

中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金 2016 年半年度报告

2016 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：2016 年 8 月 25 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 2016 年 8 月 24 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 2016 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	5
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.....	8
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	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
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）	15
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	33
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	34
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
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.....	36
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	36
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	37

7.12 投资组合报告附注.....	37
§8 基金份额持有人信息.....	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	38
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	错误！未定义书签。
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	38
8.4 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.....	38
§9 开放式基金份额变动.....	38
§10 重大事件揭示.....	39
10.1 基金份额持有人大会决议.....	39
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.....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	39
10.4 基金投资策略的改变.....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	39
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.....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	39
10.8 其他重大事件.....	40
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	错误！未定义书签。
§12 备查文件目录.....	45
12.1 备查文件目录.....	45
12.2 存放地点.....	45
12.3 查阅方式.....	45

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮创新优势混合
基金主代码	001275
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 23 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	1,095,538,979.11 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，充分挖掘和利用中国科技进步和创新过程中带来的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<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，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。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金主要投资于具有创新优势的上市公司。具有创新优势的公司通过提供差异性的甚至具有颠覆性的产品或服务为公司创造出广阔的蓝海市场，或者通过工艺流程的改进甚至变革明显提升性能或降低成本从而为公司带来优势的市场份额或者明显高于行业的盈利能力。因而，在市场表现中，能够为投资者带来较高的回报，这类企业是本基金重点投资对象。</p> <p>1、创新优势企业的筛选</p> <p>本基金所指的创新优势，包括技术创新优势和商业创新优势两种类型。技术创新优势是指企业创造和应用新知识和新技术，采用新工艺或新的生产方式，开发生产新产品，提供新的服务，提高产品质量、或降低产品成本，占据市场并实现市场价值的优势。商业创新优势是指企业通过商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等方面的创新，使企业的盈利能力和竞争实力得到持续改善的优势。</p>

	<p>(1) 技术创新优势</p> <p>本基金将重点研究企业技术创新的竞争力及其市场前景，并对企业研发管理体系、研发规划、人才吸引力及激励制度进行分析</p> <p>1) 技术创新的竞争力分析：通过专家访谈、竞争对手调研、产业链上下游公司交流等手段，有效判断企业技术和产品创新的先进程度，被模仿的难易程度，从而有效判断企业技术创新优势的可持续性。</p> <p>2) 研发投入分析：公司为保证技术领先地位，应确保研发资金的规模和持续性；同时，确保人力资源投入与经费投入水平适当增长。对企业研发投入的评判，所采用的主要量化指标包括：研究开发费用占销售收入的比重，近三年研究开发费用的规模以及增长情况等。</p> <p>3) 研发能力分析：本基金从企业专利申请量、发明专利比重、拥有专利数量、专有技术、新产品推出周期等方面对企业的研发能力进行分析。</p> <p>(2) 商业创新优势</p> <p>本基金认为商业创新活动是一种节约人力的和资本的活动，即以更少的人力和资本投入取得更大的增长。本基金将辨识企业是否在商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等商业行为方面有创新优势。本基金将重点分析商业创新优势的持续性，分析企业的商业创新优势在商业模式的可复制性，促进销售收入增长、市场份额增长、成本降低等方面的持续性。</p> <p>对于传统产业的上市公司，如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新，具有较大潜在发展前景和经济效应，也属于本基金的主要投资范围。</p> <p>2、创新管理能力分析</p> <p>对具有创新优势的某些企业而言，尽管不断有创新活动，却不能产生利润，究其原因，主要在于创新管理能力欠缺，无法实现创新成果的商业价值。因此，本基金将对企业的创新管理能力进行分析，比如：企业的技术前瞻能力、企业的技术管理能力（是否具有科学规范的研发管理体系、激励和人才培养机制）、企业创新与发展战略的匹配能力、企业的资源整合能力以及企业的市场开拓能力等；通过市场份额增长、成本降低等各项具体指标对企业的创新管理能力进行评价。</p> <p>3、创新优势企业产业链</p> <p>本基金认为除上文所述的创新优势企业之外，还可以将产业链中可以受益于创新优势企业成长和发展的上下游优秀的上市公司也纳入本基金股票库。这类上市公司虽然分布在创新优势企业的产业链上下游，但他</p>
--	---

们将受益于为创新优势企业提供原材料或者应用创新优势企业的新技术新模式获得利润。

（四）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。

（五）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。

（六）股指期货投资策略

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。

（七）中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。与传统的信用债相比，中小企业私募债具有高风险和高收益的显著特点。

目前市场上正在或即将发行的中小企业私募债的期限通常都在三年以下，久期风险较低；其风险点主要集中在信用和流通性。由于发行规模都比较小，这在一定程度上决定了其二级市场的流通性有限，换手率不高，所以本基金在涉及中小企业私募债投资时，会将重点放在一级市场，在有效规避信用风险的同时获取信用利差大的个券，并持有到期。

对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析；会倾向于大券商承销的有上市诉求的企业。鉴于其信用风险大，流通性弱，本基金将严格防范风险。所有中小企业私

	<p>募债在投资前都必须实地调研，研究报告由研究员双人会签，并对投资比例有严格控制。重大投资决策需上报投资委员会。</p> <p>（八）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</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>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	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 F9
邮政编码		100082	100031
法定代表人		吴涛	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、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	http://www.postfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所。

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(2016年1月1日 - 2016年6月30日)
本期已实现收益	-218,345,513.06
本期利润	-122,637,946.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1133
本期加权平均净值利润率	-10.26%
本期基金份额净值增长率	-13.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配利润	12,361,348.58
期末可供分配基金份额利润	0.0113
期末基金资产净值	1,318,724,012.86
期末基金份额净值	1.204
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)
基金份额累计净值增长率	20.40%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当前发生额）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

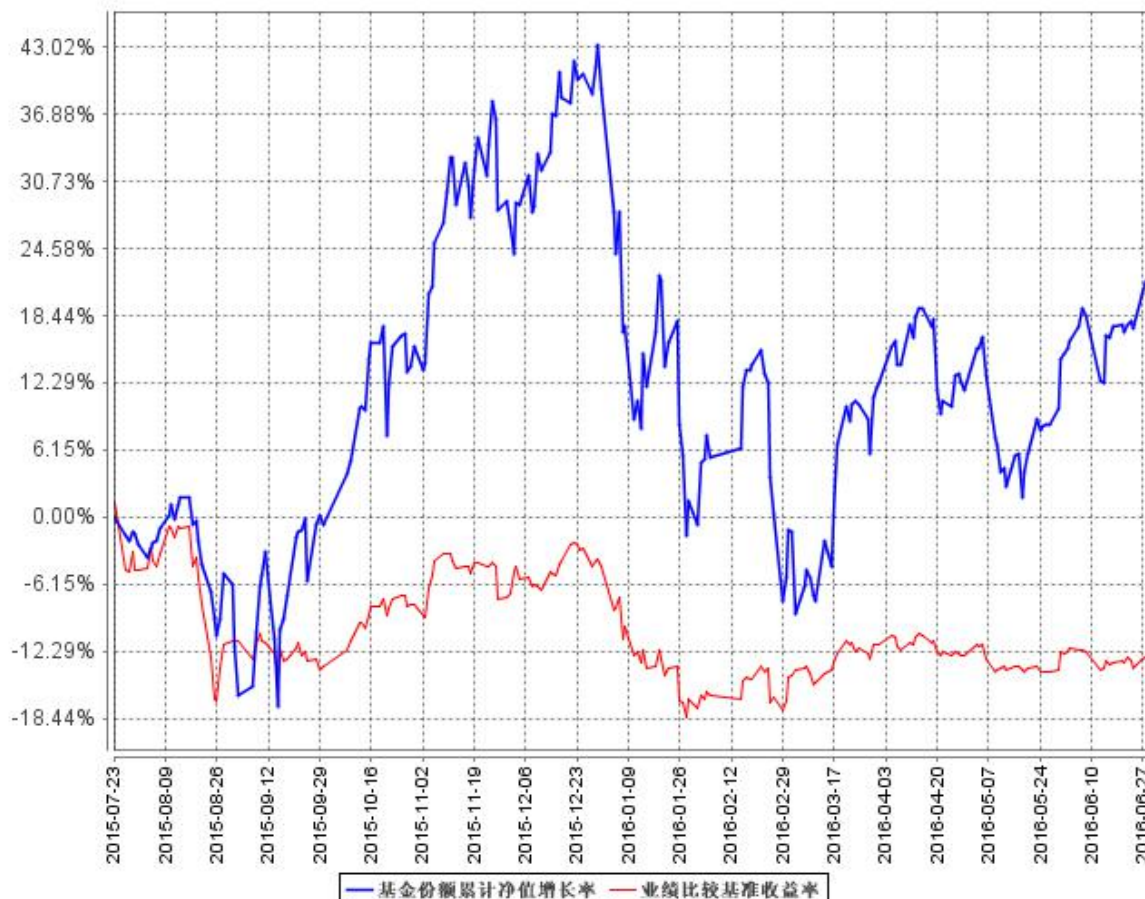
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.15%	1.70%	-0.15%	0.59%	5.30%	1.11%
过去三个月	7.50%	2.01%	-0.86%	0.61%	8.36%	1.40%
过去六个月	-13.57%	3.16%	-8.40%	1.10%	-5.17%	2.06%
自基金合同生效起至今	20.40%	3.04%	-12.45%	1.30%	32.85%	1.74%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日。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%

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：本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日。按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司成立于 2006 年 5 月 8 日，截至 2016 年 6 月 30 日，本公司共管理 27 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、中邮风格轮动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、中邮低碳经济灵活配置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		
邓立新	基金经理	2015 年 7 月 22 日	-	24 年	邓立新先生：曾任中国工商银行北京珠市口办事处交换员、中国工商银行北京信托投资公司白塔寺证券营业部副经理兼团支部书记、华夏证券有限公司北京三里河营业部交易部经理、首创证券有限责任

					公司投资部职员、中邮创业基金管理股份有限公司基金交易部总经理、投资研究部投资部总经理，现任公司投资总监兼邓立新投资工作室总负责人、中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮创新优势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、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
许忠海	基金经理	2015 年 7 月 22 日	-	7 年	理学硕士，曾任职于 Brady 中国区研发中心、方正证券股份有限公司，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兼行业研究员。现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
刘田	基金经理	2015 年 12 月 24 日	-	2 年	硕士研究生，曾任北京凯盛旭日电子科技有限公司销售工程师、中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员，现任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兼中邮创新优势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

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

报告期内，我们继续秉承“重点布局新经济，灵活参与主题轮动”的投资策略。我们认为市场处于底部区间，短期来看并无显著增量资金入市，但是市场的整体风险可控；因此我们认为市场依然以存量博弈和主题轮动为主。整体上看，2016 年上半年，我们继续采用相对灵活的仓位控制策略，在积极布局长期看好的“新经济”的同时也使用部分仓位参与主题型投资。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.204 元，累计净值 1.204 元。本报告期份额净值增长率为-13.57%，同期业绩比较基准增长率为-8.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期来看，市场处于底部区域，外围事件性负面影响对国内市场的影响愈发弱化，市场风险偏好缓慢回升；从中长期来看“松货币宽财政”的大环境将支撑资产价格持续上行，监管层有效应对股灾、积极构建开放有序金融市场的诸多举措将有利于市场的长期健康发展，长期市场依然向好。

在转型调结构的过程中，创新依然是驱动经济增长最主要的动力。我们认为，在通胀风险和汇率风险可控的基础上，转型依然是经济自身和资本市场的最强音。“新经济”对“旧经济”的替代将呈现出持续化、立体化、全面化的趋势。我们预计，无论是政策引导下的云计算、大数据、网络安全、高端制造等领域的结构性弯道超车，还是经济内生催化下在体育、文化、健康等新兴消费领域迸发出的成长性机会，都会成为市场持续关注的热点和主题。我们认为未来市场格局会是“慢牛震荡+主题轮动+新经济愈发向好”的特点。

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，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—中邮创业基金管理股份有限公司 2016 年 01 月 01 日至 2016 年 06 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合规守信、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：中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	138,371,832.97	135,023,053.60
结算备付金		3,572,406.47	3,300,840.49
存出保证金		881,556.21	836,396.64
交易性金融资产	6.4.7.2	1,212,110,584.67	945,607,647.37
其中：股票投资		1,212,110,584.67	945,607,647.37
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	43,801.22	52,909.69
应收股利		-	-
应收申购款		12,456,176.27	32,311,767.42
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,367,436,357.81	1,117,132,615.21
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015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		17,356,375.34	38,957,193.32
应付赎回款		27,622,050.03	17,089,542.41
应付管理人报酬		1,713,161.15	1,081,568.21
应付托管费		285,526.85	180,261.38
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,314,634.21	1,713,202.45
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	420,597.37	185,732.57
负债合计		48,712,344.95	59,207,500.34
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,095,538,979.11	759,554,799.11
未分配利润	6.4.7.10	223,185,033.75	298,370,315.76
所有者权益合计		1,318,724,012.86	1,057,925,114.87
负债和所有者权益总计		1,367,436,357.81	1,117,132,615.21

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日。报告截止日 2016 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.204 元，基金份额总额 1,095,538,979.11 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
一、收入		-107,212,181.46
1.利息收入		1,000,137.27
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,000,137.27
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		-
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-208,788,888.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-211,662,481.94
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		-
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	2,873,593.04
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	95,707,566.25
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	4,869,003.92
减：二、费用		15,425,765.35
1. 管理人报酬		8,899,594.80
2. 托管费		1,483,265.79
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.19	4,769,837.50
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	6.4.7.20	273,067.26
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-122,637,946.81
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-122,637,946.81

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	759,554,799.11	298,370,315.76	1,057,925,114.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-122,637,946.81	-122,637,946.81
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	335,984,180.00	47,452,664.80	383,436,844.80

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	1,158,617,999.11	154,592,037.82	1,313,210,036.93
2.基金赎回款	-822,633,819.11	-107,139,373.02	-929,773,192.13
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)	1,095,538,979.11	223,185,033.75	1,318,724,012.86

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度可比期间数据。

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：

_____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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可（2015）682 号《关于核准中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2015 年 7 月 23 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 807,996,396.11 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2015)第 110ZC0324 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《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（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。基金的投资组合比例为：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%。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）和中国证券业协会 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和所有者权益（基金净值）变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.4.1 差错更正的说明

无。

6.4.5 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。证券投资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税。

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。

6.4.6 重要财务报表项目的说明

6.4.6.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日
活期存款	138,371,832.97
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	138,371,832.97

6.4.6.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,024,419,306.28	1,212,110,584.67	187,691,278.39
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	1,024,419,306.28	1,212,110,584.67	187,691,278.39

6.4.6.3 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。

6.4.6.4 买入返售金融资产**6.4.6.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.6.4.2 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。

6.4.6.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应收活期存款利息	41,994.48
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	1,446.84
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	2.87
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	357.03
合计	43,801.22

6.4.6.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.6.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,314,634.21
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,314,634.21

6.4.6.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	46,939.41

预提费用	373,657.96
合计	420,597.37

6.4.6.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	759,554,799.11	759,554,799.11
本期申购	1,158,617,999.11	1,158,617,999.11
本期赎回(以“-”号填列)	-822,633,819.11	-822,633,819.11
本期末	1,095,538,979.11	1,095,538,979.11

6.4.6.10 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	158,383,622.65	139,986,693.11	298,370,315.76
本期利润	-218,345,513.06	95,707,566.25	-122,637,946.81
本期基金份额交易产生的变动数	72,323,238.99	-24,870,574.19	47,452,664.80
其中：基金申购款	145,578,178.11	9,013,859.71	154,592,037.82
基金赎回款	-73,254,939.12	-33,884,433.90	-107,139,373.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,361,348.58	210,823,685.17	223,185,033.75

6.4.6.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
	活期存款利息收入
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	28,909.93
其他	10,702.07
合计	1,000,137.27

6.4.6.12 股票投资收益**6.4.6.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,440,692,069.53
减：卖出股票成本总额	1,652,354,551.47
买卖股票差价收入	-211,662,481.94

6.4.6.13 债券投资收益**6.4.6.13.1 债券投资收益项目构成**

本期本基金无债券投资。

6.4.6.13.2 资产支持证券投资收益

本期本基金无资产支持证券投资。

6.4.6.14 贵金属投资收益

本期本基金无贵金属投资。

6.4.6.15 衍生工具收益

本期本基金无衍生工具收益。

6.4.6.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,873,593.04
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,873,593.04

6.4.6.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	95,707,566.25
——股票投资	95,707,566.25
——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	95,707,566.25

6.4.6.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
基金赎回费收入	4,869,003.92
合计	4,869,003.92

注：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财产；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%计入基金财产；对持续持有期长于93日（含93日）但少于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%计入基金财产；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%计入基金财产。其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

6.4.6.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
交易所市场交易费用	4,769,837.50
银行间市场交易费用	-
合计	4,769,837.50

6.4.6.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	198,904.16
其他	29,409.30

合计	273,067.26
----	------------

6.4.7 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.7.1 或有事项

本报告期内，本基金不存在或有事项。

6.4.7.2 资产负债表日后事项

截止 2016 年 8 月 24 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

6.4.8 关联方关系

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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
中国邮政储蓄银行有限责任公司	基金管理人股东控股的公司、基金代销机构

6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本期本基金未通过关联方交易单元进行交易；本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度可比期间数据。

6.4.9.1 关联方报酬

6.4.9.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,899,594.80
其中：支付销售机构的客户维护费	5,798,306.47

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，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：

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

本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度可比期间数据。

6.4.9.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日	
	当期发生的基金应支付的托管费	1,483,265.79

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：

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

本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度可比期间数据。

6.4.9.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本期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；本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度可比期间数据。

6.4.9.3 各关联方投资本基金的情况**6.4.9.3.1 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期初持有的基金份额	1,686,915.94
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	1,686,915.94	
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.15%	

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度可比期间数据。

6.4.9.3.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.9.4 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	138,371,832.97	960,525.27

注：本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度比较数据。

6.4.9.5 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本期本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券；本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日，因此无上年度比较数据。

6.4.10 利润分配情况

本期本基金未实施利润分配。

6.4.11 期末（2016 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.11.1 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证券。

6.4.11.2 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
603703	盛洋科技	2016年6月20日	重大事项	31.44	-	-	4,472,000	100,814,597.14	140,599,680.00	-
300356	光一科技	2016年5月26日	重大事项	53.96	2016年8月10日	44.27	2,459,212	84,333,645.34	132,699,079.52	-
002617	露笑科技	2016年5月9日	重大事项	16.84	-	-	6,120,000	80,370,979.01	103,060,800.00	-
002445	中南文化	2016年6月14日	重大事项	24.65	-	-	3,800,000	76,749,398.07	93,670,000.00	-
300061	康耐特	2016年5月5日	重大事项	28.82	2016年7月21日	31.56	2,060,000	49,153,166.83	59,369,200.00	-
300353	东土科技	2016年6月23日	重大事项	22.09	-	-	900,000	18,118,207.81	19,881,000.00	-
300332	天壕环境	2016年4月11日	重大事项	9.01	2016年7月29日	9.91	2,200,000	20,564,117.28	19,822,000.00	-
600146	商赢环球	2016年6月15日	重大事项	26.46	-	-	100,000	2,732,246.22	2,646,000.00	-

注：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，上述（603703）盛洋科技、（300356）光一科技、（002617）路笑科技、（002445）中南文化、（300061）康耐特、（300332）天壕环境、（600146）商赢环球均按“指数收益法”进行估值。

6.4.11.3 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。

6.4.12 金融工具风险及管理

6.4.12.1 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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 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。

6.4.12.4 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。

6.4.12.4.1 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。

6.4.12.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年6月30日	1年以内	5年以上	不计息	合计
资产				
银行存款	138,371,832.97	-	-	138,371,832.97
结算备付金	3,572,406.47	-	-	3,572,406.47
存出保证金	881,556.21	-	-	881,556.21
交易性金融资产	-	-	1,212,110,584.67	1,212,110,584.67
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	43,801.22	43,801.22
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	12,456,176.27	12,456,176.27
其他资产	-	-	-	-
资产总计	142,825,795.65	-	1,224,610,562.16	1,367,436,357.81
负债				
应付证券清算款	-	-	17,356,375.34	17,356,375.34

应付赎回款	-	-	27,622,050.03	27,622,050.03
应付管理人报酬	-	-	1,713,161.15	1,713,161.15
应付托管费	-	-	285,526.85	285,526.85
应付交易费用	-	-	1,314,634.21	1,314,634.21
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	420,597.37	420,597.37
负债总计	-	-	48,712,344.95	48,712,344.95
利率敏感度缺口	142,825,795.65	-	1,175,898,217.21	1,318,724,012.86
上年度末 2015年12月31日	1年以内	5年以上	不计息	合计
资产				
银行存款	135,023,053.60	-	-	135,023,053.60
结算备付金	3,300,840.49	-	-	3,300,840.49
存出保证金	836,396.64	-	-	836,396.64
交易性金融资产	-	-	945,607,647.37	945,607,647.37
衍生金融资产	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-
应收利息	-	-	52,909.69	52,909.69
应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	32,311,767.42	32,311,767.42
其他资产	-	-	-	-
资产总计	139,160,290.73	-	977,972,324.48	1,117,132,615.21
负债				
应付证券清算款	-	-	38,957,193.32	38,957,193.32
应付赎回款	-	-	17,089,542.41	17,089,542.41
应付管理人报酬	-	-	1,081,568.21	1,081,568.21
应付托管费	-	-	180,261.38	180,261.38
应付交易费用	-	-	1,713,202.45	1,713,202.45
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	185,732.57	185,732.57
负债总计	-	-	59,207,500.34	59,207,500.34
利率敏感度缺口	139,160,290.73	-	918,764,824.14	1,057,925,114.87

6.4.12.4.1.2 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。

6.4.12.4.2 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 2016 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.12.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016 年 6 月 30 日		上年度末 2015 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	1,212,110,584.67	91.92	945,607,647.37	89.38
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	1,212,110,584.67	91.92	945,607,647.37	89.38

6.4.12.4.2.2 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（2016 年 6 月 30 日）	上年度末（2015 年 12 月 31 日）
	基金净资产变动	28,978,689.89	11,263,886.79
	基金净资产变动	-28,978,689.89	-11,263,886.79

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 2016 年 6 月 30 日十年期国债收益率 2.84%，利用 2016 年 1 月 4 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 2.39。

6.4.13 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	1,212,110,584.67	88.64
	其中：股票	1,212,110,584.67	88.64
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	141,944,239.44	10.38
7	其他各项资产	13,381,533.70	0.98
8	合计	1,367,436,357.81	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	917,881,702.65	69.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,822,000.00	1.50
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	48,913,565.52	3.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,805,000.00	0.74
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	51,697,000.00	3.92
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	163,991,316.50	12.44
S	综合	-	-
	合计	1,212,110,584.67	91.92

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沪港通投资股票投资组合

本报告期末本基金未投资沪港通股票。

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	603703	盛洋科技	4,472,000	140,599,680.00	10.66

2	300356	光一科技	2,459,212	132,699,079.52	10.06
3	300456	耐威科技	1,850,000	125,337,500.00	9.50
4	002617	露笑科技	6,120,000	103,060,800.00	7.82
5	002445	中南文化	3,800,000	93,670,000.00	7.10
6	300317	珈伟股份	2,700,503	89,116,599.00	6.76
7	002699	美盛文化	2,550,000	85,144,500.00	6.46
8	600136	当代明诚	3,405,910	78,846,816.50	5.98
9	300061	康耐特	2,060,000	59,369,200.00	4.50
10	002427	尤夫股份	2,450,000	49,171,500.00	3.73
11	601021	春秋航空	1,020,308	48,913,565.52	3.71
12	603300	华铁科技	2,600,000	37,232,000.00	2.82
13	300375	鹏翎股份	900,041	24,328,108.23	1.84
14	002687	乔治白	1,911,250	22,915,887.50	1.74
15	603158	腾龙股份	958,344	22,827,754.08	1.73
16	300353	东土科技	900,000	19,881,000.00	1.51
17	300332	天壕环境	2,200,000	19,822,000.00	1.50
18	002227	奥特迅	560,000	18,300,800.00	1.39
19	002188	巴士在线	500,000	14,465,000.00	1.10
20	300007	汉威电子	499,921	13,957,794.32	1.06
21	300183	东软载波	370,000	9,805,000.00	0.74
22	600146	商赢环球	100,000	2,646,000.00	0.20

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	002699	美盛文化	122,535,786.08	11.58
2	600306	*ST 商城	115,188,625.76	10.89
3	603703	盛洋科技	112,671,169.19	10.65
4	300456	耐威科技	95,695,141.48	9.05
5	002642	荣之联	94,368,105.93	8.92
6	002188	巴士在线	86,279,113.44	8.16
7	300356	光一科技	84,333,645.34	7.97
8	002445	中南文化	78,969,051.25	7.46
9	300418	昆仑万维	73,830,201.45	6.98

10	600136	当代明诚	70,064,219.22	6.62
11	300379	东方通	69,466,696.12	6.57
12	603300	华铁科技	68,020,305.79	6.43
13	300317	珈伟股份	63,720,219.20	6.02
14	300061	康耐特	60,916,413.09	5.76
15	002427	尤夫股份	59,328,943.82	5.61
16	002780	三夫户外	59,315,984.16	5.61
17	601021	春秋航空	57,241,417.10	5.41
18	002617	露笑科技	47,876,205.19	4.53
19	002687	乔治白	35,405,737.06	3.35
20	002439	启明星辰	35,362,866.90	3.34
21	300363	博腾股份	26,523,464.91	2.51
22	002316	键桥通讯	24,683,479.90	2.33
23	603158	腾龙股份	22,251,234.22	2.10

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	002642	荣之联	105,372,387.11	9.96
2	002439	启明星辰	91,270,218.88	8.63
3	002188	巴士在线	88,015,581.09	8.32
4	600306	*ST 商城	81,676,556.80	7.72
5	603300	华铁科技	77,304,745.48	7.31
6	002687	乔治白	67,503,017.32	6.38
7	300418	昆仑万维	66,915,045.12	6.33
8	300300	汉鼎宇佑	62,410,241.95	5.90
9	300379	东方通	60,378,143.71	5.71
10	300245	天玑科技	56,720,408.18	5.36
11	300378	鼎捷软件	55,615,942.90	5.26
12	002780	三夫户外	54,330,829.40	5.14
13	300170	汉得信息	52,342,263.74	4.95
14	000977	浪潮信息	51,640,722.28	4.88
15	300253	卫宁健康	47,058,719.41	4.45
16	000558	莱茵体育	44,932,172.42	4.25
17	300213	佳讯飞鸿	43,494,582.32	4.11

18	002699	美盛文化	35,629,581.41	3.37
19	002544	杰赛科技	30,789,999.14	2.91
20	600136	当代明诚	30,447,565.89	2.88
21	300363	博腾股份	30,001,326.93	2.84

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	1,823,149,922.52
卖出股票收入（成交）总额	1,440,692,069.53

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属投资。

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

本报告期末本基金未持有权证。

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

本报告期末本基金未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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	881,556.21
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	43,801.22
5	应收申购款	12,456,176.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,381,533.70

7.12.2 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.3 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	603703	盛洋科技	140,599,680.00	10.66	重大事项
2	300356	光一科技	132,699,079.52	10.06	重大事项
3	002617	露笑科技	103,060,800.00	7.82	重大事项
4	002445	中南文化	93,670,000.00	7.10	重大事项
5	300061	康耐特	59,369,200.00	4.50	重大事项

§ 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
31,821	34,428.18	3,866,995.42	0.35%	1,091,671,983.69	99.65%

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	1,305,878.45	0.1191%

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	54.95
本基金基金经理持有本开放式基金	15.00

注：1、本公司高级管理人员、基金投资和研
究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间为
50-100 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 7 月 23 日）基金份额总额	807,996,396.11
本报告期期初基金份额总额	759,554,799.11
本报告期基金总申购份额	1,158,617,999.11
减：本报告期基金总赎回份额	822,633,819.11
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-

本报告期末基金份额总额	1,095,538,979.11
-------------	------------------

§ 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

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内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	
国信证券股份有限公司	1	2,562,440,414.48	78.51%	2,386,404.75	78.51%	-
中信建投证券股份有限公司	1	701,401,577.57	21.49%	653,215.30	21.49%	-

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参加中国邮政储蓄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	2016年1月4日
2	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加北京君德汇富投资咨询有限公司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	2016年1月7日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加深圳众禄金融控股股份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	2016年1月8日
4	中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金2015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	2016年1月22日
5	关于中邮创业基金管理股份有限	中国证券报、上海证	2016年1月28日

	公司旗下部分基金参加兴业银行股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告	券报、证券时报、证券日报	
6	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海利得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	2016 年 2 月 17 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华泰证券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	2016 年 3 月 4 日
8	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加上海汇付金融服务有限公司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	2016 年 3 月 24 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海汇付金融服务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	2016 年 3 月 24 日
10	中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金 2015 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 26 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	2016 年 3 月 30 日
12	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亚银行（中国）有限公司基金申购及定投费率优惠活动调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 3 月 30 日
13	关于中邮创业基金管理股份有限	中国证券报、上海证	2016 年 4 月 6 日

	公司旗下部分基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	券报、证券时报、证券日报	
14	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	2016 年 4 月 7 日
15	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农业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	2016 年 4 月 13 日
16	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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	2016 年 4 月 14 日
17	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加上海天天基金销售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	2016 年 4 月 14 日
18	中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金 2016 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	2016 年 4 月 21 日
19	中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2016 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016 年 4 月 26 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代销机构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	2016 年 5 月 7 日
21	中邮创业基金管理股份有限公司	中国证券报、上海证	2016 年 5 月 10 日

	关于旗下部分基金增加代销机构并开通定投业务的公告	券报、证券时报、证券日报	
22	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加珠海盈米财富管理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	2016年5月11日
23	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加兴业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	2016年5月14日
24	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加深圳众禄金融控股股份有限公司基金定投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	2016年5月19日
25	中邮创业基金管理股份有限公司基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年5月24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国泰君安证券股份有限公司基金定投活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年6月2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上海陆金所资产管理有限公司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	2016年6月3日
28	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海陆金所资产管理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	2016年6月3日
29	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加华泰证券股份有限公司	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2016年6月15日

	费率优惠的公告	券日报	
30	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信证券股份有限公司和中信证券(山东)有限责任公司基金定投活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年6月18日
31	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加浙江同花顺基金销售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	2016年6月22日
32	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加珠海盈米财富管理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	2016年6月22日
33	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加华融证券股份有限公司基金定投活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年6月24日
34	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亚银行(中国)有限公司基金申购及定投费率优惠活动调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2016年6月30日
35	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	-

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮创新优势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

11.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

11.3 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 8 月 25 日