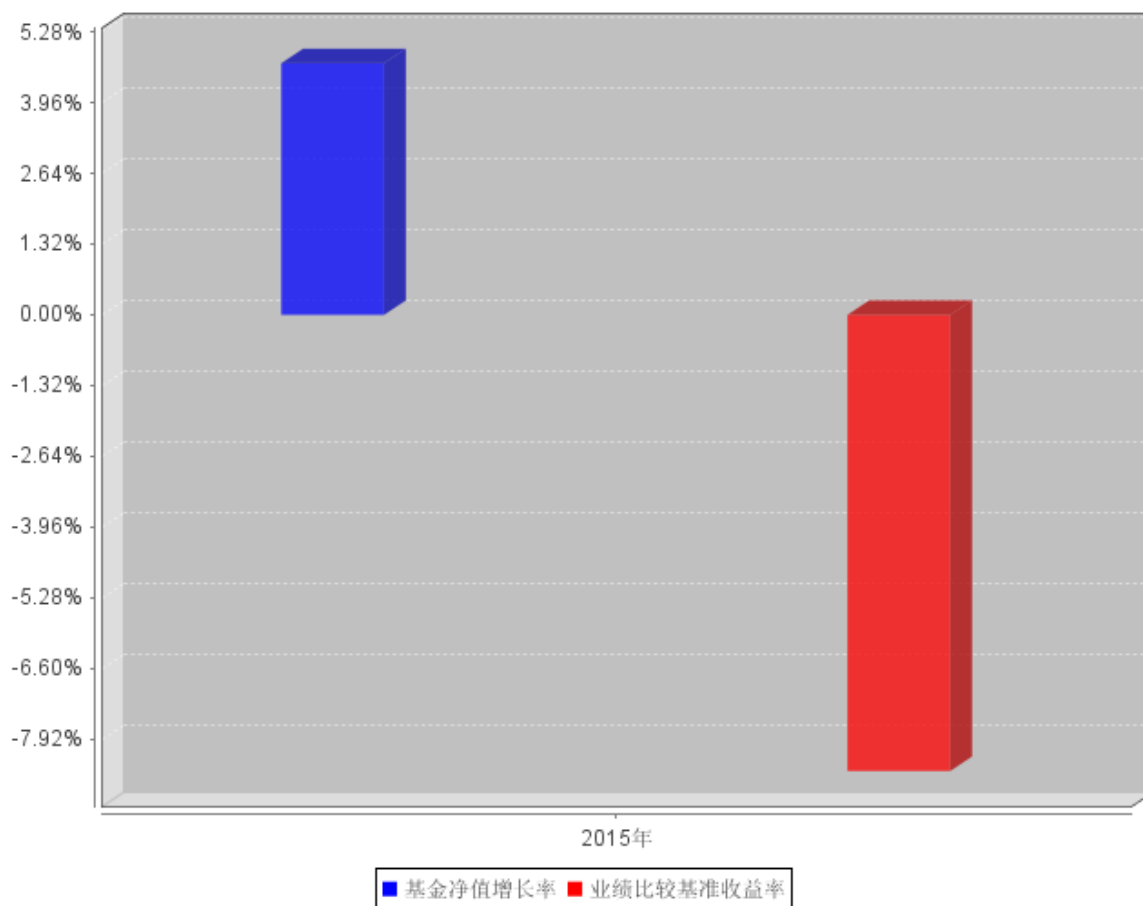
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金在过去的三年未实施利润分配。

## § 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 18 日，截至 2015 年 12 月 31 日，本公司共管理 23 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基

金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创业新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金。

#### 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		
任泽松	基金经理	2015年5月14日	-	7年	生物学硕士，曾任毕马威华振会计师事务所审计员、北京源乐晟资产管理有限公司行业研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部行业研究员，中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理兼行业研究员，现任中邮创业基金管理股份有限公司任泽松投资工作室总负责人、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮双动力混合型证券投资基金基金经理、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理、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。
周楠	基金经理	2015年5月26日	-	3年	曾任大唐微电子技术有限公司数字前端设计工程师、大唐电信科技股份有限公司产品工程师，中

					邮创业基金管理股份有限公司中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理助理、中邮核心竞争力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。现任中邮信息产业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基金经理注册或变更等通知的日期。

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

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 公平交易制度和控制方法

#### 1、公平交易制度

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中邮基金管理股份有限公司公平交易制度》。公司的公平交易制度所规范的业务范围既包括所有投资组合品种，即涵盖封闭式基金、开放式基金、社保组合、企业年金、特定客户资产管理组合等；也规范所有一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，并且包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的所有业务环节。

公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，严格禁止直接或者通过与第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。

公司按照规定严格将投资管理职能和交易执行职能进行隔离，以时间优先、价格优先、

综合平衡、比例实施、保证各基金间的利益公平为原则建立和完善集中交易制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。

投资组合经理对公平交易执行过程或公平交易结果发生争议情况下，相关交易员应该先暂停执行交易并报告交易部总经理，由交易部总经理与相关投资组合经理就争议内容进行协调处理，经协调后方可执行；若无法达成一致意见，则由交易部总经理根据公司制度报公司总经理和监察稽核部门协调解决。

监察稽核部每季度依照相关法律法规及本制度的规定，对公司所管理的各投资组合公平交易制度执行情况进行监督检查，并出具检查报告，经总经理、投资总监、投资组合经理确认并签署后将有关公平交易情况的专项说明报告转发至相关部门作为编制定期报告的内容。

## 2、控制方法

监察稽核部建立投资交易行为监督和评估制度，对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。如若发现异常交易行为，监察稽核部有权要求相关投资经理、交易部等相关责任部门、责任人做出说明。监察稽核部要求相关责任部门、责任人就异常交易行为做出说明的，相关责任部门、责任人须在三个工作日内，提交异常交易行为情况说明，经督察长、总经理签字后，报监察稽核部备查。

为更好执行公平交易制度，公司加快了升级衡泰风险与绩效评估 4.0 系统的进度，其业界通用的公平交易模块即将得到使用。公司目前使用的公平交易模型可以通过设置参数出具季度和连续 12 个月公平交易价差分析报告，相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释，并最终形成有关公平交易情况的专项说明报告发送至相关各部门。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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，基金管理人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%。

## 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

报告期内资本市场巨幅震荡：

5 月份，本基金完成募集，出于对高估值的担忧，我们采取了构筑安全垫、谨慎建仓的操作策略。6 月份，在 IPO 和增发加速、股东减持、清理杠杆的共同作用下，资本市场陷入了流动性危机。我们通过适时调整仓位，降低流动性风险和净值回撤，加强了行业趋势研究和公司调研，提高了对行业龙头、长期看好标的配置，降低了估值优势不强、短期催化不足等标的的仓位。

8 月份市场经历了较大的调整，主板指数和创业板指数分别创出了年内新低，大部分个股也出现了明显的下挫。在此过程中，我们首先对仓位进行了严格的控制，同时对基金产品持仓个股进行了重新的梳理，对估值较高的个股进行了减持，加大了对安全边际较高行业以及个股的配置。随着市场的下跌，许多个股股价逐渐跌入合理的区间，因此在 9 月初加大了基金产品对股票资产的投资比重，之后市场出现了一定幅度的反弹，尤其是创业板指数出现了 17%左右的涨幅，对基金业绩的做出了较大的贡献。

10 月份，在去杠杆接近尾声、整体流动性宽松、优质成长股低估的推动下，上证指数单月上涨 10.8%，创业板指数单月上涨 19%。我们适当提高了仓位，精选业绩增长前景良好且被市场相对低估的个股进行了集中投资，基金业绩表现大幅超过同类产品。

11 月到 12 月份，在美联储加息、注册制预期、年底高风险资金博弈中，市场整体涨幅收窄，主题投资风格明显。我们对仓位进行了控制，期望减少净值回撤风险的同时，在市场波动中完成仓位调整，为 2016 年行情做好标的储备。

在行业配置方面，我们认为信息产业空间巨大，渗透率不高，是战略新兴产业的重中之重，我们保持了对互联网视频、云计算、大数据、军工信息化、智能硬件、互联网金融等子行业的重点配置。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2015 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.047 元，累计净值 1.047 元。本报告期份额净值增长率为 4.7%，同期业绩比较基准增长率为-8.52%；

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在宏观经济增速逐步下台阶的大趋势中，2016 年作为“十三五”开局之年，“稳增长”不容有失。在改革和转型过程中，传统经济难以维持高增速，新兴产业比重逐步增加。预计在一系列货币和财政政策下，整体流动性依然宽裕，但从边际改善来看对市场的影响作用要弱于 2015 年。



2016 年初资本市场剧烈波动源于人民币贬值预期、大股东解禁减持、注册制预期，以及熔断机制加剧市场恐慌。展望未来，利空因素在逐步消退中，年初政策规划亮点不断、流动性宽松的特征不变、汇率波动在可控范围内，市场将逐步进入修复期。

寻找信息化相关细分景气行业龙头。国内市场空间巨大，宏观经济不具备系统性风险，高景气细分领域众多。人口结构变化与收入增长推动消费从商品转向服务，以互联网为代表的信息产业将加速传媒、体育、医疗、教育、养老等新兴消费发展。“十三五”规划是 16 年“两会”的重头戏，信息技术相关的大数据、云计算等都是中期转型的方向。

在“增量行情”短期难以出现的情况下，本基金将会维持目前较为合理的仓位水平，结合当前的风险偏好，围绕空间、壁垒、管理层等维度，在信息产业相关的互联网视频、云计算、大数据、军工信息化、智能硬件、消费升级等领域重点配置，在市场分化过程中发挥“自下而上”精选个股的优势，力争在 2016 年为投资者带来较好的投资回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人致力于建立和健全公司内部控制制度，努力防范和化解公司各项经营管理活动中的风险，促进公司诚信、合法、有效经营，切实保障基金份额持有人的利益。

公司已建立了督察长制度，督察长全权负责公司的监察与稽核工作，对基金运作的合法合规性进行全面检查与监督，遇有重大风险事件立即向公司董事长和中国证监会报告。公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，由督察长直接领导。监察稽核部按照规定的权限和程序，通过日常实时监控、现场专项检查、定期监察稽核评估等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向公司董事和管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人主要内部监察稽核工作如下：

##### 1. 制度建设不断完善

基金管理人进一步健全公司内控体系，保持了良好的内控环境、完善了内部控制的三道防线，并根据公司实际业务情况细化了岗位风险控制。在制订部门规章制度和业务流程时，将内控要求融入到各业务规范当中。同时根据公司业务的发展及监管部门法律法规的更新，对公司和部门制度进行持续的完善、修订及补充。根据新《基金法》，

公司制定了《中邮创业基金管理股份有限公司基金从业人员证券投资管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司关联交易管理制度》。根据业务发展需要和监管要求，各个业务部门也都不断修改和完善自身的部门制度。投研、交易、固定收益、金融工程、人力资源等部门均根据实际工作需要对本部门制度进行了较大完善。公司反洗钱内控制度方面，根据人民银行《金融机构洗

钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理指引》，公司制定了《中邮创业基金管理股份有限公司洗钱和恐怖融资风险评估及客户分类管理制度》，进一步完善了公司的制度体系。

## 2. 日常监察稽核工作

为规范基金投资运作、防范风险、更好的保护基金份额持有人的利益，对基金投资运作进行日常的监察工作，保障研究、投资决策、交易执行等环节严格执行法律法规及基金合同的有关规定。在日常实时电脑监控中，对基金投资及相关业务进行事中的风险控制，保障公司管理的基金规范运作。此外对信息技术、基金的注册登记、基金会计、信息披露等业务进行例行检查。

## 3. 专项与常规监察稽核工作

根据监管部门的要求及公司业务开展情况，对相关业务部门进行专项和常规监察稽核。报告期内，对公司的研究、投资、交易、固定收益业务、三条底线、防范内幕交易进行了专项稽核。对信息技术、公共事务部、营销部等进行了常规稽核。通过检查发现内部控制薄弱点，及时提出了整改意见及建议。

## 4. 定期监察稽核及内控检查评估工作

每季度对公司及基金运作的合法合规性及内部控制情况进行检查，对公司各项业务的制度建设、制度执行、风险控制等情况进行评估，发现内控的薄弱环节，并提出相应改进措施，促进公司内部控制和风险管理水平的加强和提高。

在本报告期内，本基金管理人运用基金财产进行投资严格按照招募说明书所披露的投资决策程序进行，无不当内幕交易和关联交易。没有发生重大违法违规行为。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持内部控制优先原则，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.7 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。

## 4.8 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，本基金未能满足利润分配条件，故未进行利润分配。

#### 4.9 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—中邮创业基金管理股份有限公司 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字(2016)第 110ZA2811 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告	
审计报告收件人	中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金全体基金份额持有人：	
引言段	我们审计了后附的中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金（以下简称中邮信息产业基金）财务报表，包括 2015 年 12 月 31 日的资产负债表，2015 年 05 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日的利润表、所有者权益（基金净值）变动表和财务报表附注。	
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是中邮信息产业基金的基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司管理层的责任，这种责任包括： （1）按照企业会计准则的规定编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。	
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>	
审计意见段	我们认为，中邮信息产业基金财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中邮信息产业基金 2015 年 12 月 31 日的财务状况以及 2015 年 05 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日的经营成果和所有者权益（基金净值）变动情况。	
注册会计师的姓名	卫俏嫔	吕玉芝

会计师事务所的名称	致同会计师事务所 (特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国·北京 朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
审计报告日期	2016 年 3 月 18 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,173,999,212.21
结算备付金		373,450,400.69
存出保证金		8,919,277.00
交易性金融资产	7.4.7.2	7,088,606,962.29
其中：股票投资		7,088,606,962.29
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	667,290.50
应收股利		-
应收申购款		19,660,415.74
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		8,665,303,558.43
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-

应付证券清算款		11,478,799.17
应付赎回款		29,753,088.86
应付管理人报酬		11,603,651.76
应付托管费		1,933,941.99
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	4,997,048.61
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	313,494.03
负债合计		60,080,024.42
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	8,217,471,725.10
未分配利润	7.4.7.10	387,751,808.91
所有者权益合计		8,605,223,534.01
负债和所有者权益总计		8,665,303,558.43

注：报告截止日 2015 年 12 月 31 日，中邮信息产业灵活配置混合基金份额净值 1.047 元，基金份额总额 8,217,471,725.10 份。

本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日，本报告期指 2015 年 5 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日，因此无上年度比较数据。

## 7.2 利润表

会计主体：中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2015年5月14日(基金合同生效日)至2015 年12月31日
<b>一、收入</b>		-100,283,199.69
1. 利息收入		33,031,790.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	31,150,808.90
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		1,880,981.63
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-444,635,012.60
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-517,386,033.76
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-

资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	68,465,210.00
股利收益	7.4.7.16	4,285,811.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	283,971,207.64
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	27,348,814.74
<b>减：二、费用</b>		129,952,025.75
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	87,113,242.41
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,518,873.77
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.19	27,993,101.25
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.20	326,808.32
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-230,235,225.44
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-230,235,225.44

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日，本报告期指 2015 年 5 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日，因此无上年度比较数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 5 月 14 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 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）	12,602,264,773.92	-	12,602,264,773.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-230,235,225.44	-230,235,225.44
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）	-4,384,793,048.82	617,987,034.35	-3,766,806,014.47

其中：1. 基金申购款	4,246,242,000.73	-381,075,615.07	3,865,166,385.66
2. 基金赎回款	-8,631,035,049.55	999,062,649.42	-7,631,972,400.13
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）	8,217,471,725.10	387,751,808.91	8,605,223,534.01

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 5 月 14 日，本报告期指 2015 年 5 月 14 日至 2015 年 12 月 31 日，因此无上年度比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 周克	_____ 周克	_____ 吕伟卓
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中邮信息产业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〔2015〕581号《关于核准中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准募集，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《中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2015 年 5 月 14 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 12,602,264,773.92 元，业经致同会计师事务所(特殊普通合伙)致同验字(2015)第 110ZC0202 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《中邮信息产业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%。本基金投资于信息产业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。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年度，即从每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计期间。本期财务报表的实际编制期间为 2015 年 05 月 14 日（基金合同生效日）至 2015 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款、应收款项。除与权证投资有关的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示；与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的各类应收款项等在活跃市场没有报价、回收金额固定或可以确定的非衍生金融资产分类为贷款与应收款项。

## (2) 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示，与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金目前持有的金融负债全部为其他金融负债，包括各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。股票投资收益按卖出股票成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出股票的公允价值变动损益转入股票投资收益，卖出股票应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

股票持有期间分派的股票股利，应于除权除息日根据上市公司股东大会决议公告，按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量，在本账户“数量”栏进行记录。因持有股票而享有的配股权，配股除权日在配股缴款截止日之后的，在除权日按所配的股数确认未流通部分的股票投资，与已流通部分分别核算。配股除权日在配股缴款截止日之前的，按照权证的有关原则进行核算。

股票投资应分派的现金股利，在除息日确认为股利收入。

估值日对持有的股票估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认债券投资；债券投资按交易日债券的公允价值（不含支付价款中所包含的应收利息）入账，应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行资金交收。

持有债券期间，每日确认利息收入，计入应收利息和利息收入科目。

债券派息日，按应收利息金额，与证券登记结算机构进行资金交收。

估值日对持有的债券估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

卖出债券应于交易日确认债券投资收益。债券投资收益按卖出债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该卖出债券的公允价值变动损益转入债券投资收益，卖出债券应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

到期收回债券本金和利息，债券投资收益按收回债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该收回债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

可转换债券转股时，按可转换股票的公允价值计入股票投资科目，按应收取的现金余额返还扣除可转换股票的公允价值后的余额，与可转换债券成本、应收利息和估值增值或减值的差额计入债券投资收益，同时，将原计入该转换债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

获赠权证（包括配股权证）在除权日应按持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，在本账户“数量”栏进行记录。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益。衍生工具收益按卖出权证成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

权证行权按结算方式分为证券结算方式和现金结算方式，具体核算如下：

#### A、证券结算方式

认购权证以证券结算方式行权时，按股票的公允价值确认股票投资成本，按股票公允价值与权证成本、估值增值或减值、行权价款及相关费用的差额确认衍生工具收益，同时将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

认沽权证以证券结算方式行权时，按认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）确认衍生工具收益，按行权价款扣除费用后的余额与权证投资成本、估值增值或减值、结转的股票投资成本、估值增值或减值、认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）的差额确认股票投资收益，同时，将原计入卖出股票和原计入权证的公允价值变动损益转入股票投资收益和衍生工具收益。

#### B、现金结算方式

权证以现金结算方式行权时，按确定的金额扣减交易费用后的余额与结转的权证成本、估值增值或减值的差额确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

放弃行权，在放弃行权确定日，按结转的权证成本、估值增值或减值，确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

#### (4) 资产支持证券

取得资产支持证券时，按公允价值入账；取得资产支持证券支付的款项时，区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分，将收到的本金部分冲减成本，将收到的收益部分冲减应计利息（若有）后的差额，记入资产支持证券利息收入，其他与资产支持证券投资相关业务的账务处理比照债券投资。

#### (5) 买入返售金融资产和卖出回购金融资产

根据返售协议，按照应付和实际支付的金额确认入账；返售前，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；返售日，按照应收或实际收到的金额与账面余额和应收利息的差额，计算确认利息收入。

根据回购协议，按照应收和实际收到的金额确认入账；融资期限内，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；到期回购时，按照应付或实际支付的金额与账面余额和应付利息的差额，计算确认利息支出。

#### (6) 股指期货投资

股指期货在买入和卖出合约时，记录初始合约价值。估值日对股指期货估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

买入合约卖出平仓、卖出合约买入平仓或到期交割时，采用移动加权方法结转平仓合约的初始合约价值。日终结算时，对股指期货进行估值，确认平仓损益，进行当日无负债结算，并对合约占用的交易保证金进行调整。

#### (7) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值原则遵循中国证券监督管理委员会 2007 年 6 月 8 日发布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》（证监会计字[2007]21 号）和中国证券投资基金业协会 2014 年 11 月 13 日发布的《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“新估值标准”）及《关于 2015 年 1 季度固定收益品种估值处理标准的通知》的有关规定，具体估值方法如下：

#### (1) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，但最

近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；首次发行未上市的股票采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；送股、转增股、配股和公开增发新股等发行未上市股票，按交易所上市的同一股票的市价估值；首次公开发行有明确锁定期的股票，同一股票在交易所上市后，按交易所上市的同一股票的市价估值；非公开发行有明确锁定期的股票，按下列办法进行估值：

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本高于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应采用在证券交易所上市交易的同一股票的市价作为估值日该股票的价值。

如果估值日非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本低于在证券交易所上市交易的同一股票的市价，应按以下公式确定该股票的价值：

$$FV=C+(P-C) \times (D1-Dr) / D1$$

其中：

FV 为估值日该非公开发行有明确锁定期的股票的价值；

C 为该非公开发行有明确锁定期的股票的初始取得成本（因权益业务导致市场价格除权时，应于除权日对其初始取得成本作相应调整）；

P 为估值日在证券交易所上市交易的同一股票的市价；

D1 为该非公开发行有明确锁定期的股票的锁定其所含的交易日的交易天数；

Dr 为估值日剩余锁定期，即估值日至锁定期结束所含的交易日的交易天数（不含估值日当天）。

按照证监会公告[2008] 38 号—《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及《中国证券业协会基金估值工作小组停牌股票估值的参考方法》的要求，本基金对长期停牌股票按“指数收益法”进行估值。

## （2）债券投资

本基金在对银行间和交易所市场的固定收益品种估值时，主要依据由第三方估值机构提供的价格数据。第三方估值机构包括中央国债登记结算公司（以下简称“中央结算公司”）和中证指数有限公司。第三方估值机构根据以下原则确定估值品种公允价值：对于存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很

少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

未上市流通的债券在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

### (3) 权证投资

上市权证按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

### (4) 股指期货投资

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

### (5) 其他投资品种

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

资产支持证券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值。

### (6) 估值不能客观反映其公允价值的处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### (7) 实际投资成本与估值的差异处理

实际投资成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。

## 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示不得相互抵销。

## 7.4.4.7 实收基金

本基金单位总额不固定，基金单位总数随时增减。基金合同生效时，实收基金按实际收到的基金单位发行总额入账；基金合同生效后，实收基金应于基金申购、赎回确认日根据基金契约和

招募说明书中载明的有关事项进行确认和计量。

#### 7.4.4.8 损益平准金

基金管理公司于收到基金投资人申购或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，计算有效申购或转换款中含有的实收基金部分，确认并增加实收基金，按基金申购或转换款与实收基金的差额，确认并增加损益平准金。

基金管理公司于收到基金投资人赎回或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，对基金赎回款或转换转出款中含有的实收基金，确认并减少实收基金，按基金赎回款或转换转出款与实收基金的差额，确认并减少损益平准金。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 股票投资收益

于卖出股票交易日确认，按卖出股票成交总额与其成本的差额入账。

##### (2) 债券投资收益

于卖出债券交易日确认，按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

##### (3) 股利收入

于除息日确认，按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

##### (4) 债券利息收入

在债券实际持有期内逐日计提，按摊余成本和实际利率计算确定的金额入账。

##### (5) 存款利息收入

逐日计提，按本金与适用的利率计提的金额入账。

##### (6) 买入返售证券收入

在证券持有期内采用实际利率逐日计提，按计提的金额入账。

##### (7) 公允价值变动损益

于估值日，对采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的损益进行确认；卖出股票、债券、权证等资产时，将原计入该卖出资产的公允价值变动损益转入股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益等科目。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

##### (1) 基金管理人报酬

本基金合同生效后一年内，基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.5%年费率计提。

基金合同生效满一年后，本基金采用浮动管理费率，基金合同生效日的每个季度对日，根据基金在该日之前（不含该日）连续一年的基金份额累计净值增长率与该日业绩比较基准进行比较。

当基金份额累计净值增长率高于该日业绩比较基准（基金份额累计净值增长率小数点后保留位数与该日业绩比较基准小数点后位数相同）时，该日起（含该日）至下一个季度对日（不含该日）基金的管理费按前一日基金资产净值的 3.00%年费率计提。

当基金份额累计净值增长率等于该日业绩比较基准时，该日起（含该日）至下一个季度对日（不含该日）基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50%年费率计提。

当基金份额累计净值增长率低于该日业绩比较基准时，该日起（含该日）至下一个季度对日（不含该日）本基金将不收取管理费。

##### (2) 基金托管费

按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

##### (3) 交易费用

对股票、债券、资产支持证券、基金、权证等交易过程中发生的，可直接归属于取得或处置某项基金资产或承担某项基金负债的新增外部成本，包括支付给交易代理机构的规费、佣金、代征的税金及其他必要的可以正确估算的支出，在资产交易日确认各项交易费用。

##### (4) 利息支出

对银行借款利息支出、交易性金融负债利息支出和卖出回购金融资产支出，在借款期或融资期内按实际利率逐日计提并确认入账。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；每份基金份额享有同等分配权；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 50%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，基金期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。



## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

## 7.4.6 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》、财税字[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[2012]85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》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. 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。
2. 自 2013 年 1 月 1 日起，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，暂不征收企业所得税；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；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 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。
3. 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。
4. 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日
活期存款	1,173,999,212.21
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-

其他存款	-
合计：	1,173,999,212.21

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	6,804,635,754.65	7,088,606,962.29	283,971,207.64
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	6,804,635,754.65	7,088,606,962.29	283,971,207.64

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有买断式逆回购金融资产。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应收活期存款利息	562,468.05
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	100,674.53
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-

应收申购款利息	134.32
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	4,013.60
合计	667,290.50

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,997,048.61
银行间市场应付交易费用	-
合计	4,997,048.61

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	83,494.03
预提审计费用	80,000.00
预提信息披露费用	150,000.00
合计	313,494.03

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	12,602,264,773.92	12,602,264,773.92
本期申购	4,246,242,000.73	4,246,242,000.73
本期赎回(以“-”号填列)	-8,631,035,049.55	-8,631,035,049.55
- 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	8,217,471,725.10	8,217,471,725.10
-----	------------------	------------------

注：本基金合同生效日为 2015 年 05 月 14 日，在募集期间认购资金及利息折份额共计 12,602,264,773.92 份。

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-514,206,433.08	283,971,207.64	-230,235,225.44
本期基金份额交易产生的变动数	173,074,301.07	444,912,733.28	617,987,034.35
其中：基金申购款	-214,870,954.43	-166,204,660.64	-381,075,615.07
基金赎回款	387,945,255.50	611,117,393.92	999,062,649.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-341,132,132.01	728,883,940.92	387,751,808.91

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	29,615,864.01
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	1,489,409.84
其他	45,535.05
合计	31,150,808.90

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,919,715,014.73
减：卖出股票成本总额	7,437,101,048.49
买卖股票差价收入	-517,386,033.76

### 7.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资。

#### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 衍生工具收益 ——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
其他衍生工具-股指期货	68,465,210.00
其他衍生工具-商品期货	-
合计	68,465,210.00

### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,285,811.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,285,811.16

### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	283,971,207.64
——股票投资	283,971,207.64
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-

3. 其他	-
合计	283,971,207.64

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
基金赎回费收入	27,348,814.74
合计	27,348,814.74

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，对持续持有期小于30日（不含30日）的，赎回费全部计入基金财产；对持续持有期长于30日（含30日）少于93日（不含93日）的，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于93日（含93日）但少于186日的，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于186日（含186日）的，将不低于赎回费总额的25%归基金财产。其余用于注册登记费和其他必要的手续费。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
交易所市场交易费用	27,993,101.25
银行间市场交易费用	-
合计	27,993,101.25

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2015年5月14日(基金合同生效日)至2015年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	200,000.00
其他	46,808.32
合计	326,808.32

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

本报告期内，本基金不存在或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2016 年 3 月 18 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金管理人股东控股的公司、基金代销机构

## 7.4.10 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。

### 7.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

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。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	87,113,242.41
其中：支付销售机构的客户维护费	40,796,635.61

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费，每日计算，按前一日基金资产净值的 1.5% 年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	14,518,873.77

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，每日计算，按前一日基金资产净值的 0.25% 计提，逐日累计至每月月末，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

#### 7.4.10.3 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发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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	
	2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
基金合同生效日（2015 年 5 月 14 日）持有的基金份额	-	
期初持有的基金份额	-	
期间申购/买入总份额	2,425,314.58	
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	2,425,314.58	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.03%	

##### 7.4.10.4.2 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

注：本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 7.4.10.5 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	
	2015 年 5 月 14 日(基金合同生效日)至 2015 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,173,999,212.21	29,615,864.01



#### 7.4.10.6 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发生在承销期内参与认购关联方承销证券的情况。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

注：本报告期本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002642	荣之联	2015年12月8日	2016年12月9日	非公开发行流通受限	40.12	41.42	1,993,000	79,959,160.00	82,550,060.00	-

##### 7.4.12.2 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
300038	梅泰诺	2015年12月16日	重大事项	57.62	-	-	1,999,666	69,914,062.19	115,220,754.92	-
300104	乐视网	2015年12月7日	重大事项	60.18	-	-	10,399,479	692,703,002.45	625,840,646.22	-
300324	旋极信息	2015年12月1日	重大事项	50.60	2016年3月10日	44.33	15,884,345	658,920,346.34	803,747,857.00	-
300331	苏大维格	2015年11月16日	重大事项	26.81	-	-	3,812,912	107,270,112.10	102,224,170.72	-
300431	暴风科技	2015年10月27日	重大事项	104.61	-	-	2,111,866	116,975,577.35	220,922,302.26	-
300456	耐威科技	2015年8月3日	重大事项	108.96	2016年1月15日	113.00	757,551	80,239,571.57	82,542,756.96	-

注：1. 按照证监会公告[2008]38号-《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及《中国证券业协会基金估值小组停牌股票估值的参考方法》的要求，上述股票中梅泰诺（300038）、乐视网（300104）、旋极信息（300324）、苏大维格（300331）、暴风科技（300431）、耐威科技（300456）均按“指数收益法”进行估值。

2. 2016年03月10日，旋极信息（300324）复牌交易，根据这只股票复牌后的交易特征，本公司

综合参考各项相关影响因素并于托管人共同协商，一致决定自 2016 年 03 月 14 日起回复采用收盘价进行估值。

#### **7.4.12.3 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。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 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。

#### **7.4.13.2 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。

#### **7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为债券、可转换债券、银行存款等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年12月31日	1个月 以内	1-3个 月	3个月 -1年	1年以内	1-5年	5年以 上	不计息	合计
资产								
银行存款	-	-	-	1,173,999,212.21	-	-	-	1,173,999,212.21
结算备付金	-	-	-	373,450,400.69	-	-	-	373,450,400.69
存出保证金	-	-	-	8,919,277.00	-	-	-	8,919,277.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-	7,088,606,962.29	7,088,606,962.29
应收利息	-	-	-	-	-	-	667,290.50	667,290.50
应收申购款	-	-	-	-	-	-	19,660,415.74	19,660,415.74
资产总计	-	-	-	1,556,368,889.90	-	-	7,108,934,668.53	8,665,303,558.43
负债								
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	11,478,799.17	11,478,799.17
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	29,753,088.86	29,753,088.86
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	-	11,603,651.76	11,603,651.76
应付托管费	-	-	-	-	-	-	1,933,941.99	1,933,941.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	-	4,997,048.61	4,997,048.61
其他负债	-	-	-	-	-	-	313,494.03	313,494.03
负债总计	-	-	-	-	-	-	60,080,024.42	60,080,024.42
利率敏感度缺口	-	-	-	1,556,368,889.90	-	-	7,048,854,644.11	8,605,223,534.01

#### 7.4.13.4.1.2 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。

#### 7.4.13.4.2 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%。本基金投资于信息产业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 2015 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2015 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	7,088,606,962.29	82.38
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	7,088,606,962.29	82.38

#### 7.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 固定其它市场变量，当本基金基准上升 1%		
	2. 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（2015 年 12 月 31 日）	上年度末（2014 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	116,432,018.09	-
	2. 基金净资产变动	-116,432,018.09	-

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 2015 年 12 月 31 日十年期国债收益率 2.82%，利用 2015 年 7 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 1.64。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	7,088,606,962.29	81.80
	其中：股票	7,088,606,962.29	81.80
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	1,547,449,612.90	17.86
7	其他各项资产	29,246,983.24	0.34
8	合计	8,665,303,558.43	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。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,843,324,004.67	33.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	390,390,776.80	4.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	3,491,201,937.80	40.57
J	金融业	-	-
K	房地产业	98,350,196.88	1.14
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	39,599,247.60	0.46
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	225,740,798.54	2.62
S	综合	-	-
	合计	7,088,606,962.29	82.38

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。

## 8.3 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	300324	旋极信息	15,884,345	803,747,857.00	9.34

2	300267	尔康制药	22,909,616	769,763,097.60	8.95
3	300104	乐视网	10,399,479	625,840,646.22	7.27
4	300367	东方网力	7,908,580	551,228,026.00	6.41
5	300271	华宇软件	10,396,290	493,615,849.20	5.74
6	300332	天壕环境	15,999,622	390,390,776.80	4.54
7	300451	创业软件	1,717,795	300,957,684.00	3.50
8	300431	暴风科技	2,111,866	220,922,302.26	2.57
9	002642	荣之联	4,300,000	216,102,290.00	2.51
10	300363	博腾股份	7,400,377	200,772,228.01	2.33
11	300379	东方通	1,500,000	184,035,000.00	2.14
12	002488	金固股份	5,599,788	162,393,852.00	1.89
13	300182	捷成股份	6,486,395	155,673,480.00	1.81
14	300005	探路者	6,099,897	139,687,641.30	1.62
15	300465	高伟达	1,600,000	139,216,000.00	1.62
16	300287	飞利信	7,299,912	132,128,407.20	1.54
17	002596	海南瑞泽	2,948,471	128,995,606.25	1.50
18	300038	梅泰诺	1,999,666	115,220,754.92	1.34
19	300331	苏大维格	3,812,912	102,224,170.72	1.19
20	300166	东方国信	3,152,464	100,973,421.92	1.17
21	600745	中茵股份	2,399,956	98,350,196.88	1.14
22	002023	海特高新	4,999,813	91,696,570.42	1.07
23	300144	宋城演艺	3,199,955	90,558,726.50	1.05
24	300456	耐威科技	757,551	82,542,756.96	0.96
25	300383	光环新网	1,400,000	77,994,000.00	0.91
26	600703	三安光电	3,199,790	77,690,901.20	0.90
27	300148	天舟文化	3,508,604	75,470,072.04	0.88
28	002522	浙江众成	3,999,883	74,117,831.99	0.86
29	300078	思创医惠	1,299,945	63,437,316.00	0.74
30	300257	开山股份	2,041,348	62,975,585.80	0.73
31	002343	禾欣股份	900,000	54,630,000.00	0.63
32	002127	新民科技	2,626,023	49,159,150.56	0.57
33	300202	聚龙股份	1,499,930	48,282,746.70	0.56
34	002364	中恒电气	1,699,796	47,951,245.16	0.56
35	600487	亨通光电	2,999,903	47,818,453.82	0.56
36	002657	中科金财	500,000	39,995,000.00	0.46
37	300215	电科院	1,999,962	39,599,247.60	0.46
38	601515	东风股份	1,650,547	27,366,069.26	0.32
39	000802	北京文化	150,000	5,082,000.00	0.06

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300104	乐视网	1,152,307,826.57	13.39
2	300267	尔康制药	749,160,744.54	8.71
3	300367	东方网力	674,733,271.09	7.84
4	300324	旋极信息	667,227,139.79	7.75
5	300271	华宇软件	616,631,201.07	7.17
6	002642	荣之联	468,435,222.11	5.44
7	300332	天壕环境	442,887,388.61	5.15
8	300059	东方财富	436,059,762.22	5.07
9	300451	创业软件	354,921,271.11	4.12
10	300005	探路者	305,291,605.16	3.55
11	300392	腾信股份	299,585,382.16	3.48
12	300166	东方国信	273,487,779.19	3.18
13	002364	中恒电气	253,485,336.92	2.95
14	300339	润和软件	246,522,498.38	2.86
15	300038	梅泰诺	242,620,808.98	2.82
16	600570	恒生电子	222,219,251.00	2.58
17	300075	数字政通	218,759,442.16	2.54
18	300363	博腾股份	215,017,327.46	2.50
19	002273	水晶光电	195,504,879.24	2.27
20	300379	东方通	189,842,138.38	2.21
21	300257	开山股份	187,891,658.00	2.18
22	300418	昆仑万维	185,914,322.10	2.16
23	300287	飞利信	182,533,011.69	2.12
24	002230	科大讯飞	180,480,953.25	2.10
25	600571	信雅达	175,724,685.62	2.04
26	600703	三安光电	175,396,348.29	2.04
27	300182	捷成股份	172,171,138.95	2.00



**8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300059	东方财富	401,315,556.45	4.66
2	300418	昆仑万维	393,027,405.96	4.57
3	300104	乐视网	341,222,812.38	3.97
4	300392	腾信股份	307,481,060.50	3.57
5	300339	润和软件	205,298,850.49	2.39
6	300364	中文在线	199,188,186.38	2.31
7	002364	中恒电气	182,070,881.59	2.12
8	002642	荣之联	180,890,851.01	2.10
9	300458	全志科技	173,523,961.87	2.02
10	300257	开山股份	170,287,969.13	1.98
11	603598	引力传媒	164,358,234.91	1.91
12	002230	科大讯飞	157,498,239.51	1.83
13	300166	东方国信	149,264,219.49	1.73
14	300352	北信源	146,209,930.26	1.70
15	300038	梅泰诺	134,657,581.12	1.56
16	600570	恒生电子	126,077,266.61	1.47
17	300005	探路者	125,199,902.50	1.45
18	000555	神州信息	124,857,405.46	1.45
19	300017	网宿科技	124,035,541.28	1.44
20	002273	水晶光电	123,206,471.59	1.43

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。

**8.4.3 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	14,241,736,803.14
卖出股票收入（成交）总额	6,919,715,014.73

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。

**8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

本基金本期末未持有债券。

## **8.6 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**

本基金本期末未持有债券。

## **8.7 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**

本基金本期末未持有资产支持证券。

## **8.8 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**

本基金本期末未持有贵金属投资。

## **8.9 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**

本基金本期末未持有权证。

## **8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本期末本基金未持有股指期货。

### **8.10.2 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。

## **8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **8.11.1 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。

### **8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本期末本基金未持有国债期货。

### **8.11.3 本期国债期货投资评价**

本期末本基金未持有国债期货。

## **8.12 投资组合报告附注**

### **8.12.1**

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。

### **8.12.2**

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。

**8.12.3 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	8,919,277.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	667,290.50
5	应收申购款	19,660,415.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,246,983.24

**8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002642	荣之联	82,550,060.00	0.96	非公开发行
2	300104	乐视网	625,840,646.22	7.27	重大事项停牌
3	300324	旋极信息	803,747,857.00	9.34	重大事项停牌
4	300431	暴风科技	220,922,302.26	2.57	重大事项停牌

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 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
115,025	71,440.75	45,817,907.66	0.56%	8,171,653,817.44	99.44%

**9.2 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	3,973,703.22	0.0484%

**9.3 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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2015年5月14日）基金份额总额	12,602,264,773.92
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	4,246,242,000.73
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	8,631,035,049.55
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	8,217,471,725.10

**§ 11 重大事件揭示****11.1 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。

**11.2 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**

经本公司董事会审议通过，本公司副总经理王金晖同志于2015年6月3日离任。

**11.3 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。

## 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

## 11.5 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，报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币捌万元整，目前该会计师事务所已连续为本基金提供审计服务一个会计年度。

## 11.6 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。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 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	
华泰证券股份有限公司		29,710,627,762.97	46.07%	8,895,184.84	47.19%	-
民生证券股份有限公司		28,758,987,479.84	41.55%	8,045,316.30	42.68%	-
瑞银证券有限责任公司		22,609,416,229.55	12.38%	1,908,264.78	10.12%	-
华创证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 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
华泰证券股份有限公司	-	-	15,000,000,000.00	100.00%	-	-
民生证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
瑞银证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	中邮信息产业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	2015年5月5日
2	中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同（摘要）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年5月5日
3	中邮信息产业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	2015年5月5日
4	中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金招募说明书	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年5月5日
5	中邮信息产业灵活配置混合型证	中国证券报、上海证	2015年5月5日

	券投资基金份额发售公告	券报、证券时报、证 券日报	
6	中邮创业基金管理有限公司关于 增加中信银行股份有限公司为代 销机构的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 5 月 8 日
7	关于中邮基金旗下产品“中邮信 息产业灵活配置混合型证券投资 基金”在官方微信平台费率优惠 活动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 5 月 9 日
8	关于中邮基金旗下产品“中邮信 息产业灵活配置混合型证券投资 基金”参与代销机构费率优惠活 动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 5 月 9 日
9	关于中邮基金旗下产品“中邮信 息产业灵活配置混合型证券投资 基金”在京东旗舰店费率优惠活 动的公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 5 月 9 日
10	关于中邮信息产业灵活配置混合 型证券投资基金提前结束募集的 公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 5 月 12 日
11	中邮信息产业灵活配置混合型证 券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 5 月 15 日
12	中邮信息产业灵活配置混合型证 券投资基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 5 月 27 日
13	中邮信息产业灵活配置混合型证 券投资基金开放日常申购、赎回 及定期定额投资业务公告	中国证券报、上海证 券报、证券时报、证 券日报	2015 年 6 月 13 日

14	中邮创业基金管理有限公司关于增加东亚银行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	2015 年 6 月 13 日
15	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加光大证券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	2015 年 6 月 13 日
16	关于实施特定投资群体通过直销中心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	2015 年 6 月 13 日
17	关于中邮创业基金管理有限公司旗下基金参加工商银行、兴业银行、交通银行、平安银行、农业银行网上交易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	2015 年 6 月 13 日
18	中邮创业基金管理有限公司参加代销机构网上申购基金费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 6 月 13 日
19	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加东亚银行（中国）有限公司基金定投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	2015 年 6 月 25 日
20	关于中邮创业基金管理有限公司旗下部分基金参加交通银行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	2015 年 6 月 29 日
21	中邮创业基金管理有限公司旗下基金 2015 年 6 月 30 日资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 7 月 1 日
22	中邮创业基金管理有限公司关于在京东店铺开展 0 折费率优惠活	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2015 年 7 月 8 日



	动的公告	券日报	
23	中邮创业基金管理有限公司关于参加天天基金网费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年8月25日
24	中邮创业基金管理有限公司关于参加浙江同花顺基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年8月25日
25	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加平安证券有限责任公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年9月22日
26	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加上海好买基金销售有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年10月17日
27	中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金 2015 年第 3 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年10月24日
28	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金定投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	2015年12月1日
29	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加上海长量基金销售投资顾问有限公司费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015年12月1日
30	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京君德汇富投资咨询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	2015年12月1日
31	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加京东商城基金直销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	2015年12月4日

32	中邮创业基金管理股份有限公司 关于旗下基金获配非公开发行股票的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 12 月 10 日
33	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加宏信证券有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 12 月 16 日
34	中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书 2015 年 1 号	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2015 年 12 月 31 日

## § 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信息产业灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮信息产业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  
2016 年 3 月 26 日