中邮核心成长混合型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

2018年6月30日

基金管理人:中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2018年8月28日

§1 重要提示

1.1 重要提示

中邮核心成长混合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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司(简称:中国农业银行)根据本基金合同规定,于2018年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2018年01月01日起至06月30日止。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	中邮核心成长混合
基金主代码	590002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007年8月17日
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,304,507,661.87份

2.2 基金产品说明

投资目标	以追求长期资本增值为目的,通过投资于具有核心竞争力且能保持持续增长的企业,在充分控制风险的前提下,分享中国经济快速增长的成果和实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金在投资策略上充分体现“核心”与“成长”相结合的主线。 “核心”体现在通过自上而下的研究,寻找促使宏观经济及产业政策、行业及市场演化的核心驱动因素,把握上述方面未来变化的趋势;从公司治理、公司战略、比较优势等方面来把握公司核心竞争优势。 “成长”主要是指通过建立成长性估值模型来分析评价公司的成长价值,并进行横向比较来发现具有持续成长优势的公司,从而达到精选个股的目的。 1、资产配置策略 本基金在构建和管理投资组合的过程中,主要采取“自上而下”为主的投资方法,做出资产配置及投资组合的构建,并根据宏观、产业景气、市场变化及时调整资产配置比例。 本基金采用战略性资产配置为主,战术性资产配置为辅的配置策略:战略性资产配置首先要确定各类资产的预期回报率和波动率,然后再按照要求对满足风险收益目标的资产进行混合;战术性资产配置增加了对市场短期趋势判断的重视,把握时机进行仓位调整和波段操作,一般用于短期的资产配置。 2、股票投资策略 (1)行业配置策略 本基金行业配置在资产配置的基础上,遵循自上而下方式。具体方法是: ?基于全球视野下的产业周期的分析和判断 ?基于行业生命周期的分析 ?基于行业内产业竞争结构的分析 (2)个股选择策略 在选定的行业中,选择那些具有明显竞争优势,持续成长能力强且质量出色的企业。股票的选择和组合构建通过以下几个方面进行: ? 企业在行业中的地位和核心竞争力 根据迈克尔?波特的竞争理论,本基金重点投资那些拥有特定垄断资源或不可替代性技术或资源优势,具有较高进入壁垒或者较强定价能力,具有核心竞争力的行业。 ?高成长性 对每一个行业,分析其所处的生命周期阶段。本基金将重点投资处于成长期的行业,对这些行业给予相对较高估值。 ? 企业的质量 本基金认为,,只有注重企业成长的质量和综合治理能力才能准确发掘公司的内在价值,降低投资风险。 本基金认为,通过上面核心竞争力、成长性和企业质量三个方面的综合评价而选择出的企业将会充分反映本基金“核心成长”的投资理念,同时再辅以科学、合理的估值方法,可以有效保障本基金实现长期稳定增值的投资目标。 3、债券投资策略 (1)久期管理 久期管理是债券组合管理的核心环节,是提高收益、控制风险的有效手段。 (2)期限结构配置 本基金将在确定组合久期后,结合收益率曲线变化的预测,进行期限结构的配置。主要的配置方式有:梯形组合、哑铃组合、子弹组合。 (3)确定类属配置 类属配置主要体现在对不同类型债券的选择,实现债券组合收益的优化。 (4)个债选择 本基金在综合考虑上述配置原则基础上,通过对个体券种的价值评判,重点考察各券种的收益率、流动性、信用等级,选择相应的最优投资对象。 4、权证投资策略 本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发、配售等原因被动获得权证,或者在进行套利交易、避险交易等情形下主动投资权证。本基金进行权证投资时,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合。 本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深300指数,债券部分的业绩比较基准为中国债券总指数。 本基金的整体业绩比较基准采用: 沪深300指数× 80%+中国债券总指数× 20% 沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数,由中证指数公司编制和维护,是在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的,指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。沪深300指数引进国际指数编制和管理的经验,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关度,且指数历史表现强于市场平均收益水平。因此,本基金认为,该指数能够满足本基金的投资管理需要。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深300指数,债券部分的业绩比较基准为中国债券总指数。 本基金的整体业绩比较基准采用: 沪深300指数× 80%+中国债券总指数× 20% 沪深300指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映A股市场整体走势的指数,由中证指数公司编制和维护,是在上海和深圳证券市场中选取300只A股作为样本编制而成的,指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性。沪深300指数引进国际指数编制和管理的经验,编制方法清晰透明,具有独立性和良好的市场流动性;与市场整体表现具有较高的相关度,且指数历史表现强于市场平均收益水平。因此,本基金认为,该指数能够满足本基金的投资管理需要。
风险收益特征	本基金属于股票型基金,具有较高风险和较高收益的特征。一般情形下,其风险和收益均高于货币型基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	贺倩
	联系电话	010-82295160—157	010-66060069
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010—58511618	95599
传真		010-82295155	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.postfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的办公场所

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	64,300,967.85
本期利润	-647,582,930.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0685
本期基金份额净值增长率	-10.54%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	-0.4087
期末基金资产净值	5,501,389,326.24
期末基金份额净值	0.5913

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,不是当期发生额)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.68%	1.13%	-5.96%	1.02%	1.28%	0.11%
过去三个月	-9.18%	1.02%	-7.48%	0.91%	-1.70%	0.11%
过去六个月	-10.54%	1.07%	-9.47%	0.92%	-1.07%	0.15%
过去一年	-5.03%	0.93%	-2.40%	0.76%	-2.63%	0.17%
过去三年	-43.98%	2.08%	-14.80%	1.19%	-29.18%	0.89%
自基金合同生效起至今	-40.87%	1.87%	-7.89%	1.41%	-32.98%	0.46%

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

本基金业绩衡量基准=沪深300收益率× 80%+中国债券总指数收益率× 20%

沪深300指数作为按流通股本加权的跨两市蓝筹股指数,其指数样本股市值覆盖了上交所和深交所上市的所有股票市值的70%,具有较强的代表意义。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中,需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求,基准指数中沪深300指数和中国债券总指数每日分别计算收益率,然后按80%、20%的比例采取再平衡,再用循环计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

注:按相关法规规定,本基金自基金合同生效日起6个月内为建仓期。报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司成立于2006年5月8日,截至2018年6月30日,本公司共管理38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、中邮安泰双核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 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
刘田	基金经理	2015年12月24日	-	3年	经济学硕士,曾任北京凯盛旭日电子科技有限公司销售工程师、中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员;现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
纪云飞	基金经理	2015年3月30日	-	5年	曾担任首创证券有限责任公司证券投资总部总经理助理、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、基金经理助理;现担任中邮创业基金管理股份有限公司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、中邮安泰双核混合型证券投资基金基金经理。
邵仅伯	基金经理助理	2018年4月24日	-	2年	毕业于清华大学自动化专业,工学硕士。曾就职于甲骨文中国软件系统有限公司、长城证券、宏源证券、中航证券、中国人寿资产管理有限公司。2016年11月加入中邮基金,先后在投资部、专户理财二部工作。现任中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理助理。

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了培训,督促相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的顺利执行,公司与衡泰软件共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金之间的交易价差分析报告,逐一分析得出结论后发送给相关部门和人员。对于报告中产生的异常情况,在做出合理解释后,提请各部门相关人员引起重视,完善公司内部公平交易制度,使之更符合指导意见精神,并避免类似情况再次发生,最后妥善保存分析报告备查。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

进入2018年,随着各国进入紧缩周期,全球复苏呈现趋弱之势。1-6月国内 经济也呈现较为明显的回落特征,受到国内外宏观趋弱影响,A股整体下行,且风格以避险为主导。

总体上2018年上半年美股振幅加剧,A股也跟随波动率加大,市场风格乘机发生了明显的转变;贯穿2017年的蓝筹白马股普遍开始调整,而中小创则接过了上涨的接力棒。我们判断市场存量资金或减量资金博弈、市场震荡行情未变,随着中美贸易或升级以及全球流动性的收紧,我们认为全球资本市场波动率的中枢仍然会持续抬升。

考虑到短期市场情绪波动加剧,我们整体采取更加均衡的配置思路,在投资上更加聚焦于中长期确定性高、有国际竞争力的行业和企业上。同时从业绩增速和市场估值水平来看,市场目前处于磨底的过程中,但是受制于经济增速和资金供给,我们认为市场的估值水平难以有大的提升空间,所以在个股和行业选择过程中,我们加大了对估值、估值与业绩增速的匹配度等要求,增配了部分低估值高增速的行业和个股,减配了部分增速和估值不匹配的个股。

2018年上半年我们的重点配置围绕全球经济复苏和中国经济转型升级,一方面我们继续配置受益于全球经济复苏和中国制造业转型升级的高端装备制造业,另一方面受益于政策面和经济面较强支撑的中高端消费板块也是我们重点配置的方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,本基金份额净值为0.5913元,累计净值0.5913元。份额净值增长率为-10.54%,业绩比较基准增长率为-9.47%。

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年下半年,尽管面临去杠杆、金融条件收紧、贸易摩擦等不利因素,在企业资本开支周期继续深化、地产库存偏低、出口整体稳健等因素支持下到目前为止中国整体增长依然稳健。内外部的环境可能使得下半年政策更加注重增长平稳、提振内需,为改革创造稳定环境。货币政策为了实现全年中性的目标有更加灵活的空间,财政政策可能会更加积极,减税降费的措施继续落地,扶贫等政策可能在内需提振中更加重要。中长期来看,应对贸易摩擦、化解杠杆问题的根本都在于更好地让市场机制发挥作用、激发活力、提高效率,财税、金融、国企等领域的改革有望继续推进。

股票市场目前整体的估值经过市场的调整也将降低至了历史区间低位,但是分板块来看中小市值公司仍然估值很高,消费行业估值也在历史高位,在这种情况下我们认为难有趋势性行情;结构方面,以创业板为代表的中小市值公司估值仍然较高,很多中小市值股票被给予了高成长预期,在估值和预期较高的情况下,未来能否兑现依然存疑。对于部分中大市值公司来说,在长期的竞争中已经形成了坚固的竞争壁垒,资产负债表和现金流十分健康,其成长速度不快却很扎实。这类公司短期来看存在一定的消化估值的压力,但中长期持有仍可预期获取稳健的合理收益。

近年来新老经济分化一直是我们行业配置的框架,过去几年我们持续超配新经济、阶段性配置老经济的策略创造了较好超额收益。展望下半年,尽管宏观层面的不确定性依然会困扰市场,但我们认为消费升级依然是中国最确定、最具持续性的趋势,继续超配大消费与服务、科技硬件等相关领域,如家电、电子、化工等制造业、医疗中的保险等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况,本基金未能满足利润分配条件,故未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中,本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定,对本基金基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,中邮创业基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为,中邮创业基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:中邮核心成长混合型证券投资基金

报告截止日:2018年6月30日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	1,376,590,342.42	1,798,085,172.42
结算备付金		976,351.41	5,455,427.95
存出保证金		1,388,517.30	2,821,070.27
交易性金融资产	6.4.7.2	3,321,349,507.40	4,647,216,318.48
其中:股票投资		3,321,349,507.40	4,644,236,318.48
基金投资		-	-
债券投资		-	2,980,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	804,221,446.33	-
应收证券清算款		23,319,179.43	21,682,303.81
应收利息	6.4.7.5	1,053,431.35	983,499.68
应收股利		-	-
应收申购款		622,333.52	111,983.46
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,529,521,109.16	6,476,355,776.07
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	34,936,601.97
应付赎回款		966,125.71	2,333,617.17
应付管理人报酬		7,087,999.04	8,073,371.57
应付托管费		1,181,333.16	1,345,561.96
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,463,725.48	2,914,596.36
应交税费		15,571,200.00	15,571,200.00
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,861,399.53	1,823,638.61
负债合计		28,131,782.92	66,998,587.64
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	9,304,507,661.87	9,696,505,934.31
未分配利润	6.4.7.10	-3,803,118,335.63	-3,287,148,745.88
所有者权益合计		5,501,389,326.24	6,409,357,188.43
负债和所有者权益总计		5,529,521,109.16	6,476,355,776.07

注:报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.5913元,基金份额总额9,304,507,661.87份。

6.2 利润表

会计主体:中邮核心成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-587,924,758.53	-888,951,220.74
1.利息收入		15,552,130.59	9,970,189.43
其中:存款利息收入	6.4.7.11	15,047,092.67	9,635,646.42
债券利息收入		1,232.70	546.61
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		503,805.22	333,996.40
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		108,344,828.32	-768,368,665.36
其中:股票投资收益	6.4.7.12	65,273,235.48	-784,478,617.41
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,787,989.45	-1,443.91
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	41,283,603.39	16,111,395.96
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-711,883,898.58	-130,627,364.82
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	62,181.14	74,620.01
减:二、费用		59,658,172.20	73,912,060.46
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	45,744,487.03	49,113,880.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	7,624,081.15	8,185,646.81
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,996,457.84	16,334,229.87
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		4.43	-
7. 其他费用	6.4.7.20	293,141.75	278,303.43
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-647,582,930.73	-962,863,281.20
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-647,582,930.73	-962,863,281.20

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:中邮核心成长混合型证券投资基金

本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,696,505,934.31	-3,287,148,745.88	6,409,357,188.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-647,582,930.73	-647,582,930.73
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)	-391,998,272.44	131,613,340.98	-260,384,931.46
其中:1.基金申购款	71,485,982.70	-25,523,969.72	45,962,012.98
2.基金赎回款	-463,484,255.14	157,137,310.70	-306,346,944.44
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	9,304,507,661.87	-3,803,118,335.63	5,501,389,326.24

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	9,839,725,413.94	-2,739,842,107.93	7,099,883,306.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-962,863,281.20	-962,863,281.20
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)	-132,840,423.87	38,966,595.33	-93,873,828.54
其中:1.基金申购款	222,919,333.53	-74,003,334.66	148,915,998.87
2.基金赎回款	-355,759,757.40	112,969,929.99	-242,789,827.41
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	9,706,884,990.07	-3,663,738,793.80	6,043,146,196.27

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

______曹均______　　______曹均______　　____吕伟卓____

基金管理人负责人　　主管会计工作负责人　　会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮核心成长混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2007]219号《关于同意中邮核心成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮核心成长股票型证券投资基金基金合同》发起,并于2007年8月17日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集包括认购资金利息共募集14,956,625,039.16元,业经北京京都会计师事务所有限责任公司北京京都验字(2007)第045号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中邮核心成长股票型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下,本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、权证、短期金融工具以及证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的比例为0%-40%。(其中,权证的投资比例为基金资产净值的0%-3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的10%),并保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

根据中邮创业基金管理股份有限公司2015年8月7日发布的《中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金更名的公告》,本基金自2015年8月7日起变更为混合型证券投资基金,基金代码保持不变,更名前基金全称为“中邮核心成长股票型证券投资基金”,更名后基金全称为“中邮核心成长混合型证券投资基金”。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制,执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定(统称“企业会计准则”)和中国证券业协会2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会2010年2月8日颁布的证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期本基金所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

6.4.6 税项

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》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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中邮创业基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 成交金额	占当期股票成交总额的比例
首创证券有限责任公司	0.00	0.00%	118,857,033.64	0.78%

6.4.8.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
首创证券有限责任公司	0.00	0.00%	0.00	0.00%

关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
首创证券有限责任公司	110,691.57	1.08%	0.00	0.00%

注:上述交易佣金按市场佣金率计算,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取,并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	45,744,487.03	49,113,880.35
其中:支付销售机构的客户维护费	7,104,833.91	8,049,658.44

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人报酬按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值× 1.50%/当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,624,081.15	8,185,646.81

注:支付基金托管人中国农业银行的基金托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费=前一日基金资产净值× 0.25%/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注:本报告期内及上年度可比期间本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券交易(含回购)。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
基金合同生效日(2007年8月17日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	2,137,475.38	2,137,475.38
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	2,137,475.38	2,137,475.38
期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0200%	0.0200%

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注:本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	1,376,590,342.42	13,244,048.17	690,052,055.69	8,846,964.20

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注:本报告期内及上年度可比期间,本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位:人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别:股票

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002340	格林美	2015年11月17日	2018年11月18日	非公开发行流通受限	9.50	5.68	27,368,420	99,999,995.42	155,452,625.60	-
002340	格林美	2015年11月17日	2019年11月18日	非公开发行流通受限	9.50	5.35	27,368,421	99,999,999.08	146,421,052.35	-
600622	光大嘉宝	2016年2月5日	2019年2月3日	非公开发行流通受限	10.81	6.55	11,725,220	74,999,780.00	76,800,191.00	-
600622	光大嘉宝	2016年2月5日	2020年2月3日	非公开发行流通受限	10.81	6.36	11,725,220	74,999,780.00	74,572,399.20	-

注:1.以上非公开发行的股票估值方法为:

自2017年12月28日起,对上述非公开发行的股票估值方法进行调整,详见2017年12月29日基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司《关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告》。

2.光大嘉宝(600622)2018年6月15日实施分红:10转3股 派2.1元(含税);格林美(002340)2018年5月29日实施分红:10派0.26元(含税)。

6.4.9.2 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
002617	露笑科技	2018年5月9日	重大事项	7.40	-	-	21,294,450	199,903,982.31	157,578,930.00	-
002426	胜利精密	2018年6月19日	重大事项	3.60	2018年7月3日	3.26	1,750,000	10,740,062.00	6,300,000.00	-

注:1.按照证监会公告[2008]38号-《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》以及《中国证券业协会基金估值小组停牌股票估值的参考方法》的要求,上述股票中露笑科技(002617)按“指数收益法”进行估值。

2.上述股票自其复牌之日起且其交易体现了活跃市场交易特征后,将按市场价格进行估值。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	3,321,349,507.40	60.07
	其中:股票	3,321,349,507.40	60.07
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	804,221,446.33	14.54
	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	1,377,566,693.83	24.91
8	其他各项资产	26,383,461.60	0.48
9	合计	5,529,521,109.16	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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	489,115,028.83	8.89
C	制造业	2,144,772,070.09	38.99
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	38,746,649.10	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	197,894,127.73	3.60
J	金融业	251,894,000.00	4.58
K	房地产业	151,372,590.20	2.75
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	47,555,041.45	0.86
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,321,349,507.40	60.37

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。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	002340	格林美	54,736,841	301,873,677.95	5.49
2	002456	欧菲科技	17,334,547	279,606,243.11	5.08
3	000651	格力电器	5,600,000	264,040,000.00	4.80
4	601318	中国平安	4,300,000	251,894,000.00	4.58
5	300033	同花顺	5,091,179	197,894,127.73	3.60
6	600362	江西铜业	10,763,500	170,601,475.00	3.10
7	601225	陕西煤业	20,746,500	170,536,230.00	3.10
8	002008	大族激光	3,162,433	168,209,811.27	3.06
9	600019	宝钢股份	21,499,976	167,484,813.04	3.04
10	002617	露笑科技	21,294,450	157,578,930.00	2.86

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	428,464,185.39	6.68
2	002185	华天科技	251,645,379.04	3.93
3	002241	歌尔股份	129,359,607.00	2.02
4	600028	中国石化	122,634,126.85	1.91
5	600703	三安光电	105,229,969.07	1.64
6	300033	同花顺	92,646,504.00	1.45
7	002415	海康威视	89,743,842.27	1.40
8	601111	中国国航	53,839,636.72	0.84
9	601857	中国石油	53,445,155.88	0.83
10	300628	亿联网络	42,557,596.60	0.66
11	600048	保利地产	24,191,896.00	0.38
12	002078	太阳纸业	24,053,168.94	0.38
13	600038	中直股份	22,803,485.00	0.36
14	600029	南方航空	15,444,514.00	0.24
15	002630	华西能源	14,534,680.00	0.23
16	601899	紫金矿业	11,970,000.00	0.19
17	002508	老板电器	11,131,435.08	0.17
18	002426	胜利精密	10,740,062.00	0.17
19	600426	华鲁恒升	8,676,489.80	0.14
20	002008	大族激光	8,082,614.00	0.13

注:买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填写,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	416,637,819.85	6.50
2	002185	华天科技	309,686,958.18	4.83
3	001979	招商蛇口	280,243,975.08	4.37
4	002456	欧菲科技	142,668,192.87	2.23
5	601318	中国平安	127,292,416.31	1.99
6	300628	亿联网络	125,763,007.81	1.96
7	000725	京东方A	120,882,369.09	1.89
8	601818	光大银行	93,633,634.00	1.46
9	002445	中南文化	87,019,801.13	1.36
10	002617	露笑科技	83,760,241.20	1.31
11	601699	潞安环能	74,045,251.61	1.16
12	600643	爱建集团	59,842,745.75	0.93
13	601225	陕西煤业	50,009,951.39	0.78
14	300033	同花顺	31,665,383.40	0.49
15	002630	华西能源	29,686,186.36	0.46
16	600048	保利地产	26,309,224.07	0.41
17	600582	天地科技	22,521,618.71	0.35
18	002214	大立科技	22,330,000.00	0.35
19	603158	腾龙股份	18,091,045.80	0.28
20	300156	神雾环保	15,252,930.82	0.24

注:卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	1,522,988,058.64
卖出股票收入(成交)总额	2,199,264,206.62

注:买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注:本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注:本基金本报告期末未持有债券。

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

注:本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注:本报告期本基金未进行的贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同中对投资范围的规定,本基金不参与国债期货的投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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。

7.12.2

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,388,517.30
2	应收证券清算款	23,319,179.43
3	应收股利	-
4	应收利息	1,053,431.35
5	应收申购款	622,333.52
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,383,461.60

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注:本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	002340	格林美	301,873,677.95	5.49	非公开发行,流通受限
2	002617	露笑科技	157,578,930.00	2.86	重大事项

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
640,082	14,536.43	491,939,635.36	5.29%	8,812,658,026.51	94.71%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	32,396.62	0.0003%

注:本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为0~10万份。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2007年8月17日)基金份额总额	14,956,625,039.16
本报告期期初基金份额总额	9,696,505,934.31
本报告期基金总申购份额	71,485,982.70
减:本报告期基金总赎回份额	463,484,255.14
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	9,304,507,661.87

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自2018年5月22日起,孔军先生、朱宗树先生任本基金管理人副总经理;自2018年5月22日起,张静女士、李小丽女士不再担任本基金管理人副总经理。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
财富证券	3	1,295,064,189.11	34.79%	1,206,094.09	34.79%	-
长江证券	2	615,088,553.98	16.52%	572,831.76	16.52%	-
长城证券	2	506,779,131.75	13.61%	471,961.26	13.61%	-
光大证券	2	291,566,930.13	7.83%	271,536.58	7.83%	-
中信建投	3	253,950,462.57	6.82%	236,503.85	6.82%	-
中国中投	2	233,833,272.60	6.28%	217,768.71	6.28%	-
宏信证券	1	217,454,353.95	5.84%	202,517.00	5.84%	-
浙商证券	1	210,862,046.55	5.66%	196,376.33	5.66%	-
广州证券	1	57,361,259.97	1.54%	53,420.66	1.54%	-
兴业证券	2	24,722,977.00	0.66%	23,024.48	0.66%	-
方正证券	1	15,569,087.65	0.42%	14,499.49	0.42%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申银万国	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注:选择专用交易单元的标准和程序:

(1)券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与中邮创业基金管理有限公司有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

(2)券商经纪人具有较强的综合服务能力:能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务;有很强的分析能力,能根据中邮创业基金管理有限公司所管理基金的特定要求,提供研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

(3)券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率:与其他券商经纪人相比,该券商经纪人能够提供最优惠合理的佣金率。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。基金管理人与被选择的证券公司签订委托协议,报中国证监会备案并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	债券回购交易 成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例
财富证券	3,587,920.00	30.97%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	50,000,000.00	14.29%	-	-
光大证券	-	-	300,000,000.00	85.71%	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中国中投	-	-	-	-	-	-
宏信证券	7,997,835.06	69.03%	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申银万国	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

注:无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

中邮创业基金管理股份有限公司

2018年8月28日