

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2016 年第 4 季度报告

2016 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：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2017 年 1 月 21 日

§ 1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 01 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 10 月 01 日起至 2016 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中邮上证 380 指数增强 |
| 交易代码 | 590007 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 11 月 22 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 69,362,668.12 份 |
| 投资目标 | 本基金为股票指数增强型基金，以指数化分散投资为主，适度的增强型主动管理为辅，在严格控制跟踪偏离风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，分享中国经济增长的成果。在正常市场情况下，本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 |
| 投资策略 | 本基金为股票指数增强型基金，以上证 380 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动增强，在基本面深入研究与数量化投资技术的结合中，谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收益之间的最佳匹配。 当预期成分股发生调整和成分股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基 |

准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。

本基金的投资策略包括以下几个层面：

1. 资产配置策略

本基金为股票指数增强型基金，采用“被动投资为主，主动增强为辅”的投资策略。为实现有效跟踪并力争超越标的指数的投资目标，在资产类别配置上，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%，其余基金资产可适当投资于债券、权证、货币市场工具、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的相关规定）。

2. 股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制的方法进行组合构建，按照成分股在上证 380 指数成分股权重分散化投资于上证 380 指数成分股；主动投资组合构建主要依据对上市公司宏观和微观的深入研究，优先在上证 380 指数成分股中对行业、个股进行适度超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选上证 380 指数成分股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。

(1) 构建被动投资组合

本基金采用完全复制基准指数的方法，按照个股在基准指数中的权重构建指数化股票投资组合，并根据基准指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到基准指数成分股调整或停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重配置某成分股时，本基金将首选与该成分股行业属性一致、相关性高的其他成分股进行替代；若成分股中缺乏符合要求的替代品种，本基金将在成分股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

(2) 构建增强型投资组合

本基金以指数化分散投资为主，基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性，在严格控制跟踪误差的前提下，辅以适度的增强型主动管理；其目的有二，一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益；二是补偿较高的交易成本及其他费用。增强投资的方法包括：

1) 仓位调整

在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时，基金的股票投资仓位可进行下调，股票资产最低可下调到占基金资产净值的 90%以适度规避市场系统性风险。

2) 基本面优化

基本面优化提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

- 上市公司基本面较好(根据财务指标等判断)，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力。
- 中长期估值水平明显高于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏低。
- 其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股。
- 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成分股。

将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

- 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑。
- 中长期估值水平明显低于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏高。
- 短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调。
- 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

3) 个股优选

本基金将依托于本公司投研团队的研究成果，精选成分股之外的股票作为增强股票库，在合适的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行适量优化配置，获取超额收益。另外，本基金也可以适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发）。

3. 债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将通过对宏观经济形势和宏观经济政策分析，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；通过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；通过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。

4. 股票组合调整策略

本基金为股票指数增强型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、成分股流动性异常、成分股调整及配股、分红、增发等因素变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

(1) 定期调整

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的上证 380 指数对其成分股的调整而进行相应的跟踪调整。根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理在指数成分股调整生效前，分析并确定组合调整策略，并报投资

| | |
|--------|--|
| | <p>决策委员会批准。基金经理通过执行批准后的组合调整策略，尽量减少成分股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。</p> <p>(2) 不定期调整</p> <p>若基金投资组合表现与指数组合表现偏离超过基金管理人确定的预警水平，基金经理将根据市场状况及个股权重偏离状况，制定组合调整策略，降低组合跟踪偏离度。</p> <p>5. 跟踪误差控制策略</p> <p>本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。</p> |
| 业绩比较基准 | <p>本基金业绩比较基准为：上证 380 指数收益率×95% + 银行活期存款利率(税后)×5%。</p> <p>上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中小市值成长性新兴蓝筹股指数，以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时，除剔除上证 180 指数样本股外，还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票，以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司，然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数，选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。上证 380 指数以 2003 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点；指数样本每半年定期调整一次，实施时间分别为每年的 1 月和 7 月的第一个交易日。在两次定期调整之间，若上证 380 指数样本股进入上证 180 指数，该样本立即被调出上证 380 指数，并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。</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时(如基金变更投资比例范围，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，或今后法律法规发生变化，又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等)，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体上刊登公告。</p> |
| 风险收益特征 | <p>本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高</p> |

| | |
|-------|----------------------|
| | 于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。 |
| 基金管理人 | 中邮创业基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国银行股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2016年10月1日—2016年12月31日） |
|-----------------|-----------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 771,997.67 |
| 2. 本期利润 | -374,981.08 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0053 |
| 4. 期末基金资产净值 | 115,721,263.69 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.668 |

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。

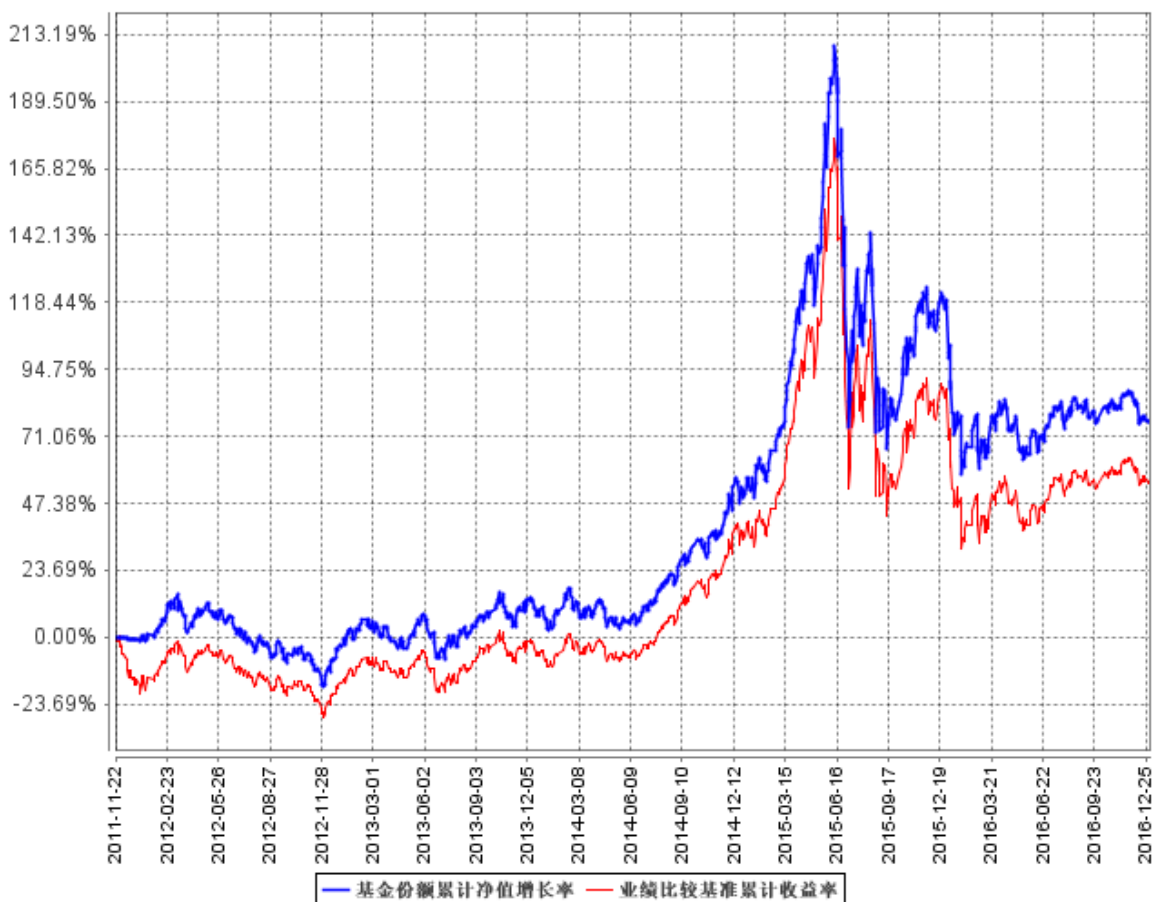
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率 ① | 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 | -0.48% | 0.77% | 0.64% | 0.80% | -1.12% | -0.03% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



3.3 其他指标

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|------|-------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 俞科进 | 基金经理 | 2015年6月3日 | - | 8年 | 经济学硕士，曾任安徽省池州市殷汇中学教师、中国人寿保险股份有限公司职员、长江证券股份有限公司金融工程分析师、中邮创业基金管理股份有限公司金融工程研究员、中邮核心竞争力灵活配置混合型基金经理 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 理助理、量化投资部员工，现任中邮创业基金管理股份有限公司量化投资部副总经理兼中邮上证 380 指数增强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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究、投资、交易等各方面受到公平对待，确保各基金获得公平交易的机会。

报告期内，本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发生内幕交易的情况；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务、注册登记业务均按规定的程序、规则进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《中邮基金公平交易管理制度》、《中邮基金投资管理制度》、《交易部管理制度》、《交易部申购业务管理细则》等一系列与公平交易相关制度体系，制度的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、监控等投资管理活动相关的各个环节，形成了有效的公平交易执行体系。

公司建立了投资决策委员会领导下的投资决策及授权制度，以科学规范的投资决策体系，采用集中交易管理加强交易执行环节的内部控制，通过工作制度、流程和信息系统控制等手段保证公平交易原则得以实现；在确保各投资组合相对独立性的同时在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；通过信息系统对公平交易行为进行定期分析评估，发现异常情况，要求投资经理做出合理解释，并根据发现情况进一步完善公司相关公平交易制度，避免类似情况再次发生，最后妥善保存分析报告备查。从而确保整个业务环节对公平交易过程和结果控制的有效性。

本报告期内，本基金管理人公平交易制度得到良好的贯彻执行，未发现存在违反公平交易原则的情况。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2016 年四季度以来，在供给侧改革影响下资源类行业价格上涨带动的利润环比改善迹象显现，在经济基本面貌似改善的掩护下，险资年底做净值驱动了“冬季躁动”行情，通过集中配置的方式，成功引导了交易型和趋势型投资者的风险偏好提升并获得了市场的定价权，业绩稳定增长及环比改善的低估值板块受到追捧，推动了上证综指在 9 月底到 11 月底期间出现阶段性上涨。另外 11 月初美国大选特朗普意外当选，全球市场在无法形成合理预期的情况下，将其上台由“黑天鹅”演绎成了对世界政治经济格局过度乐观的预期，短时间内风险偏好急剧反转。随着时间推移，经济增长和通胀预期开始下修，对世界政治经济格局过度乐观的预期也已转变为对中美贸易摩擦升级的担忧，而美国加息预期逐步兑现使得人民币汇率压力倍增，中国央行的降杠杆去泡沫措施导致市场流动性紧缩预期提升，债市先行下跌而后带动股市调整，12 月初股债双杀局面出现。

本基金在做好常规跟踪复制之外，着重利用数量化策略进行增强投资。报告期内行业配置层面参照指数基准并结合量化模型对部分行业及时调整权重配置，增加了低估值板块配置；选股方面，主要以交易性指标为主筛选组合，通过提高交易频率争取达到指数增强效果。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.668 元，累计净值 1.728 元。份额净值增长率为-0.48%，业绩比较基准增长率为 0.64%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警的说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|----|-------|--------------|
|----|----|-------|--------------|

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| 1 | 权益投资 | 108,178,133.12 | 93.05 |
| | 其中：股票 | 108,178,133.12 | 93.05 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 4 | 贵金属投资 | - | - |
| 5 | 金融衍生品投资 | - | - |
| 6 | 买入返售金融资产 | - | - |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 8,050,361.80 | 6.92 |
| 8 | 其他资产 | 25,979.63 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 116,254,474.55 | 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 3,337,193.00 | 2.88 |
| C | 制造业 | 64,993,734.78 | 56.16 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 5,148,643.50 | 4.45 |
| E | 建筑业 | 249,176.55 | 0.22 |
| F | 批发和零售业 | 7,586,420.80 | 6.56 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 4,542,288.84 | 3.93 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 3,302,071.60 | 2.85 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 4,248,539.00 | 3.67 |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 275,900.00 | 0.24 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 575,730.00 | 0.50 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 436,020.00 | 0.38 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 1,275,952.00 | 1.10 |
| S | 综合 | 282,150.00 | 0.24 |
| | 合计 | 96,253,820.07 | 83.18 |

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。

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 采掘业 | - | - |
| C | 制造业 | 8,527,597.89 | 7.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 188,280.00 | 0.16 |
| E | 建筑业 | 1,406,592.00 | 1.22 |
| F | 批发和零售业 | 352,824.00 | 0.30 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 611,177.16 | 0.53 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 498,542.00 | 0.43 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 339,300.00 | 0.29 |
| | 合计 | 11,924,313.05 | 10.30 |

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。

5.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未投资沪港通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 600398 | 海澜之家 | 174,500 | 1,882,855.00 | 1.63 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 2 | 600498 | 烽火通信 | 72,700 | 1,832,767.00 | 1.58 |
| 3 | 600525 | 长园集团 | 118,840 | 1,657,818.00 | 1.43 |
| 4 | 600436 | 片仔癀 | 35,957 | 1,646,471.03 | 1.42 |
| 5 | 600682 | 南京新百 | 43,900 | 1,636,153.00 | 1.41 |
| 6 | 601168 | 西部矿业 | 180,800 | 1,415,664.00 | 1.22 |
| 7 | 601021 | 春秋航空 | 36,866 | 1,354,456.84 | 1.17 |
| 8 | 601238 | 广汽集团 | 57,200 | 1,325,324.00 | 1.15 |
| 9 | 600694 | 大商股份 | 31,400 | 1,253,802.00 | 1.08 |
| 10 | 600673 | 东阳光科 | 169,000 | 1,232,010.00 | 1.06 |

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 600522 | 中天科技 | 226,443 | 2,384,444.79 | 2.06 |
| 2 | 600482 | 中国动力 | 26,100 | 797,094.00 | 0.69 |
| 3 | 600528 | 中铁二局 | 56,800 | 781,568.00 | 0.68 |
| 4 | 600699 | 均胜电子 | 20,000 | 661,800.00 | 0.57 |
| 5 | 600545 | 新疆城建 | 51,400 | 625,024.00 | 0.54 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本报告期末本基金未持有债券。

5.5 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债券投资明细

注：本报告期末本基金未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

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。

5.11.2

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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 3,726.85 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 1,601.08 |
| 5 | 应收申购款 | 20,651.70 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 25,979.63 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 601168 | 西部矿业 | 1,415,664.00 | 1.22 | 重大事项 |
| 2 | 600673 | 东阳光科 | 1,232,010.00 | 1.06 | 重大事项 |

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 71,966,929.35 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,730,566.51 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 5,334,827.74 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 69,362,668.12 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

| | |
|-------------------------|------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 973,172.50 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 973,172.50 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例(%) | 1.40 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- (二) 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- (三) 《中邮创业基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》；
- (四) 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- (五) 《法律意见书》；
- (六) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (七) 基金托管人业务资格批件、营业执照；

8.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

8.3 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
2017 年 1 月 21 日