

# 中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2017 年年度报告

2017 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

送出日期：2018 年 3 月 30 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金管理人——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。

基金托管人中国银行股份有限公司（简称：中国银行）根据本基金合同规定，于 2018 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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 2017 年 1 月 1 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.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
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.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
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.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>
6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
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.....	81
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.....	81
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.....	81

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 .....	81
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12 投资组合报告附注 .....	81
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>83</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
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 .....	83
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>84</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>85</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	85
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 .....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
11.4 基金投资策略的改变 .....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	85
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 .....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	85
11.8 其他重大事件 .....	86
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>95</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	95
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	95
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>96</b>
13.1 备查文件目录 .....	96
13.2 存放地点 .....	96
13.3 查阅方式 .....	96

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金
基金简称	中邮上证 380 指数增强
基金主代码	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
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
报告期末基金份额总额	78,995,628.04 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>本基金的投资策略包括以下几个层面：</p> <p>1. 资产配置策略</p> <p>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</p>

	<p>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)。</p> <p>2. 股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>(1)构建被动投资组合</p> <p>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。</p> <p>(2)构建增强型投资组合</p> <p>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：</p> <p>1) 仓位调整</p> <p>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。</p> <p>2) 基本面优化</p> <p>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：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 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。</li> <li>● 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。</li> <li>● 其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股。</li> <li>● 包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成分股。</li> </ul>
--	---

	<p>将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重：</p> <ul style="list-style-type: none"> <li>● 基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑。</li> <li>● 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。</li> <li>● 短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调。</li> <li>● 其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。</li> </ul> <p>3) 个股优选</p> <p>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）。</p> <p>3. 债券投资策略</p> <p>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。</p> <p>4. 股票组合调整策略</p> <p>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。</p> <p>(1) 定期调整</p> <p>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>
--	--

	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。
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	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于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	王永民



	联系电话	010-82295160—157	010-66594896
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		010-58511618	95566
传真		010-82295155	010-66594942
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100013	100818
法定代表人		曹均	陈四清

## 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	<a href="http://www.postfund.com.cn">http://www.postfund.com.cn</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人住所。

## 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）	北京市建国门外大街 22 号塞特广场五层
注册登记机构	中邮创业基金管理股份有限公司	北京市东城区和平里中街乙 16 号

### §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	2017 年	2016 年	2015 年
本期已实现收益	-4,721,892.51	-3,772,624.62	18,775,156.00
本期利润	-1,474,840.65	-15,363,517.98	21,197,460.35
加权平均基金份额本期利润	-0.0034	-0.2128	0.4980
本期加权平均净值利润率	-0.27%	-12.73%	25.35%
本期基金份额净值增长率	-5.03%	-18.59%	43.89%
3.1.2 期末数据和指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
期末可供分配利润	7,255,711.85	43,822,956.16	27,491,139.91
期末可供分配基金份额利润	0.0918	0.6318	0.6825
期末基金资产净值	88,919,288.77	115,721,263.69	82,540,099.99
期末基金份额净值	1.126	1.668	2.049
3.1.3 累计期末指标	2017 年末	2016 年末	2015 年末
基金份额累计净值增长率	67.58%	76.45%	116.76%

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

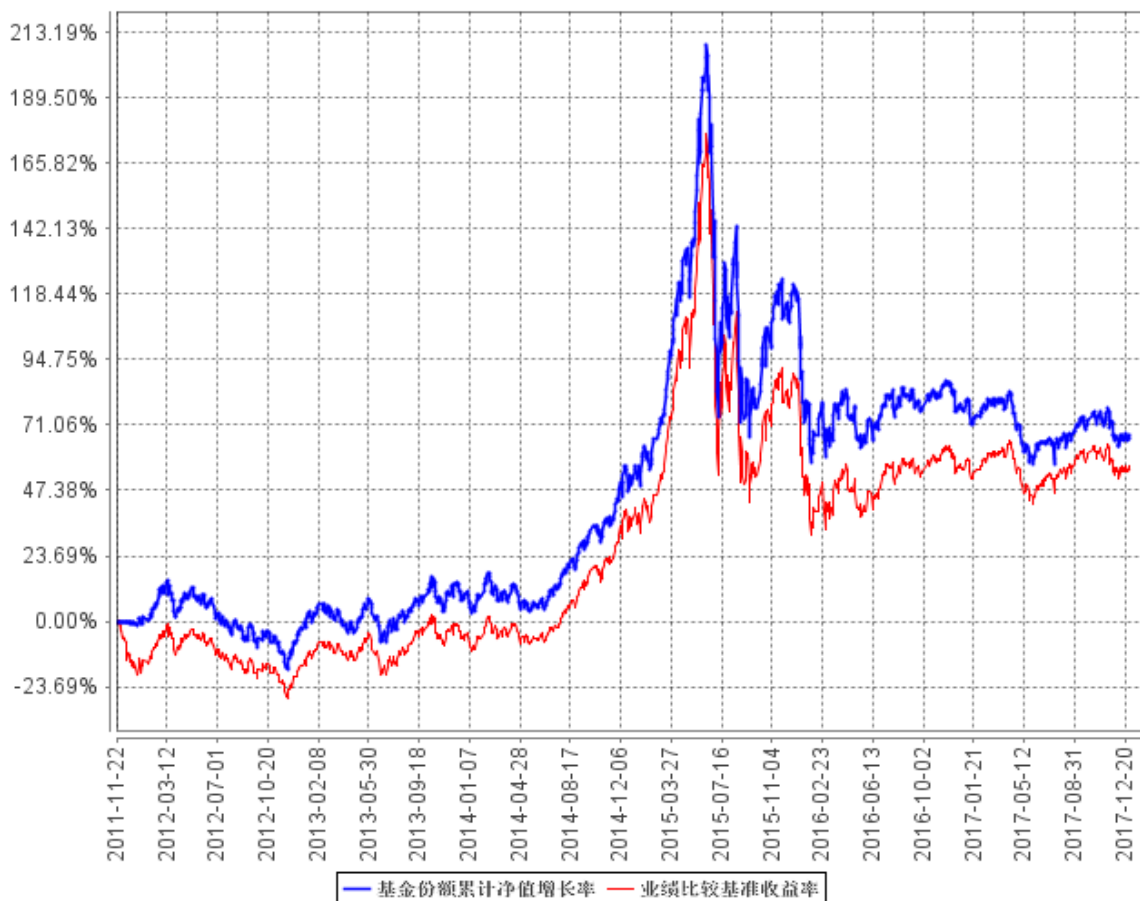
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-3.01%	0.93%	-2.87%	0.93%	-0.14%	0.00%
过去六个月	1.53%	0.92%	2.46%	0.86%	-0.93%	0.06%
过去一年	-5.03%	0.86%	0.59%	0.83%	-5.62%	0.03%
过去三年	11.25%	1.95%	14.72%	2.00%	-3.47%	-0.05%
过去五年	71.82%	1.70%	85.30%	1.73%	-13.48%	-0.03%
自基金合同生效起至今	67.58%	1.62%	56.01%	1.67%	11.57%	-0.05%

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。

本基金业绩比较基准为：上证 380 指数收益率 $\times$ 95% + 银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

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

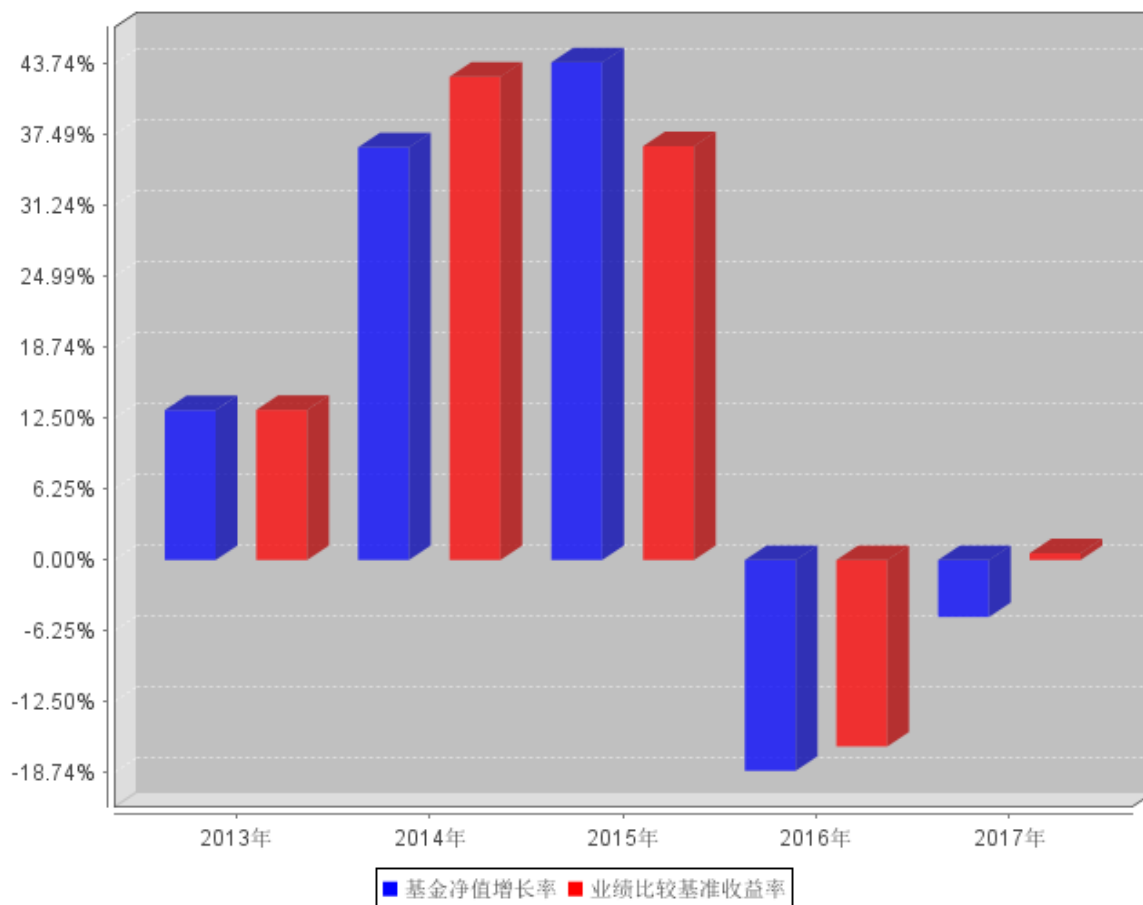
基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起 3 个月内为建仓期，报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

### 3.2.3 过去五年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

过去五年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

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2017	4.500	2,682,712,107.68	46,624,664.22	2,729,336,771.90	
合计	4.500	2,682,712,107.68	46,624,664.22	2,729,336,771.90	

## §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 2017 年 12 月 31 日，本公司共管理 37 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮增力债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮睿利增强债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金。

#### 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		
俞科进	基金经理	2015年6月3日	-	9年	经济学硕士，曾任安徽省池州市殷汇中学教师、中国人保寿险有限公司职员、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

					金基金经理助理、量化投资部员工，现任中邮创业基金管理股份有限公司投资部员工兼中邮上证 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。
--	--	--	--	--	--

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

###### 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

2017 年全年来说，周期性板块的波动较为剧烈。一季度因为持续的供给侧改革带动的资源品价格上涨造成工业经济有一定程度的回暖迹象，周期出现趋势性上涨。进入二季度，各项数据显

示经济明显回暖的预期没有得到证实，补库存暂告一段落，资源品价格受基本面改善预期驱动的部分难以持续，但在供给侧改革影响下，行业龙头继续在竞争格局中相对占优。三季度之后由于年中经济数据部分超预期而供给侧改革力度不减，资源类大宗商品价格再度上涨，周期性板块重回市场热点。到了四季度，在供给侧改革及环保核查维持前期态势的环境下，虽然大宗商品现货价格持续向上，但市场对经济基本面的预期相对前期有所减弱，投资者风险偏好再度下滑，周期板块受压。而全年来看金融及消费行业因为其业绩确定性及估值相对优势一直受到市场的追捧，以上证 50 为代表的大盘蓝筹趋势性上涨。中小创板块由于持续下跌后部分业绩稳定的个股具备了一定的投资价值，其中通信及电子板块在 5G 概念及苹果产业链的带动下表现突出

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；选股方面，对价值、成长等风格因子均衡权重，并在全市场量化选股的基础上结合行业内选股策略进行优化选择，由于报告期内对成长因子的偏重及基金规模的大幅波动造成基金整体表现略逊于业绩基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2017 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 1.126 元，累计净值 1.636 元。份额净值增长率为 -5.03%，业绩比较基准增长率为 0.59%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2018 年中国经济，两会召开之后各项改革继续深化的可能性较大，基建投资受财政政策影响大概率保持平稳态势，货币政策因为美国加息和税改等各方面因素的影响将会继续收紧流动性，金融去杠杆将会继续推进，因此 2018 年市场可能更加关注企业内生增长，以中证 500 为代表的中盘白马成长股可能有相对较好的表现。

#### 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。

##### 4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金根据相关法律法规的规定及《基金合同》的约定，在报告期内分红一次，为 2017 年 6 月 23 日公告的对截至 2017 年 6 月 13 日可分配收益进行分配，权益登记日为 2017 年 6 月 26 日，利润分配总额为 2,729,336,771.9 元；本基金将继续按照相关法律法规的规定、《基金合同》的约定及基金实际运作情况进行利润分配。

#### 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

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 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中邮上证 380 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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(2018)第 110ZA4072 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	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人:
审计意见	<p>我们审计了中邮上证 380 指数增强型证券投资基金(以下简称中邮上证 380 基金)财务报表,包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表,2017 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了中邮上证 380 基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和所有者权益(基金净值)变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>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。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中邮上证 380 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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>
其他信息	<p>中邮上证 380 基金的基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中邮上证 380 基金 2017 年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>中邮上证 380 基金的基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则并参照《证券投资基金会计核算业务指引》的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表</p>

	<p>不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中邮上证 380 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中邮上证 380 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中邮上证 380 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>（3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。</p> <p>同时，根据所获取的审计证据，就可能导致对中邮上证 380 基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中</p>

	<p>邮上证 380 基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容 (包括披露), 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	致同会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	卫俏嫔	吕玉芝
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	2018 年 3 月 28 日	

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	6,397,884.91	7,825,805.66
结算备付金		12,750.30	224,556.14
存出保证金		55,499.50	3,726.85
交易性金融资产	7.4.7.2	82,958,486.83	108,178,133.12
其中：股票投资		82,958,486.83	108,178,133.12
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	1,392.07	1,601.08
应收股利		-	-
应收申购款		28,702.04	20,651.70
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		89,454,715.65	116,254,474.55
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 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		-	700.90
应付赎回款		83,098.49	7,313.79
应付管理人报酬		75,455.88	100,043.21
应付托管费		15,091.18	20,008.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	15,168.73	98,705.88
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	346,612.60	306,438.46
负债合计		535,426.88	533,210.86
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	78,995,628.04	69,362,668.12
未分配利润	7.4.7.10	9,923,660.73	46,358,595.57
所有者权益合计		88,919,288.77	115,721,263.69
负债和所有者权益总计		89,454,715.65	116,254,474.55

注：报告截止日 2017 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.126 元，基金份额总额 78,995,628.04 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		16,934,857.61	-13,208,201.12
1.利息收入		2,065,669.18	73,783.93
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,831,876.13	73,783.93
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		233,793.05	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,224,122.43	-1,737,610.06
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-2,937,460.01	-2,685,968.07
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	-	-
股利收益	7.4.7.16	6,161,582.44	948,358.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,247,051.86	-11,590,893.36
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	8,398,014.14	46,518.37
<b>减：二、费用</b>		18,409,698.26	2,155,316.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,142,669.06	1,204,597.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,028,533.85	240,919.49



3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	11,878,157.30	351,577.38
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	360,338.05	358,222.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,474,840.65	-15,363,517.98
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,474,840.65	-15,363,517.98

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	69,362,668.12	46,358,595.57	115,721,263.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,474,840.65	-1,474,840.65
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）	9,632,959.92	2,694,376,677.71	2,704,009,637.63
其中：1. 基金申购款	6,074,353,276.51	3,356,442,998.16	9,430,796,274.67
2. 基金赎回款	-6,064,720,316.59	-662,066,320.45	-6,726,786,637.04
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）	-	-2,729,336,771.90	-2,729,336,771.90
五、期末所有者权益（基金净值）	78,995,628.04	9,923,660.73	88,919,288.77
项目	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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）	40,277,128.52	42,262,971.47	82,540,099.99



的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

#### 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 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

#### 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。

##### 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) 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 2017 年 9 月 5 日发布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 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，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件，应采用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；如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售的股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，参考《证券投资基金投资流通受限股票估值指引》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) 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。

### (5) 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。

### (6) 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在规定的个工作日内，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在规定的个工作日内，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

按前一日基金资产净值的 1.00% 年费率逐日计提。



## (2) 基金托管费

按前一日基金资产净值的 0.20% 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%，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

2017 年 9 月 4 日，中国证券投资基金业协会发布了《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》，自 2017 年 12 月 28 日起，本基金对持有的流通受限股票的估值方法进行调整。在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售的股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，参考《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》进行估值。

除上述会计估计变更外，本报告期内本基金无其他会计估计变更。

#### 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[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局 关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2015]101 号《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《财政部 国家税务总局 关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部 国家税务总局 关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部 国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2017]56 号《财政部 国家税务总局 关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《财政部 国家税务总局 关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1. 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税；基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

2. 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产（质押式、买断式）；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

基金增值税应税行为包括贷款服务和金融商品转让。采用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。基金管理人运营基金提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（1）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（2）转让 2017 年 12

月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 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 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
活期存款	6,397,884.91	7,825,805.66
定期存款	-	-
其中：存款期限 1-3 个月	-	-
其他存款	-	-
合计：	6,397,884.91	7,825,805.66

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	80,460,404.22	82,958,486.83	2,498,082.61
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	80,460,404.22	82,958,486.83	2,498,082.61
项目	上年度末 2016 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	108,927,102.37	108,178,133.12	-748,969.25
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		108,927,102.37	108,178,133.12	-748,969.25

### 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	1,361.37	1,498.18
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	5.70	101.20
应收债券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	25.00	1.70
合计	1,392.07	1,601.08

### 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 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	15,168.73	98,705.88

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	15,168.73	98,705.88

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	195.57	21.43
预提费用	285,000.00	245,000.00
应付指数使用费	50,000.00	50,000.00
其他	11,417.03	11,417.03
合计	346,612.60	306,438.46

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	69,362,668.12	69,362,668.12
本期申购	6,074,353,276.51	6,074,353,276.51
本期赎回(以“-”号填列)	-6,064,720,316.59	-6,064,720,316.59
- 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	78,995,628.04	78,995,628.04

#### 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
上年度末	43,822,956.16	2,535,639.41	46,358,595.57
本期利润	-4,721,892.51	3,247,051.86	-1,474,840.65
本期基金份额交易产生的变动数	2,697,491,420.10	-3,114,742.39	2,694,376,677.71
其中：基金申购款	3,710,340,693.91	-353,897,695.75	3,356,442,998.16
基金赎回款	-1,012,849,273.81	350,782,953.36	-662,066,320.45
本期已分配利润	-2,729,336,771.90	-	-2,729,336,771.90

本期末	7,255,711.85	2,667,948.88	9,923,660.73
-----	--------------	--------------	--------------

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	1,610,078.75	70,408.96
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	57,113.18	1,776.77
其他	164,684.20	1,598.20
合计	1,831,876.13	73,783.93

#### 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	3,915,823,170.60	100,401,513.73
减：卖出股票成本总额	3,918,760,630.61	103,087,481.80
买卖股票差价收入	-2,937,460.01	-2,685,968.07

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本报告期内及上年度可比期间本基金无债券投资。

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本报告期内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

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无衍生工具投资。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,161,582.44	948,358.01
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,161,582.44	948,358.01

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	3,247,051.86	-11,590,893.36
——股票投资	3,247,051.86	-11,590,893.36
——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	3,247,051.86	-11,590,893.36

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	8,398,014.14	46,518.37
合计	8,398,014.14	46,518.37

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
----	--	---

	日	31 日
交易所市场交易费用	11,878,157.30	351,577.38
银行间市场交易费用	-	-
合计	11,878,157.30	351,577.38

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	80,000.00
信息披露费	60,000.00	60,000.00
银行费用	10,338.05	4,722.52
指数使用费	200,000.00	200,000.00
债券帐户维护费	-	13,500.00
合计	360,338.05	358,222.52

#### 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 2018 年 3 月 28 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



## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

### 7.4.10.2 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,142,669.06	1,204,597.47
其中：支付销售机构的客户维护费	328,169.39	335,692.95

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1.00%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,028,533.85	240,919.49

注：支付基金托管人中国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0.20%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

### 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

本报告期内及上年度可比期间本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

### 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	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日

基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	973,172.50	5,972,572.50
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	-	4,999,400.00
期末持有的基金份额	973,172.50	973,172.50
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.23%	1.40%

#### 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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	6,397,884.91	1,610,078.75	7,825,805.66	70,408.96

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2017 年 6 月 26 日	-	2017 年 6 月 26 日	4.5002	2,682,712,107.68	46,624,664.22	2,729,336,771.90	
合计	-	-	-	4.5002	2,682,712,107.68	46,624,664.22	2,729,336,771.90	

## 7.4.12 期末（2017 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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

## 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
600309	万华化学	2017年12月5日	重大事项	37.94	-	-	49,200	1,444,267.34	1,866,648.00	-
600525	长园集团	2017年12月25日	重大事项	15.79	2018年1月10日	17.30	50,600	840,403.00	798,974.00	-
600239	云南城投	2017年6月26日	重大事项	5.47	2018年1月17日	5.74	130,950	431,174.27	716,296.50	-
600666	奥瑞德	2017年4月27日	重大事项	19.25	-	-	28,640	519,660.46	551,320.00	-
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	45.94	-	-	12,000	627,131.50	551,280.00	-
600685	中船防务	2017年9月27日	重大事项	26.66	2018年3月21日	24.05	11,562	315,516.41	308,242.92	-
600614	鹏起科技	2017年12月26日	重大事项	10.16	-	-	24,000	303,858.00	243,840.00	-
600273	嘉化能源	2017年10月26日	重大事项	9.53	2018年3月7日	10.00	22,300	209,181.95	212,519.00	-
600226	瀚叶股份	2017年11月28日	重大事项	5.93	-	-	27,118	175,993.86	160,809.74	-

600664	哈药股份	2017年9月28日	重大事项	5.81	2018年2月27日	6.00	23,340	137,391.21	135,605.40	-
600162	香江控股	2017年11月10日	重大事项	3.37	2018年1月12日	3.71	26,500	96,230.43	89,305.00	-
600829	人民同泰	2017年9月28日	重大事项	12.24	2018年2月27日	12.00	6,100	90,968.79	74,664.00	-
600818	中路股份	2017年10月19日	重大事项	22.83	2018年2月7日	20.55	2,800	60,369.35	63,924.00	-

注：根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告【2017】13号）等有关规定，对上述（除 600309 万华化学、600525 长园集团、600685 中船防务、600614 鹏起科技、600273 嘉化能源、600226 瀚叶股份、600664 哈药股份、600162 香江控股、600829 人民同泰、600818 中路股份外）股票估值方法进行调整（详见基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司相关公告）。

#### 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大盘股,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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

### 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银行存款、结算备付金及债券投资等。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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	6,397,884.91	-	-	-	6,397,884.91
结算备付金	12,750.30	-	-	-	12,750.30
存出保证金	55,499.50	-	-	-	55,499.50
交易性金融资产	-	-	-	82,958,486.83	82,958,486.83
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	-	-	-	1,392.07	1,392.07
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	28,702.04	28,702.04
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,466,134.71	-	-	82,988,580.94	89,454,715.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	83,098.49	83,098.49
应付管理人报酬	-	-	-	75,455.88	75,455.88
应付托管费	-	-	-	15,091.18	15,091.18
应付交易费用	-	-	-	15,168.73	15,168.73
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	346,612.60	346,612.60
负债总计	-	-	-	535,426.88	535,426.88
利率敏感度缺口	6,466,134.71	-	-	82,453,154.06	88,919,288.77
上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	7,825,805.66	-	-	-	7,825,805.66
结算备付金	224,556.14	-	-	-	224,556.14
存出保证金	3,726.85	-	-	-	3,726.85
交易性金融资产	-	-	-	108,178,133.12	108,178,133.12
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	-	-	-	1,601.08	1,601.08
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	20,651.70	20,651.70
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,054,088.65	-	-	108,200,385.90	116,254,474.55
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	700.90	700.90
应付赎回款	-	-	-	7,313.79	7,313.79
应付管理人报酬	-	-	-	100,043.21	100,043.21
应付托管费	-	-	-	20,008.62	20,008.62
应付交易费用	-	-	-	98,705.88	98,705.88
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	306,438.46	306,438.46
负债总计	-	-	-	533,210.86	533,210.86
利率敏感度缺口	8,054,088.65	-	-	-107,667,175.04	115,721,263.69

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末未持有债券投资，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。

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板和创业板，及其他经中国证监会核准上市的股票)、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)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种,基金管理人履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。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其备选成分股的资产占基金资产的比例不低于 80%;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%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

于 2017 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 2017 年 12 月 31 日		上年度末 2016 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	82,958,486.83	93.30	108,178,133.12	93.48
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	82,958,486.83	93.30	108,178,133.12	93.48

#### 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(2017 年 12 月 31 日)	上年度末(2016 年 12 月 31 日)
	1. 基金净资产变动	864,259.58	1,038,528.79
2. 基金净资产变动	-864,259.58	-1,038,528.79	

注:利用 CAPM 模型计算得到上述结果;其中,无风险收益率取 2017 年 12 月 31 日十年期国债收益率 3.88%,利用 2017 年 7 月 3 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 1.04。



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	82,958,486.83	92.74
	其中：股票	82,958,486.83	92.74
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	6,410,635.21	7.17
8	其他各项资产	85,593.61	0.10
9	合计	89,454,715.65	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

## 8.2.1 期末指数投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	653,775.00	0.74
B	采矿业	3,768,425.44	4.24
C	制造业	45,279,270.52	50.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,028,575.62	4.53
E	建筑业	1,849,038.52	2.08
F	批发和零售业	4,527,079.08	5.09
G	交通运输、仓储和邮政业	4,539,231.48	5.10
H	住宿和餐饮业	181,243.77	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,233,905.12	1.39
J	金融业	47,771.00	0.05
K	房地产业	2,934,189.32	3.30

L	租赁和商务服务业	491,374.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	200,924.57	0.23
N	水利、环境和公共设施管理业	918,661.00	1.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	127,200.00	0.14
Q	卫生和社会工作	214,346.24	0.24
R	文化、体育和娱乐业	1,178,637.15	1.33
S	综合	362,074.00	0.41
	合计	72,535,721.83	81.57

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。

### 8.2.2 期末积极投资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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	234,531.00	0.26
C	制造业	7,678,989.00	8.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	157,052.00	0.18
J	金融业	329,992.00	0.37
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,470,921.00	1.65
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	551,280.00	0.62
S	综合	-	-
	合计	10,422,765.00	11.72

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。

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未投资港股通股票。

## 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

## 8.3.1 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	600487	亨通光电	36,600	1,479,372.00	1.66
2	600673	东阳光科	169,000	1,140,750.00	1.28
3	603288	海天味业	20,553	1,105,751.40	1.24
4	600176	中国巨石	62,418	1,016,789.22	1.14
5	600201	生物股份	29,351	931,600.74	1.05
6	600352	浙江龙盛	76,700	898,157.00	1.01
7	600525	长园集团	50,600	798,974.00	0.90
8	600584	长电科技	36,952	788,186.16	0.89
9	600674	川投能源	75,000	763,500.00	0.86
10	600239	云南城投	130,950	716,296.50	0.81
11	603019	中科曙光	16,578	667,098.72	0.75
12	600521	华海药业	21,474	646,796.88	0.73
13	600004	白云机场	43,906	645,418.20	0.73
14	603588	高能环境	50,000	636,000.00	0.72
15	600438	通威股份	50,600	612,766.00	0.69
16	600426	华鲁恒升	38,490	612,760.80	0.69
17	600398	海澜之家	62,100	602,370.00	0.68
18	600498	烽火通信	20,800	599,664.00	0.67
19	600298	安琪酵母	18,256	597,336.32	0.67
20	600975	新五丰	100,000	573,000.00	0.64
21	600666	奥瑞德	28,640	551,320.00	0.62
22	600879	航天电子	69,617	545,797.28	0.61
23	600642	申能股份	91,150	534,139.00	0.60
24	600388	龙净环保	30,300	524,190.00	0.59
25	600872	中炬高新	20,459	506,564.84	0.57
26	600188	兖州煤业	33,964	493,157.28	0.55
27	600885	宏发股份	11,700	484,029.00	0.54
28	601233	桐昆股份	21,450	482,410.50	0.54
29	600056	中国医药	19,338	481,322.82	0.54
30	600583	海油工程	76,900	472,935.00	0.53
31	600779	水井坊	9,600	449,280.00	0.51
32	600460	士兰微	28,500	439,755.00	0.49
33	600183	生益科技	24,900	429,774.00	0.48

34	600567	山鹰纸业	95,900	416,206.00	0.47
35	601000	唐山港	87,800	413,538.00	0.47
36	600027	华电国际	109,100	404,761.00	0.46
37	600867	通化东宝	17,624	403,413.36	0.45
38	601877	正泰电器	14,995	392,119.25	0.44
39	600755	厦门国贸	38,600	389,860.00	0.44
40	600038	中直股份	8,300	386,199.00	0.43
41	600884	杉杉股份	19,651	380,836.38	0.43
42	600143	金发科技	57,833	379,962.81	0.43
43	600970	中材国际	38,200	377,798.00	0.42
44	601231	环旭电子	23,900	376,903.00	0.42
45	600062	华润双鹤	14,884	368,379.00	0.41
46	600490	鹏欣资源	41,500	351,920.00	0.40
47	601168	西部矿业	42,900	351,780.00	0.40
48	601238	广汽集团	14,100	347,706.00	0.39
49	600125	铁龙物流	32,100	347,322.00	0.39
50	600122	宏图高科	35,835	347,241.15	0.39
51	600325	华发股份	47,100	346,656.00	0.39
52	600823	世茂股份	70,020	345,898.80	0.39
53	600566	济川药业	9,000	343,350.00	0.39
54	601098	中南传媒	24,500	340,305.00	0.38
55	600348	阳泉煤业	45,900	338,742.00	0.38
56	600717	天津港	32,200	337,778.00	0.38
57	600409	三友化工	35,100	336,609.00	0.38
58	600240	华业资本	38,200	327,756.00	0.37
59	600856	中天能源	27,800	324,982.00	0.37
60	600597	光明乳业	21,136	320,210.40	0.36
61	600161	天坛生物	11,100	319,569.00	0.36
62	600486	扬农化工	6,420	319,009.80	0.36
63	600711	盛屯矿业	37,500	318,375.00	0.36
64	600172	黄河旋风	36,020	315,895.40	0.36
65	600166	福田汽车	110,000	309,100.00	0.35
66	601636	旗滨集团	49,500	308,880.00	0.35
67	600685	中船防务	11,562	308,242.92	0.35
68	600418	江淮汽车	32,500	307,450.00	0.35
69	600655	豫园股份	27,700	297,498.00	0.33
70	600260	凯乐科技	10,200	296,922.00	0.33
71	603077	和邦生物	146,880	293,760.00	0.33
72	601021	春秋航空	7,866	293,165.82	0.33

73	600373	中文传媒	17,300	292,889.00	0.33
74	600138	中青旅	13,700	285,919.00	0.32
75	601058	赛轮金宇	79,160	285,767.60	0.32
76	600511	国药股份	10,190	283,282.00	0.32
77	603885	吉祥航空	18,490	282,712.10	0.32
78	600026	中远海能	46,000	281,520.00	0.32
79	601666	平煤股份	44,600	280,980.00	0.32
80	601880	大连港	100,500	280,395.00	0.32
81	600988	赤峰黄金	43,400	279,496.00	0.31
82	600582	天地科技	59,900	278,535.00	0.31
83	600633	浙数文化	18,239	277,232.80	0.31
84	600881	亚泰集团	52,500	277,200.00	0.31
85	600803	新奥股份	18,361	275,782.22	0.31
86	600835	上海机电	11,069	271,190.50	0.30
87	600171	上海贝岭	16,600	270,082.00	0.30
88	601678	滨化股份	32,720	265,686.40	0.30
89	603766	隆鑫通用	37,800	265,356.00	0.30
90	600323	瀚蓝环境	16,600	264,770.00	0.30
91	603111	康尼机电	19,600	264,600.00	0.30
92	600648	外高桥	14,122	261,257.00	0.29
93	600682	南京新百	6,900	260,751.00	0.29
94	600206	有研新材	21,500	257,570.00	0.29
95	600477	杭萧钢构	24,075	256,880.25	0.29
96	603899	晨光文具	10,400	256,464.00	0.29
97	600039	四川路桥	62,300	253,561.00	0.29
98	600563	法拉电子	4,927	250,340.87	0.28
99	600380	健康元	22,356	250,163.64	0.28
100	600720	祁连山	23,860	246,951.00	0.28
101	600326	西藏天路	23,800	244,188.00	0.27
102	600614	鹏起科技	24,000	243,840.00	0.27
103	600312	平高电气	24,400	243,756.00	0.27
104	603883	老百姓	3,800	239,362.00	0.27
105	600410	华胜天成	22,045	231,913.40	0.26
106	600366	宁波韵升	13,185	231,001.20	0.26
107	600507	方大特钢	18,200	230,958.00	0.26
108	600559	老白干酒	7,300	226,081.00	0.25
109	600611	大众交通	44,750	222,855.00	0.25
110	601799	星宇股份	4,500	222,750.00	0.25
111	600993	马应龙	10,800	221,184.00	0.25

112	600600	青岛啤酒	5,573	219,186.09	0.25
113	600763	通策医疗	6,632	214,346.24	0.24
114	600270	外运发展	12,400	214,272.00	0.24
115	600651	飞乐音响	23,300	213,195.00	0.24
116	600273	嘉化能源	22,300	212,519.00	0.24
117	600175	美都能源	40,300	210,769.00	0.24
118	600729	重庆百货	8,400	210,504.00	0.24
119	600372	中航电子	15,300	209,457.00	0.24
120	600416	湘电股份	16,654	208,008.46	0.23
121	600502	安徽水利	30,100	207,389.00	0.23
122	600420	现代制药	16,073	204,448.56	0.23
123	600123	兰花科创	22,200	203,574.00	0.23
124	600562	国睿科技	8,439	202,620.39	0.23
125	600694	大商股份	5,981	201,739.13	0.23
126	603369	今世缘	12,900	200,079.00	0.23
127	600557	康缘药业	14,768	199,072.64	0.22
128	600967	内蒙一机	16,430	197,981.50	0.22
129	603188	亚邦股份	11,900	197,421.00	0.22
130	601689	拓普集团	7,958	196,880.92	0.22
131	601222	林洋能源	19,400	196,716.00	0.22
132	600708	光明地产	28,661	196,327.85	0.22
133	600580	卧龙电气	24,400	195,444.00	0.22
134	600197	伊力特	8,300	194,386.00	0.22
135	600765	中航重机	16,100	193,522.00	0.22
136	600990	四创电子	3,322	192,974.98	0.22
137	603008	喜临门	10,400	192,296.00	0.22
138	600811	东方集团	41,560	190,344.80	0.21
139	603816	顾家家居	3,226	190,237.22	0.21
140	600668	尖峰集团	12,000	190,080.00	0.21
141	600587	新华医疗	11,300	189,727.00	0.21
142	600787	中储股份	17,155	188,705.00	0.21
143	600116	三峡水利	21,200	188,680.00	0.21
144	600998	九州通	9,800	185,710.00	0.21
145	600754	锦江股份	5,613	181,243.77	0.20
146	601908	京运通	33,600	181,104.00	0.20
147	600499	科达洁能	16,253	180,245.77	0.20
148	600399	抚顺特钢	32,000	179,200.00	0.20
149	600236	桂冠电力	31,000	178,250.00	0.20
150	600641	万业企业	13,200	176,880.00	0.20

151	600395	盘江股份	25,568	175,652.16	0.20
152	600612	老凤祥	4,238	174,436.08	0.20
153	600422	昆药集团	18,800	172,020.00	0.19
154	603515	欧普照明	3,900	167,076.00	0.19
155	601958	金钼股份	23,100	167,013.00	0.19
156	600377	宁沪高速	16,900	166,465.00	0.19
157	600578	京能电力	44,900	166,130.00	0.19
158	601001	大同煤业	27,400	165,770.00	0.19
159	600185	格力地产	29,160	165,628.80	0.19
160	600750	江中药业	6,500	165,620.00	0.19
161	600006	东风汽车	28,300	165,555.00	0.19
162	600261	阳光照明	29,700	163,944.00	0.18
163	600846	同济科技	16,900	162,747.00	0.18
164	600226	瀚叶股份	27,118	160,809.74	0.18
165	600687	刚泰控股	13,500	159,435.00	0.18
166	600114	东睦股份	10,000	158,300.00	0.18
167	603556	海兴电力	4,300	156,520.00	0.18
168	603368	柳州医药	3,194	152,896.78	0.17
169	603198	迎驾贡酒	8,690	152,857.10	0.17
170	600200	江苏吴中	13,100	151,305.00	0.17
171	600757	长江传媒	21,727	151,002.65	0.17
172	600517	置信电气	23,200	150,104.00	0.17
173	603338	浙江鼎力	1,901	149,494.64	0.17
174	600285	羚锐制药	15,900	147,870.00	0.17
175	600971	恒源煤电	14,000	146,020.00	0.16
176	600350	山东高速	24,300	145,557.00	0.16
177	600623	华谊集团	16,949	144,574.97	0.16
178	600459	贵研铂业	6,516	144,524.88	0.16
179	603658	安图生物	2,700	143,694.00	0.16
180	600742	一汽富维	8,700	143,637.00	0.16
181	600277	亿利洁能	22,200	142,968.00	0.16
182	601567	三星医疗	14,700	142,590.00	0.16
183	600635	大众公用	29,750	142,205.00	0.16
184	600862	中航高科	14,400	139,392.00	0.16
185	600756	浪潮软件	7,800	138,762.00	0.16
186	603868	飞科电器	1,820	137,865.00	0.16
187	600255	梦舟股份	36,000	137,160.00	0.15
188	600664	哈药股份	23,340	135,605.40	0.15
189	600572	康恩贝	19,094	134,994.58	0.15



190	600894	广日股份	14,421	134,836.35	0.15
191	600054	黄山旅游	9,300	132,711.00	0.15
192	600758	红阳能源	17,800	131,364.00	0.15
193	603833	欧派家居	1,100	129,855.00	0.15
194	600012	皖通高速	11,800	129,800.00	0.15
195	600500	中化国际	15,300	129,438.00	0.15
196	600363	联创光电	10,300	129,368.00	0.15
197	600267	海正药业	8,500	128,690.00	0.14
198	601311	骆驼股份	9,709	128,644.25	0.14
199	600987	航民股份	11,400	128,592.00	0.14
200	600863	内蒙华电	43,000	127,710.00	0.14
201	603888	新华网	5,400	127,710.00	0.14
202	600661	新南洋	5,000	127,200.00	0.14
203	600400	红豆股份	17,600	126,544.00	0.14
204	600105	永鼎股份	19,400	126,488.00	0.14
205	600387	海越股份	11,772	125,136.36	0.14
206	600531	豫光金铅	19,300	125,064.00	0.14
207	601158	重庆水务	19,200	124,032.00	0.14
208	600216	浙江医药	9,200	123,648.00	0.14
209	601139	深圳燃气	15,100	122,310.00	0.14
210	600568	中珠医疗	15,680	121,833.60	0.14
211	600007	中国国贸	7,100	121,694.00	0.14
212	600335	国机汽车	10,824	121,661.76	0.14
213	600093	易见股份	11,300	121,136.00	0.14
214	600667	太极实业	13,300	119,168.00	0.13
215	600343	航天动力	9,166	118,516.38	0.13
216	600571	信雅达	10,900	116,521.00	0.13
217	600748	上实发展	18,145	116,309.45	0.13
218	600295	鄂尔多斯	8,000	115,760.00	0.13
219	601515	东风股份	11,500	112,700.00	0.13
220	600536	中国软件	6,800	112,540.00	0.13
221	601777	力帆股份	15,400	111,804.00	0.13
222	603898	好莱客	3,700	110,482.00	0.12
223	600180	瑞茂通	10,600	110,452.00	0.12
224	600391	航发科技	5,600	110,376.00	0.12
225	601069	西部黄金	6,900	109,503.00	0.12
226	600743	华远地产	29,900	109,434.00	0.12
227	600481	双良节能	27,240	109,232.40	0.12
228	600337	美克家居	17,710	107,145.50	0.12

229	600973	宝胜股份	21,160	107,069.60	0.12
230	603108	润达医疗	8,600	105,350.00	0.12
231	600086	东方金钰	9,881	105,232.65	0.12
232	600053	九鼎投资	4,400	105,116.00	0.12
233	600439	瑞贝卡	18,760	104,868.40	0.12
234	600075	新疆天业	13,460	104,584.20	0.12
235	600996	贵广网络	10,500	103,950.00	0.12
236	601890	亚星锚链	16,000	103,200.00	0.12
237	600299	安迪苏	9,869	99,775.59	0.11
238	603686	龙马环卫	3,800	99,750.00	0.11
239	603355	莱克电气	2,023	99,693.44	0.11
240	600594	益佰制药	9,700	99,134.00	0.11
241	603568	伟明环保	4,700	98,935.00	0.11
242	603306	华懋科技	3,400	97,444.00	0.11
243	601015	陕西黑猫	9,300	96,999.00	0.11
244	600986	科达股份	8,786	96,294.56	0.11
245	600495	晋西车轴	14,500	96,135.00	0.11
246	600491	龙元建设	10,043	94,906.35	0.11
247	600269	赣粤高速	18,500	94,720.00	0.11
248	600850	华东电脑	4,800	94,656.00	0.11
249	603118	共进股份	10,580	92,786.60	0.10
250	603128	华贸物流	11,300	92,547.00	0.10
251	601789	宁波建工	20,300	91,756.00	0.10
252	603228	景旺电子	1,700	91,409.00	0.10
253	603806	福斯特	2,680	91,388.00	0.10
254	600141	兴发集团	5,400	91,260.00	0.10
255	600167	联美控股	3,900	90,948.00	0.10
256	600626	申达股份	11,800	90,624.00	0.10
257	603866	桃李面包	2,300	89,631.00	0.10
258	600162	香江控股	26,500	89,305.00	0.10
259	601368	绿城水务	9,800	88,984.00	0.10
260	600897	厦门空港	3,901	87,694.48	0.10
261	600548	深高速	9,700	87,106.00	0.10
262	600859	王府井	4,260	86,904.00	0.10
263	603000	人民网	8,000	86,640.00	0.10
264	600814	杭州解百	9,500	85,500.00	0.10
265	603609	禾丰牧业	9,600	85,248.00	0.10
266	600210	紫江企业	17,900	85,204.00	0.10
267	600697	欧亚集团	3,250	83,590.00	0.09

268	600073	上海梅林	10,100	82,012.00	0.09
269	600874	创业环保	6,300	81,963.00	0.09
270	603737	三棵树	1,146	81,239.94	0.09
271	603258	电魂网络	2,500	81,225.00	0.09
272	600965	福成股份	7,500	80,775.00	0.09
273	601016	节能风电	24,500	80,605.00	0.09
274	603165	荣晟环保	1,400	80,290.00	0.09
275	600596	新安股份	8,712	79,976.16	0.09
276	600483	福能股份	10,553	79,780.68	0.09
277	603225	新凤鸣	2,200	78,760.00	0.09
278	601020	华钰矿业	3,800	77,976.00	0.09
279	601595	上海电影	3,778	77,033.42	0.09
280	600428	中远海特	13,700	76,857.00	0.09
281	600458	时代新材	7,600	76,532.00	0.09
282	600284	浦东建设	8,100	75,330.00	0.08
283	601002	晋亿实业	7,000	75,110.00	0.08
284	601199	江南水务	13,300	75,012.00	0.08
285	600829	人民同泰	6,100	74,664.00	0.08
286	603818	曲美家居	5,000	72,800.00	0.08
287	603939	益丰药房	1,600	72,768.00	0.08
288	603997	继峰股份	6,400	72,128.00	0.08
289	600305	恒顺醋业	6,100	71,919.00	0.08
290	600329	中新药业	4,800	71,376.00	0.08
291	603959	百利科技	2,300	71,254.00	0.08
292	603567	珍宝岛	5,000	70,650.00	0.08
293	600577	精达股份	18,500	69,560.00	0.08
294	601700	风范股份	8,300	66,732.00	0.08
295	600280	中央商场	8,400	66,108.00	0.07
296	603989	艾华集团	1,700	65,314.00	0.07
297	600405	动力源	9,910	64,613.20	0.07
298	600818	中路股份	2,800	63,924.00	0.07
299	600020	中原高速	13,100	63,666.00	0.07
300	600917	重庆燃气	5,700	63,498.00	0.07
301	603639	海利尔	1,400	62,930.00	0.07
302	603358	华达科技	1,700	62,713.00	0.07
303	600684	珠江实业	10,060	62,170.80	0.07
304	603929	亚翔集成	2,356	61,420.92	0.07
305	603877	太平鸟	2,200	59,642.00	0.07
306	601126	四方股份	7,568	59,257.44	0.07

307	600864	哈投股份	7,236	57,453.84	0.06
308	603239	浙江仙通	3,000	57,180.00	0.06
309	603727	博迈科	2,400	56,088.00	0.06
310	603339	四方冷链	2,300	54,556.00	0.06
311	600776	东方通信	7,500	54,225.00	0.06
312	603328	依顿电子	3,587	51,473.45	0.06
313	603298	杭叉集团	3,200	51,168.00	0.06
314	600292	远达环保	5,700	51,015.00	0.06
315	600838	上海九百	5,100	50,184.00	0.06
316	603060	国检集团	2,300	50,094.00	0.06
317	603025	大豪科技	1,700	50,014.00	0.06
318	603585	苏利股份	1,568	49,172.48	0.06
319	600113	浙江东日	4,700	48,034.00	0.05
320	600526	菲达环保	4,800	47,904.00	0.05
321	601128	常熟银行	6,700	47,771.00	0.05
322	600119	长江投资	3,400	46,512.00	0.05
323	603599	广信股份	2,300	44,942.00	0.05
324	603528	多伦科技	5,000	44,150.00	0.05
325	603618	杭电股份	4,879	43,911.00	0.05
326	600831	广电网络	5,348	43,693.16	0.05
327	600828	茂业商业	6,773	41,992.60	0.05
328	603757	大元泵业	700	41,839.00	0.05
329	603169	兰石重装	4,900	41,111.00	0.05
330	603628	清源股份	2,900	41,006.00	0.05
331	600891	秋林集团	5,358	40,827.96	0.05
332	600826	兰生股份	3,100	40,827.00	0.05
333	600650	锦江投资	2,796	40,625.88	0.05
334	600551	时代出版	3,422	40,174.28	0.05
335	603126	中材节能	4,100	40,016.00	0.05
336	603798	康普顿	2,200	39,578.00	0.04
337	603698	航天工程	1,981	39,560.57	0.04
338	603600	永艺股份	2,700	38,367.00	0.04
339	600617	国新能源	4,500	37,170.00	0.04
340	603569	长久物流	1,500	36,285.00	0.04
341	600077	宋都股份	9,727	34,628.12	0.04
342	600310	桂东电力	6,130	31,692.10	0.04
343	603861	白云电器	1,800	30,222.00	0.03
344	600613	神奇制药	3,000	25,080.00	0.03
345	603669	灵康药业	1,200	23,760.00	0.03

346	603098	森特股份	1,300	23,062.00	0.03
347	600981	汇鸿集团	3,900	22,542.00	0.03
348	603168	莎普爱思	1,484	22,067.08	0.02
349	600657	信达地产	3,600	20,088.00	0.02

### 8.3.2 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	600309	万华化学	49,200	1,866,648.00	2.10
2	601012	隆基股份	50,700	1,847,508.00	2.08
3	601888	中国国旅	33,900	1,470,921.00	1.65
4	600660	福耀玻璃	50,300	1,458,700.00	1.64
5	600519	贵州茅台	1,700	1,185,733.00	1.33
6	600522	中天科技	60,000	836,400.00	0.94
7	002739	万达电影	12,000	551,280.00	0.62
8	600282	南钢股份	100,000	484,000.00	0.54
9	601997	贵阳银行	24,700	329,992.00	0.37
10	600256	广汇能源	46,350	234,531.00	0.26
11	600289	ST 信通	15,800	157,052.00	0.18

## 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	600309	万华化学	123,075,722.17	106.36
2	600487	亨通光电	90,180,033.07	77.93
3	600436	片仔癀	61,640,202.10	53.27
4	600879	航天电子	58,621,613.74	50.66
5	600660	福耀玻璃	52,978,791.42	45.78
6	600260	凯乐科技	47,057,225.48	40.66
7	601888	中国国旅	46,987,781.93	40.60
8	600388	龙净环保	46,740,978.76	40.39
9	603019	中科曙光	40,301,824.24	34.83
10	600874	创业环保	39,584,289.90	34.21

11	600970	中材国际	38,359,217.71	33.15
12	600183	生益科技	38,244,519.13	33.05
13	601997	贵阳银行	36,621,247.50	31.65
14	600282	南钢股份	35,841,692.75	30.97
15	601168	西部矿业	34,013,283.00	29.39
16	600210	紫江企业	32,295,461.34	27.91
17	600477	杭萧钢构	31,811,805.12	27.49
18	600373	中文传媒	30,737,499.69	26.56
19	600326	西藏天路	28,364,368.58	24.51
20	600004	白云机场	27,620,395.20	23.87
21	600161	天坛生物	27,405,198.90	23.68
22	600495	晋西车轴	27,249,217.80	23.55
23	600176	中国巨石	26,909,692.76	23.25
24	600273	嘉化能源	26,018,097.91	22.48
25	601000	唐山港	25,776,856.76	22.27
26	601238	广汽集团	25,743,642.92	22.25
27	601666	平煤股份	25,294,312.00	21.86
28	600993	马应龙	24,883,295.66	21.50
29	601890	亚星锚链	23,841,048.55	20.60
30	601318	中国平安	23,742,085.04	20.52
31	601801	皖新传媒	23,717,331.00	20.50
32	600298	安琪酵母	23,007,198.14	19.88
33	600988	赤峰黄金	22,546,290.60	19.48
34	600348	阳泉煤业	22,488,946.91	19.43
35	600674	川投能源	21,858,050.00	18.89
36	600584	长电科技	21,476,527.52	18.56
37	600337	美克家居	21,143,747.57	18.27
38	600122	宏图高科	20,808,171.13	17.98
39	600372	中航电子	20,643,697.65	17.84
40	600755	厦门国贸	20,319,244.00	17.56
41	600633	浙数文化	20,254,594.62	17.50
42	600685	中船防务	19,914,770.67	17.21
43	603160	汇顶科技	19,835,012.97	17.14
44	600036	招商银行	19,682,001.26	17.01
45	603816	顾家家居	19,369,752.65	16.74
46	600409	三友化工	18,882,502.58	16.32

47	600758	红阳能源	18,349,054.18	15.86
48	600511	国药股份	17,968,337.85	15.53
49	600717	天津港	17,841,848.00	15.42
50	600566	济川药业	17,637,556.59	15.24
51	600185	格力地产	17,412,449.20	15.05
52	601231	环旭电子	17,367,113.00	15.01
53	600056	中国医药	17,061,763.20	14.74
54	603288	海天味业	16,973,884.72	14.67
55	600116	三峡水利	16,809,281.74	14.53
56	600623	华谊集团	16,493,945.29	14.25
57	600197	伊力特	16,493,661.47	14.25
58	600201	生物股份	15,973,596.55	13.80
59	600038	中直股份	15,774,943.64	13.63
60	600175	美都能源	15,721,461.36	13.59
61	600583	海油工程	15,415,389.00	13.32
62	600216	浙江医药	15,231,388.38	13.16
63	600507	方大特钢	14,936,113.00	12.91
64	601886	江河集团	14,904,833.98	12.88
65	600119	长江投资	14,670,294.00	12.68
66	600967	内蒙一机	14,651,112.75	12.66
67	600562	国睿科技	14,475,157.65	12.51
68	600123	兰花科创	14,457,099.59	12.49
69	600867	通化东宝	14,302,827.52	12.36
70	600020	中原高速	14,251,520.35	12.32
71	600872	中炬高新	14,117,056.30	12.20
72	600600	青岛啤酒	14,083,346.88	12.17
73	600884	杉杉股份	13,824,127.56	11.95
74	600682	南京新百	13,652,871.00	11.80
75	600684	珠江实业	13,479,156.97	11.65
76	600166	福田汽车	13,349,565.00	11.54
77	603868	飞科电器	13,328,198.80	11.52
78	600742	一汽富维	12,896,386.00	11.14
79	600405	动力源	12,702,501.77	10.98
80	600188	兖州煤业	12,460,823.19	10.77
81	600395	盘江股份	12,424,951.12	10.74
82	600885	宏发股份	12,397,165.00	10.71

83	600614	鹏起科技	12,373,918.40	10.69
84	600312	平高电气	12,335,085.00	10.66
85	600172	黄河旋风	12,206,444.00	10.55
86	600240	华业资本	12,149,197.20	10.50
87	600596	新安股份	12,090,769.52	10.45
88	600256	广汇能源	12,076,753.50	10.44
89	600416	湘电股份	11,959,221.77	10.33
90	603369	今世缘	11,884,573.64	10.27
91	603618	杭电股份	11,730,831.00	10.14
92	600502	安徽水利	11,631,400.95	10.05
93	600420	现代制药	11,481,011.53	9.92
94	600571	信雅达	11,364,601.00	9.82
95	600125	铁龙物流	11,322,182.42	9.78
96	601689	拓普集团	11,307,030.25	9.77
97	600587	新华医疗	11,249,665.00	9.72
98	600141	兴发集团	11,163,797.62	9.65
99	601877	正泰电器	11,114,137.17	9.60
100	600567	山鹰纸业	10,834,081.00	9.36
101	600519	贵州茅台	10,821,992.00	9.35
102	600846	同济科技	10,816,186.39	9.35
103	600525	长园集团	10,803,773.91	9.34
104	600803	新奥股份	10,645,841.00	9.20
105	600756	浪潮软件	10,644,921.00	9.20
106	601098	中南传媒	10,622,961.00	9.18
107	600251	冠农股份	10,590,815.00	9.15
108	600531	豫光金铅	10,589,681.00	9.15
109	600398	海澜之家	10,582,390.00	9.14
110	600582	天地科技	10,563,993.00	9.13
111	600729	重庆百货	10,532,073.05	9.10
112	600143	金发科技	10,507,314.00	9.08
113	600787	中储股份	10,480,364.76	9.06
114	600830	香溢融通	10,451,988.98	9.03
115	603528	多伦科技	10,398,551.00	8.99
116	600026	中远海能	10,380,301.00	8.97
117	600391	航发科技	10,222,206.49	8.83
118	601002	晋亿实业	10,191,976.52	8.81



119	600459	贵研铂业	10,129,957.95	8.75
120	601166	兴业银行	10,091,380.00	8.72
121	600635	大众公用	10,040,606.00	8.68
122	600323	瀚蓝环境	9,975,847.00	8.62
123	600491	龙元建设	9,948,022.00	8.60
124	600563	法拉电子	9,904,928.72	8.56
125	603165	荣晟环保	9,747,254.88	8.42
126	600270	外运发展	9,720,352.00	8.40
127	600426	华鲁恒升	9,486,341.60	8.20
128	600765	中航重机	9,434,639.96	8.15
129	603588	高能环境	9,427,164.00	8.15
130	600162	香江控股	9,346,210.00	8.08
131	600400	红豆股份	9,329,040.88	8.06
132	600399	抚顺特钢	9,292,470.00	8.03
133	603766	隆鑫通用	9,245,556.50	7.99
134	601020	华钰矿业	9,214,404.00	7.96
135	600343	航天动力	9,129,951.22	7.89
136	601636	旗滨集团	9,124,615.00	7.88
137	600498	烽火通信	9,078,845.00	7.85
138	600611	大众交通	8,860,732.50	7.66
139	600667	太极实业	8,749,375.00	7.56
140	603000	人民网	8,742,177.00	7.55
141	600687	刚泰控股	8,727,970.00	7.54
142	600226	瀚叶股份	8,673,112.60	7.49
143	603328	依顿电子	8,672,704.90	7.49
144	600990	四创电子	8,633,444.00	7.46
145	600750	江中药业	8,617,028.00	7.45
146	600521	华海药业	8,611,001.86	7.44
147	603989	艾华集团	8,544,688.00	7.38
148	600039	四川路桥	8,483,067.00	7.33
149	600711	盛屯矿业	8,466,241.00	7.32
150	600668	尖峰集团	8,407,414.91	7.27
151	600410	华胜天成	8,391,860.45	7.25
152	601328	交通银行	8,288,944.00	7.16
153	600720	祁连山	8,274,224.80	7.15
154	600458	时代新材	8,228,897.26	7.11

155	600891	秋林集团	8,102,833.82	7.00
156	600888	新疆众和	8,061,140.00	6.97
157	600027	华电国际	8,014,838.00	6.93
158	601958	金钼股份	7,976,697.00	6.89
159	000651	格力电器	7,943,938.35	6.86
160	600761	安徽合力	7,895,359.00	6.82
161	000333	美的集团	7,884,777.00	6.81
162	600269	赣粤高速	7,814,784.00	6.75
163	600138	中青旅	7,737,572.33	6.69
164	600195	中牧股份	7,724,385.88	6.67
165	603888	新华网	7,673,394.00	6.63
166	600428	中远海特	7,623,379.00	6.59
167	600113	浙江东日	7,598,291.00	6.57
168	600418	江淮汽车	7,536,627.00	6.51
169	603198	迎驾贡酒	7,371,652.50	6.37
170	600086	东方金钰	7,334,180.00	6.34
171	601233	桐昆股份	7,306,114.00	6.31
172	603008	喜临门	7,235,187.00	6.25
173	600881	亚泰集团	7,218,148.00	6.24
174	601021	春秋航空	7,099,447.67	6.13
175	600000	浦发银行	7,028,234.14	6.07
176	600439	瑞贝卡	6,984,873.60	6.04
177	600838	上海九百	6,977,825.00	6.03
178	600597	光明乳业	6,931,880.60	5.99
179	000002	万科A	6,916,870.00	5.98
180	600062	华润双鹤	6,916,428.91	5.98
181	601668	中国建筑	6,891,471.00	5.96
182	600329	中新药业	6,860,006.20	5.93
183	600500	中化国际	6,813,140.00	5.89
184	600580	卧龙电气	6,778,669.00	5.86
185	601777	力帆股份	6,777,869.24	5.86
186	603111	康尼机电	6,768,336.60	5.85
187	600054	黄山旅游	6,759,643.00	5.84
188	600594	益佰制药	6,732,618.00	5.82
189	603639	海利尔	6,723,750.34	5.81
190	600350	山东高速	6,647,375.00	5.74

191	600387	海越股份	6,646,420.35	5.74
192	603098	森特股份	6,615,269.00	5.72
193	600433	冠豪高新	6,601,029.00	5.70
194	601288	农业银行	6,569,114.00	5.68
195	600757	长江传媒	6,543,974.00	5.65
196	600743	华远地产	6,362,672.00	5.50
197	600030	中信证券	6,281,270.00	5.43
198	600295	鄂尔多斯	6,270,218.44	5.42
199	603515	欧普照明	6,219,113.00	5.37
200	603355	莱克电气	6,138,124.40	5.30
201	603169	兰石重装	6,122,267.00	5.29
202	600499	科达洁能	6,087,437.00	5.26
203	600856	中天能源	6,037,779.44	5.22
204	600823	世茂股份	6,031,297.80	5.21
205	600837	海通证券	6,000,225.00	5.19
206	600626	申达股份	5,956,187.00	5.15
207	603929	亚翔集成	5,937,288.14	5.13
208	600200	江苏吴中	5,917,232.00	5.11
209	603308	应流股份	5,907,978.00	5.11
210	600363	联创光电	5,898,990.97	5.10
211	600352	浙江龙盛	5,875,575.00	5.08
212	600180	瑞茂通	5,874,007.00	5.08
213	600694	大商股份	5,778,157.61	4.99
214	600676	交运股份	5,772,216.00	4.99
215	600305	恒顺醋业	5,726,709.00	4.95
216	600887	伊利股份	5,708,019.30	4.93
217	603239	浙江仙通	5,673,351.00	4.90
218	600366	宁波韵升	5,650,951.06	4.88
219	603108	润达医疗	5,648,603.19	4.88
220	600651	飞乐音响	5,644,955.00	4.88
221	603077	和邦生物	5,566,004.00	4.81
222	601398	工商银行	5,472,020.00	4.73
223	601799	星宇股份	5,466,122.00	4.72
224	600572	康恩贝	5,450,907.64	4.71
225	600267	海正药业	5,396,485.00	4.66
226	601169	北京银行	5,324,757.00	4.60

227	600763	通策医疗	5,313,529.07	4.59
228	600551	时代出版	5,293,334.78	4.57
229	600073	上海梅林	5,290,175.25	4.57
230	603877	太平鸟	5,273,041.00	4.56
231	600098	广州发展	5,214,218.00	4.51
232	600986	科达股份	5,207,723.34	4.50
233	600284	浦东建设	5,183,106.00	4.48
234	600973	宝胜股份	5,157,274.25	4.46
235	601015	陕西黑猫	5,156,947.34	4.46
236	600486	扬农化工	5,139,156.40	4.44
237	600664	哈药股份	5,095,515.00	4.40
238	600557	康缘药业	5,077,814.96	4.39
239	603898	好莱客	4,987,489.00	4.31
240	601016	节能风电	4,950,104.00	4.28
241	600642	申能股份	4,939,633.50	4.27
242	600863	内蒙华电	4,918,349.00	4.25
243	603628	清源股份	4,907,065.00	4.24
244	600173	卧龙地产	4,899,591.00	4.23
245	603228	景旺电子	4,890,125.00	4.23
246	603258	电魂网络	4,883,998.00	4.22
247	601766	中国中车	4,800,882.00	4.15
248	601222	林洋能源	4,775,395.00	4.13
249	601058	赛轮金宇	4,772,869.18	4.12
250	603556	海兴电力	4,770,278.00	4.12
251	600900	长江电力	4,729,434.00	4.09
252	603358	华达科技	4,726,618.60	4.08
253	600261	阳光照明	4,710,139.00	4.07
254	600380	健康元	4,707,661.09	4.07
255	601601	中国太保	4,642,639.00	4.01
256	600381	青海春天	4,625,879.40	4.00
257	600536	中国软件	4,588,247.00	3.96
258	600438	通威股份	4,565,696.00	3.95
259	603698	航天工程	4,542,419.68	3.93
260	600754	锦江股份	4,519,952.00	3.91
261	603997	继峰股份	4,512,487.50	3.90
262	601678	滨化股份	4,463,464.00	3.86

263	600818	中路股份	4,450,084.00	3.85
264	000725	京东方 A	4,439,923.00	3.84
265	000858	五 粮 液	4,412,528.97	3.81
266	601567	三星医疗	4,411,411.44	3.81
267	601126	四方股份	4,388,966.40	3.79
268	600335	国机汽车	4,317,497.96	3.73
269	600422	昆药集团	4,300,694.00	3.72
270	603188	亚邦股份	4,294,863.00	3.71
271	601211	国泰君安	4,284,708.00	3.70
272	600835	上海机电	4,248,443.86	3.67
273	600824	益民集团	4,210,723.99	3.64
274	601789	宁波建工	4,098,979.00	3.54
275	600299	安迪苏	4,083,783.18	3.53
276	600276	恒瑞医药	4,053,443.00	3.50
277	600662	强生控股	4,053,072.00	3.50
278	603368	柳州医药	4,046,885.40	3.50
279	600206	有研新材	4,043,308.00	3.49
280	603306	华懋科技	4,023,790.00	3.48
281	600748	上实发展	3,979,070.05	3.44
282	600171	上海贝岭	3,975,887.00	3.44
283	603339	四方冷链	3,960,467.00	3.42
284	601968	宝钢包装	3,959,711.17	3.42
285	601311	骆驼股份	3,893,821.37	3.36
286	600708	光明地产	3,856,209.64	3.33
287	600612	老凤祥	3,846,471.27	3.32
288	000001	平安银行	3,823,896.00	3.30
289	603883	老百姓	3,815,924.00	3.30
290	600828	茂业商业	3,809,023.00	3.29
291	600965	福成股份	3,767,692.00	3.26
292	603885	吉祥航空	3,748,542.40	3.24
293	603899	晨光文具	3,712,186.00	3.21
294	600012	皖通高速	3,699,610.00	3.20
295	600975	新五丰	3,619,045.70	3.13
296	600517	置信电气	3,592,956.00	3.10
297	603658	安图生物	3,589,167.00	3.10
298	600386	北巴传媒	3,549,906.30	3.07

299	600859	王府井	3,548,831.00	3.07
300	600648	外高桥	3,537,250.74	3.06
301	002415	海康威视	3,532,775.00	3.05
302	600377	宁沪高速	3,510,838.00	3.03
303	600105	永鼎股份	3,493,641.73	3.02
304	600850	华东电脑	3,440,003.00	2.97
305	600285	羚锐制药	3,426,123.00	2.96
306	600292	远达环保	3,415,941.00	2.95
307	600998	九州通	3,368,044.00	2.91
308	600048	保利地产	3,361,181.00	2.90
309	600650	锦江投资	3,350,055.88	2.89
310	600053	九鼎投资	3,347,955.18	2.89
311	603600	永艺股份	3,341,145.00	2.89
312	600894	广日股份	3,267,227.00	2.82
313	603118	共进股份	3,247,947.60	2.81
314	601390	中国中铁	3,231,325.00	2.79
315	600028	中国石化	3,197,295.00	2.76
316	600578	京能电力	3,192,942.00	2.76
317	600481	双良节能	3,187,394.00	2.75
318	600641	万业企业	3,182,015.00	2.75
319	600075	新疆天业	3,151,512.60	2.72
320	601158	重庆水务	3,119,036.00	2.70
321	600518	康美药业	3,075,651.00	2.66
322	603609	禾丰牧业	3,075,278.39	2.66
323	601818	光大银行	3,069,179.00	2.65
324	600093	易见股份	3,062,387.00	2.65
325	600280	中央商场	3,045,107.00	2.63
326	600537	亿晶光电	2,946,566.00	2.55
327	600811	东方集团	2,939,332.00	2.54
328	600736	苏州高新	2,913,551.00	2.52
329	603737	三棵树	2,900,995.00	2.51
330	600996	贵广网络	2,860,592.00	2.47
331	600826	兰生股份	2,836,498.00	2.45
332	600015	华夏银行	2,798,837.00	2.42
333	601688	华泰证券	2,774,506.00	2.40
334	603025	大豪科技	2,761,797.00	2.39

335	600019	宝钢股份	2,742,561.00	2.37
336	601186	中国铁建	2,709,814.00	2.34
337	603979	金诚信	2,693,603.00	2.33
338	600483	福能股份	2,680,978.97	2.32
339	600775	南京熊猫	2,627,165.00	2.27
340	600987	航民股份	2,594,492.00	2.24
341	002304	洋河股份	2,548,175.00	2.20
342	601006	大秦铁路	2,475,237.00	2.14
343	600077	宋都股份	2,470,918.00	2.14
344	601595	上海电影	2,441,943.92	2.11
345	600548	深高速	2,433,973.00	2.10
346	600310	桂东电力	2,385,033.34	2.06
347	000776	广发证券	2,373,315.00	2.05
348	600526	菲达环保	2,348,795.00	2.03
349	601368	绿城水务	2,329,449.00	2.01
350	603128	华贸物流	2,322,600.00	2.01
351	600814	杭州解百	2,322,337.00	2.01

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。

#### 8.4.2 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	600309	万华化学	132,689,024.56	114.66
2	600487	亨通光电	85,054,325.19	73.50
3	600436	片仔癀	60,186,816.98	52.01
4	600879	航天电子	58,099,084.82	50.21
5	600260	凯乐科技	49,615,095.57	42.87
6	600660	福耀玻璃	48,472,617.52	41.89
7	601888	中国国旅	45,146,853.85	39.01
8	600388	龙净环保	44,452,419.97	38.41
9	600282	南钢股份	43,754,486.80	37.81
10	600183	生益科技	41,247,271.08	35.64
11	601168	西部矿业	40,678,702.01	35.15
12	603019	中科曙光	36,884,888.44	31.87
13	600326	西藏天路	36,816,680.46	31.81
14	600970	中材国际	36,268,011.70	31.34

15	601997	贵阳银行	35,819,141.23	30.95
16	600210	紫江企业	35,656,579.03	30.81
17	600874	创业环保	34,292,988.00	29.63
18	601666	平煤股份	31,015,745.92	26.80
19	600477	杭萧钢构	29,881,413.48	25.82
20	600004	白云机场	29,259,976.96	25.28
21	600373	中文传媒	28,912,218.87	24.98
22	600176	中国巨石	27,564,833.10	23.82
23	600495	晋西车轴	26,805,677.19	23.16
24	601238	广汽集团	25,688,138.00	22.20
25	601000	唐山港	25,352,115.52	21.91
26	600348	阳泉煤业	24,910,227.89	21.53
27	600273	嘉化能源	24,784,236.15	21.42
28	601318	中国平安	24,393,395.52	21.08
29	600993	马应龙	23,744,722.28	20.52
30	601890	亚星锚链	22,998,668.24	19.87
31	600988	赤峰黄金	22,801,505.19	19.70
32	600161	天坛生物	22,729,408.92	19.64
33	600337	美克家居	22,474,177.16	19.42
34	601801	皖新传媒	22,175,200.35	19.16
35	600298	安琪酵母	21,931,034.28	18.95
36	600584	长电科技	21,340,189.20	18.44
37	600758	红阳能源	21,293,731.20	18.40
38	600674	川投能源	21,113,343.49	18.24
39	600122	宏图高科	20,496,953.62	17.71
40	600409	三友化工	20,441,443.34	17.66
41	600755	厦门国贸	19,968,812.21	17.26
42	600633	浙数文化	19,963,098.38	17.25
43	600372	中航电子	19,500,568.19	16.85
44	600036	招商银行	19,301,991.60	16.68
45	600685	中船防务	19,186,553.82	16.58
46	603160	汇顶科技	18,359,297.00	15.87
47	603816	顾家家居	18,082,305.91	15.63
48	600717	天津港	17,049,009.07	14.73
49	600123	兰花科创	16,792,588.37	14.51
50	600884	杉杉股份	16,636,758.56	14.38
51	600566	济川药业	16,585,828.48	14.33
52	600185	格力地产	16,571,230.54	14.32



53	601231	环旭电子	16,534,238.39	14.29
54	600967	内蒙一机	16,369,725.13	14.15
55	603288	海天味业	16,183,598.86	13.98
56	600201	生物股份	16,158,240.49	13.96
57	600197	伊力特	16,140,797.39	13.95
58	600056	中国医药	16,085,956.77	13.90
59	600511	国药股份	16,073,563.10	13.89
60	600216	浙江医药	15,962,178.66	13.79
61	600038	中直股份	15,844,306.53	13.69
62	600175	美都能源	15,689,845.01	13.56
63	600623	华谊集团	15,508,854.40	13.40
64	600507	方大特钢	15,329,311.71	13.25
65	600116	三峡水利	15,310,056.00	13.23
66	600119	长江投资	15,076,274.00	13.03
67	600020	中原高速	15,044,585.79	13.00
68	600682	南京新百	14,894,952.56	12.87
69	600583	海油工程	14,780,291.99	12.77
70	600872	中炬高新	14,578,760.41	12.60
71	601886	江河集团	14,455,746.60	12.49
72	600600	青岛啤酒	14,075,721.24	12.16
73	600562	国睿科技	13,991,380.98	12.09
74	600867	通化东宝	13,477,826.05	11.65
75	600395	盘江股份	13,372,415.18	11.56
76	600596	新安股份	13,329,633.30	11.52
77	600684	珠江实业	13,229,773.24	11.43
78	600742	一汽富维	13,042,401.47	11.27
79	600188	兖州煤业	13,028,790.82	11.26
80	603868	飞科电器	12,994,220.92	11.23
81	600166	福田汽车	12,787,956.00	11.05
82	600312	平高电气	12,481,278.66	10.79
83	603369	今世缘	12,462,917.78	10.77
84	600885	宏发股份	12,436,227.78	10.75
85	600172	黄河旋风	12,242,693.33	10.58
86	600405	动力源	12,204,257.14	10.55
87	600614	鹏起科技	12,173,849.00	10.52
88	600141	兴发集团	12,122,559.99	10.48
89	600567	山鹰纸业	11,985,201.49	10.36
90	600256	广汇能源	11,931,147.20	10.31

91	600525	长园集团	11,857,190.52	10.25
92	600125	铁龙物流	11,817,985.70	10.21
93	600587	新华医疗	11,760,347.00	10.16
94	600398	海澜之家	11,703,473.93	10.11
95	600846	同济科技	11,598,522.08	10.02
96	600531	豫光金铅	11,447,148.08	9.89
97	601689	拓普集团	11,339,479.24	9.80
98	603618	杭电股份	11,305,574.80	9.77
99	600502	安徽水利	11,244,529.28	9.72
100	600240	华业资本	11,239,689.80	9.71
101	601002	晋亿实业	11,157,627.32	9.64
102	600416	湘电股份	11,113,479.61	9.60
103	600582	天地科技	11,077,322.00	9.57
104	600420	现代制药	11,032,710.54	9.53
105	601098	中南传媒	10,973,045.26	9.48
106	600787	中储股份	10,881,798.89	9.40
107	600571	信雅达	10,803,652.32	9.34
108	600143	金发科技	10,798,599.00	9.33
109	601877	正泰电器	10,774,451.92	9.31
110	600459	贵研铂业	10,773,177.43	9.31
111	600803	新奥股份	10,652,955.86	9.21
112	600756	浪潮软件	10,489,457.80	9.06
113	600635	大众公用	10,475,857.00	9.05
114	600563	法拉电子	10,463,373.25	9.04
115	600729	重庆百货	10,216,745.62	8.83
116	600391	航发科技	10,209,589.65	8.82
117	601166	兴业银行	10,182,952.00	8.80
118	600323	瀚蓝环境	10,176,124.39	8.79
119	600830	香溢融通	10,087,118.60	8.72
120	600251	冠农股份	10,077,421.64	8.71
121	600498	烽火通信	9,999,948.35	8.64
122	600026	中远海能	9,977,518.30	8.62
123	600399	抚顺特钢	9,840,641.61	8.50
124	603766	隆鑫通用	9,803,145.52	8.47
125	601636	旗滨集团	9,747,892.00	8.42
126	600519	贵州茅台	9,626,435.30	8.32
127	600343	航天动力	9,487,011.86	8.20
128	600765	中航重机	9,427,637.17	8.15

129	600720	祁连山	9,407,605.22	8.13
130	600711	盛屯矿业	9,314,281.42	8.05
131	600270	外运发展	9,308,469.91	8.04
132	601020	华钰矿业	9,275,250.00	8.02
133	600491	龙元建设	9,266,998.22	8.01
134	600521	华海药业	9,200,544.52	7.95
135	603000	人民网	9,184,006.00	7.94
136	600891	秋林集团	9,172,763.52	7.93
137	600888	新疆众和	9,125,293.39	7.89
138	600611	大众交通	9,103,178.30	7.87
139	600667	太极实业	9,099,525.00	7.86
140	603165	荣晟环保	9,049,778.00	7.82
141	600426	华鲁恒升	9,046,802.46	7.82
142	600039	四川路桥	8,962,310.00	7.74
143	600990	四创电子	8,896,116.35	7.69
144	600226	瀚叶股份	8,835,157.70	7.63
145	600687	刚泰控股	8,818,404.60	7.62
146	600400	红豆股份	8,810,111.06	7.61
147	600162	香江控股	8,800,940.73	7.61
148	603528	多伦科技	8,782,792.14	7.59
149	600668	尖峰集团	8,626,523.74	7.45
150	600410	华胜天成	8,566,260.39	7.40
151	600761	安徽合力	8,541,956.80	7.38
152	601958	金钼股份	8,453,493.93	7.31
153	603008	喜临门	8,398,879.08	7.26
154	600295	鄂尔多斯	8,362,191.29	7.23
155	600428	中远海特	8,306,890.94	7.18
156	603989	艾华集团	8,263,806.74	7.14
157	600269	赣粤高速	8,261,183.00	7.14
158	600195	中牧股份	8,254,436.42	7.13
159	600458	时代新材	8,230,446.31	7.11
160	601328	交通银行	8,127,495.00	7.02
161	603328	依顿电子	8,072,358.09	6.98
162	600750	江中药业	7,982,641.70	6.90
163	601021	春秋航空	7,963,968.18	6.88
164	600500	中化国际	7,786,727.46	6.73
165	000333	美的集团	7,747,788.00	6.70
166	000651	格力电器	7,735,488.76	6.68

167	603588	高能环境	7,623,588.00	6.59
168	603198	迎驾贡酒	7,560,739.21	6.53
169	601233	桐昆股份	7,406,656.00	6.40
170	600138	中青旅	7,375,343.29	6.37
171	600113	浙江东日	7,305,488.90	6.31
172	600027	华电国际	7,292,271.00	6.30
173	600086	东方金钰	7,198,198.67	6.22
174	600580	卧龙电气	7,094,668.18	6.13
175	600418	江淮汽车	7,009,420.73	6.06
176	600433	冠豪高新	6,950,592.88	6.01
177	600000	浦发银行	6,950,129.48	6.01
178	600838	上海九百	6,929,423.76	5.99
179	600881	亚泰集团	6,809,122.26	5.88
180	000002	万科A	6,784,433.40	5.86
181	600694	大商股份	6,756,001.33	5.84
182	601668	中国建筑	6,748,258.00	5.83
183	600180	瑞茂通	6,746,395.76	5.83
184	600329	中新药业	6,707,362.51	5.80
185	603888	新华网	6,670,200.50	5.76
186	600366	宁波韵升	6,664,050.29	5.76
187	601288	农业银行	6,598,802.00	5.70
188	600350	山东高速	6,541,761.00	5.65
189	600439	瑞贝卡	6,541,049.11	5.65
190	600597	光明乳业	6,534,465.69	5.65
191	601777	力帆股份	6,501,703.68	5.62
192	600062	华润双鹤	6,494,575.32	5.61
193	600743	华远地产	6,390,756.20	5.52
194	600499	科达洁能	6,343,461.45	5.48
195	600054	黄山旅游	6,316,282.85	5.46
196	600651	飞乐音响	6,302,392.30	5.45
197	603639	海利尔	6,283,160.16	5.43
198	603111	康尼机电	6,212,280.50	5.37
199	600757	长江传媒	6,199,646.56	5.36
200	600030	中信证券	6,180,579.00	5.34
201	600594	益佰制药	6,078,868.24	5.25
202	603515	欧普照明	6,069,208.73	5.24
203	603098	森特股份	6,063,911.00	5.24
204	600387	海越股份	6,029,075.71	5.21

205	603308	应流股份	6,026,476.99	5.21
206	600305	恒顺醋业	5,969,202.20	5.16
207	600837	海通证券	5,961,609.19	5.15
208	600856	中天能源	5,845,085.43	5.05
209	603108	润达医疗	5,833,520.20	5.04
210	603169	兰石重装	5,730,559.37	4.95
211	600073	上海梅林	5,712,938.64	4.94
212	600572	康恩贝	5,712,202.80	4.94
213	600486	扬农化工	5,710,546.50	4.93
214	600823	世茂股份	5,707,423.00	4.93
215	600863	内蒙华电	5,702,138.00	4.93
216	600887	伊利股份	5,689,811.56	4.92
217	603077	和邦生物	5,685,747.35	4.91
218	600626	申达股份	5,679,678.37	4.91
219	603355	莱克电气	5,648,111.26	4.88
220	600664	哈药股份	5,608,867.00	4.85
221	600200	江苏吴中	5,601,735.79	4.84
222	600676	交运股份	5,587,460.00	4.83
223	601222	林洋能源	5,569,932.00	4.81
224	600363	联创光电	5,565,166.00	4.81
225	601398	工商银行	5,562,264.00	4.81
226	603239	浙江仙通	5,484,690.00	4.74
227	600642	申能股份	5,450,943.31	4.71
228	600763	通策医疗	5,429,772.00	4.69
229	603929	亚翔集成	5,425,992.72	4.69
230	601799	星宇股份	5,398,697.51	4.67
231	601015	陕西黑猫	5,323,418.00	4.60
232	601169	北京银行	5,315,911.00	4.59
233	601058	赛轮金宇	5,315,711.40	4.59
234	600267	海正药业	5,314,204.00	4.59
235	600352	浙江龙盛	5,147,108.00	4.45
236	600098	广州发展	5,119,552.39	4.42
237	600551	时代出版	5,114,350.00	4.42
238	600261	阳光照明	5,008,550.14	4.33
239	603877	太平鸟	4,991,360.03	4.31
240	600284	浦东建设	4,987,984.97	4.31
241	600754	锦江股份	4,977,651.55	4.30
242	600986	科达股份	4,974,257.00	4.30

243	600557	康缘药业	4,967,389.40	4.29
244	600381	青海春天	4,917,623.44	4.25
245	603898	好莱客	4,878,262.98	4.22
246	601678	滨化股份	4,856,520.79	4.20
247	600973	宝胜股份	4,848,302.30	4.19
248	601766	中国中车	4,803,898.00	4.15
249	600900	长江电力	4,790,998.00	4.14
250	601601	中国太保	4,782,071.00	4.13
251	601016	节能风电	4,758,360.00	4.11
252	600835	上海机电	4,695,567.00	4.06
253	600438	通威股份	4,653,855.61	4.02
254	600173	卧龙地产	4,636,443.44	4.01
255	603228	景旺电子	4,590,085.70	3.97
256	600206	有研新材	4,578,951.00	3.96
257	600818	中路股份	4,526,643.00	3.91
258	603358	华达科技	4,511,134.79	3.90
259	600171	上海贝岭	4,497,712.25	3.89
260	600380	健康元	4,488,364.00	3.88
261	600335	国机汽车	4,470,851.00	3.86
262	603698	航天工程	4,455,230.38	3.85
263	000725	京东方 A	4,451,411.00	3.85
264	600662	强生控股	4,354,274.17	3.76
265	601126	四方股份	4,288,894.64	3.71
266	603556	海兴电力	4,284,815.66	3.70
267	603258	电魂网络	4,241,777.00	3.67
268	603339	四方冷链	4,219,714.03	3.65
269	601211	国泰君安	4,213,105.00	3.64
270	601311	骆驼股份	4,211,787.36	3.64
271	600422	昆药集团	4,204,489.00	3.63
272	000858	五粮液	4,198,599.56	3.63
273	600536	中国软件	4,195,391.00	3.63
274	601567	三星医疗	4,156,657.58	3.59
275	603188	亚邦股份	4,143,064.61	3.58
276	603628	清源股份	4,100,420.00	3.54
277	600824	益民集团	4,090,785.00	3.54
278	601789	宁波建工	4,024,033.00	3.48
279	600276	恒瑞医药	3,979,434.00	3.44
280	603997	继峰股份	3,934,371.50	3.40

281	600648	外高桥	3,868,536.01	3.34
282	000001	平安银行	3,818,472.00	3.30
283	600748	上实发展	3,797,277.40	3.28
284	600299	安迪苏	3,793,021.00	3.28
285	600965	福成股份	3,785,299.82	3.27
286	603368	柳州医药	3,784,851.57	3.27
287	600105	永鼎股份	3,754,363.95	3.24
288	603306	华懋科技	3,738,097.00	3.23
289	603600	永艺股份	3,709,409.49	3.21
290	601968	宝钢包装	3,699,093.00	3.20
291	600612	老凤祥	3,690,020.00	3.19
292	600708	光明地产	3,631,221.11	3.14
293	600859	王府井	3,560,604.43	3.08
294	600377	宁沪高速	3,537,596.86	3.06
295	002415	海康威视	3,519,089.00	3.04
296	600641	万业企业	3,517,416.00	3.04
297	600012	皖通高速	3,515,020.00	3.04
298	600828	茂业商业	3,506,924.31	3.03
299	603883	老百姓	3,506,107.12	3.03
300	600386	北巴传媒	3,486,596.00	3.01
301	600894	广日股份	3,473,875.49	3.00
302	603899	晨光文具	3,464,307.38	2.99
303	600517	置信电气	3,463,169.00	2.99
304	600537	亿晶光电	3,448,041.97	2.98
305	600285	羚锐制药	3,403,394.19	2.94
306	603658	安图生物	3,397,120.23	2.94
307	600736	苏州高新	3,368,735.99	2.91
308	600075	新疆天业	3,328,221.60	2.88
309	600048	保利地产	3,325,891.00	2.87
310	600650	锦江投资	3,302,519.06	2.85
311	603885	吉祥航空	3,287,727.84	2.84
312	600028	中国石化	3,221,382.00	2.78
313	600292	远达环保	3,205,298.76	2.77
314	601390	中国中铁	3,193,160.00	2.76
315	600826	兰生股份	3,169,097.00	2.74
316	600850	华东电脑	3,160,155.77	2.73
317	600998	九州通	3,088,481.94	2.67
318	603737	三棵树	3,072,523.00	2.66

319	600578	京能电力	3,065,853.00	2.65
320	600053	九鼎投资	3,045,781.74	2.63
321	601818	光大银行	3,028,522.00	2.62
322	600518	康美药业	3,014,390.00	2.60
323	601158	重庆水务	2,922,393.93	2.53
324	600975	新五丰	2,915,654.00	2.52
325	600093	易见股份	2,895,303.58	2.50
326	603118	共进股份	2,871,180.89	2.48
327	600280	中央商场	2,835,147.00	2.45
328	603609	禾丰牧业	2,833,557.00	2.45
329	600481	双良节能	2,812,844.40	2.43
330	600019	宝钢股份	2,786,502.00	2.41
331	600015	华夏银行	2,753,842.20	2.38
332	603025	大豪科技	2,745,997.62	2.37
333	600811	东方集团	2,722,899.00	2.35
334	601688	华泰证券	2,721,004.00	2.35
335	603979	金诚信	2,667,887.14	2.31
336	601186	中国铁建	2,665,845.00	2.30
337	600077	宋都股份	2,657,063.36	2.30
338	600831	广电网络	2,621,838.82	2.27
339	600996	贵广网络	2,604,822.00	2.25
340	600775	南京熊猫	2,580,286.00	2.23
341	601006	大秦铁路	2,484,392.10	2.15
342	002304	洋河股份	2,479,083.00	2.14
343	603686	龙马环卫	2,456,411.53	2.12
344	600987	航民股份	2,444,108.74	2.11
345	600526	菲达环保	2,443,083.00	2.11
346	600483	福能股份	2,428,005.35	2.10
347	600310	桂东电力	2,398,170.80	2.07
348	600814	杭州解百	2,387,361.00	2.06
349	000776	广发证券	2,345,210.00	2.03
350	601628	中国人寿	2,317,678.00	2.00

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	3,890,293,932.46
卖出股票收入（成交）总额	3,915,823,170.60



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。

#### 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

本基金本期末未持有股指期货。

##### 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

本基金本期末未持有国债期货。

##### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本期末未持有国债期货。

#### 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	55,499.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,392.07
5	应收申购款	28,702.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,593.61

## 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

## 8.12.5.1 期末指数投资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	600525	长园集团	798,974.00	0.90	重大事项
2	600239	云南城投	716,296.50	0.81	重大事项

## 8.12.5.2 期末积极投资前五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	600309	万华化学	1,866,648.00	2.10	重大事项

## §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
6,610	11,950.93	42,375,275.86	53.64%	36,620,352.18	46.36%

### 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	118.55	0.0002%

### 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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011 年 11 月 22 日）基金份额总额	456,870,635.87
本报告期期初基金份额总额	69,362,668.12
本报告期基金总申购份额	6,074,353,276.51
减:本报告期基金总赎回份额	6,064,720,316.59
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	78,995,628.04

## §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

自 2017 年 1 月 10 日起，唐亚明先生任本基金管理人副总经理；自 2017 年 6 月 19 日起，曹均先生新任本基金管理人董事长。

2017 年 8 月，陈四清先生担任中国银行股份有限公司董事长、执行董事、董事会战略发展委员会主席及委员等职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 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玖万元整，目前该会计师事务所已连续为本基金提供审计服务七个会计年度。

### 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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	

银河证券	15,850,214,770.45	74.94%	5,448,307.03	74.94%	-
天风证券	11,826,605,454.69	23.40%	1,701,114.07	23.40%	-
齐鲁证券	1129,296,877.92	1.66%	120,414.53	1.66%	-

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
银河证券	-	-	1,800,000,000.00	100.00%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-

### 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	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2017 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 1 月 3 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上海基煜基金销售有限公司基金参加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	2017 年 1 月 12 日
3	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通和耕传承基金销售有限公司基金定投业务并参加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	2017 年 1 月 12 日
4	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通上海万得	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2017 年 1 月 12 日

	投资顾问有限公司基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	券日报	
5	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通奕丰金融服务(深圳)有限公司基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年1月12日
6	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加和耕传承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	2017年1月12日
7	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海基煜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	2017年1月12日
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海万得投资顾问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	2017年1月12日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加奕丰金融服务(深圳)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	2017年1月12日
10	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京微动利投资管理有限公司基金定投业务并参加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	2017年1月19日
11	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通浙江金观诚财富管理有限公司基金定投业务并参加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	2017年1月19日
12	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加浙江金观诚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	2017年1月19日
13	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京微动利投资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	2017年1月19日
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首创证券有限责任公司基金申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年1月21日
15	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2016 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	2017年1月21日
16	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通上海华信	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2017年2月15日

	证券有限责任公司基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	券日报	
17	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海华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	2017 年 2 月 15 日
18	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	2017 年 2 月 16 日
19	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 2 月 23 日
20	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通金惠家保险代理有限公司基金定投业务并参加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	2017 年 3 月 16 日
21	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加金惠家保险代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	2017 年 3 月 16 日
22	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通宜信普泽投资顾问(北京)有限公司基金定投业务并参加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	2017 年 3 月 16 日
23	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京格上富信投资顾问有限公司基金定投业务并参加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	2017 年 3 月 21 日
24	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京格上富信投资顾问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	2017 年 3 月 21 日
25	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	2017 年 3 月 30 日
26	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2016 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 3 月 31 日
27	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通济安财富	中国证券报、上海证券报、证券时报、证	2017 年 4 月 6 日



	(北京) 资本管理有限公司基金定投业务并参加申购及定投费率优惠活动的公告	券日报	
28	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加济安财富(北京) 资本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	2017 年 4 月 6 日
29	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整济安财富(北京) 资本管理有限公司基金申购起点金额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 4 月 8 日
30	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通上海凯石财富基金销售有限公司基金定投业务并参加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	2017 年 4 月 13 日
31	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通泰诚财富基金销售(大连) 有限公司基金定投业务并参加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	2017 年 4 月 13 日
32	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海凯石财富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	2017 年 4 月 13 日
33	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加泰诚财富基金销售(大连) 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	2017 年 4 月 13 日
34	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加天津万家财富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	2017 年 4 月 18 日
35	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2017 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	2017 年 4 月 21 日
36	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 4 月 22 日
37	中邮创业基金管理股份有限公司关于参加广发证券股份有限公司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	2017 年 4 月 26 日
38	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通联储证券有限责任公司基金定投业务并参加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	2017 年 5 月 5 日

39	中邮创业基金管理股份有限公司关于开通广发证券股份有限公司基金定投业务并参加定投申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年5月5日
40	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加联储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	2017年5月5日
41	关于中邮创业基金管理股份有限公司开通官方微信平台基金定投业务并参加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	2017年5月18日
42	中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购费率的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年5月24日
43	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通中泰证券股份有限公司基金定投业务并参加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	2017年6月8日
44	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金暂停日常申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年6月20日
45	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海长量基金销售投资顾问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	2017年6月22日
46	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金分红公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年6月23日
47	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京肯特瑞财富投资管理有限公司基金定投业务并参加认、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	2017年6月29日
48	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资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	2017年6月29日
49	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年6月30日
50	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金更新招募说明书(2017年第2号)	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017年7月1日

51	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司网上银行基金申购手续费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	2017 年 7 月 1 日
52	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2017 年第 2 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 21 日
53	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西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	2017 年 7 月 27 日
54	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通华泰证券股份有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 7 月 29 日
55	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海长量基金销售投资顾问有限公司申购起点金额并参加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	2017 年 8 月 11 日
56	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、大泰金石基金销售有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 8 月 17 日
57	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司、大泰金石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	2017 年 8 月 17 日
58	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2017 年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 8 月 29 日
59	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整代销机构基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 8 月 30 日
60	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金恢复日常申购业务公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 2 日
61	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通国金证券股份有限公司基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 8 日

62	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金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	2017 年 9 月 12 日
63	中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 20 日
64	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整凤凰金信（银川）基金销售有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 25 日
65	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加凤凰金信（银川）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	2017 年 9 月 25 日
66	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海联泰资产管理有限公司开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 25 日
67	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海联泰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	2017 年 9 月 25 日
68	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整北京创金启富投资管理有限公司基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 28 日
69	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京创金启富投资管理有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 9 月 28 日
70	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整北京蛋卷基金销售有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 10 月 12 日
71	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京蛋卷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	2017 年 10 月 12 日
72	中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 10 月 26 日

73	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京汇成基金销售有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 10 月 26 日
74	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2017 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	2017 年 10 月 26 日
75	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加通华财富（上海）基金销售有限公司、南京苏宁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	2017 年 11 月 9 日
76	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加世纪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	2017 年 11 月 9 日
77	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整通华财富（上海）基金销售有限公司、南京苏宁基金销售有限公司申购起点金额并参加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	2017 年 11 月 9 日
78	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通世纪证券有限责任公司基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 11 月 9 日
79	中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 11 月 16 日
80	中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 11 月 23 日
81	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通深圳市新兰德证券投资咨询有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 11 月 23 日
82	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通南京证券股份有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 11 月 30 日
83	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整上海华夏财富投资管理有限公司申购起点	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 12 月 7 日

	金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告		
84	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加上海华夏财富投资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	2017 年 12 月 7 日
85	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	2017 年 12 月 29 日
86	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申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 12 月 29 日
87	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	2017 年 12 月 29 日
88	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2017 年 12 月 29 日

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170621-20170813	-	1,606,683,161.95	1,606,683,161.95	-	-
	2	20170619-20170802	-	1,606,682,519.28	1,606,682,519.28	-	-
	3	20170101-20170615、20170811-20171231	29,428,487.35	11,973,616.01	-	41,402,103.36	52.41%
	4	20170619-20170619	-	642,672,879.18	642,672,879.18	-	-
	5	20170616-20170618	-	44,986,503.86	44,986,503.86	-	-
	6	20170616-20170618	-	51,413,239.07	51,413,239.07	-	-

#### 产品特有风险

单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%引起的风险，主要是由于持有人结构相对集中，机构同质化，资金呈现“大进大出”特点，在市场突变情况下，赎回行为高度一致，给基金投资运作可能会带来较大压力，使得基金资产的变现能力和投资者赎回管理的匹配与平衡可能面临较大考验，继而可能给基金带来潜在的流动性风险。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮上证 380 指数增强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

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

### 13.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：www.postfund.com.cn

中邮创业基金管理股份有限公司

2018 年 3 月 30 日