中邮核心主题混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018 年 9 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：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 7 月 01 日起至 2018 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中邮核心主题混合
交易代码	590005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年 5 月 19 日
报告期末基金份额总额	621, 790, 277.73 份
投资目标	本基金重点关注中国经济结构调整过程中带来的投资机会，采用主题策略和核心策略相结合的方法筛选核心主题企业，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1. 大类资产配置策略 本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。 2. 股票投资策略 本基金采用主题投资策略与核心投资策略相结合的方法进行股票投资：主题投资策略是自上而下挖掘出可能导致经济结构发生根本性变化的因素，分析这些根本变化的内涵，再形成与之相匹配的投资主题，然后再选择能够受益于该投资主题的上市公司，构建股票组合进行投资。 (1) 主题挖掘 本基金在进行主题挖掘的时候采用纵向和横向相结合的方式，同时关注主题的生命周期。 (2) 主题配置 在主题挖掘的基础上，基金管理人定期召开投资决策委员会会议，由宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员和基金经理对主题进行评估，综合考虑主题发展阶段、主题催化因素、主题市场容量、主题估值水平等因素，确定每个主题的配置权重范围，从而进行主题配置。 (3) 个股选择 本基金通过主题投资策略和核心投资策略相结合的方法构建股票备选库和精选库，重点投资核心主题企业。 备选库的构建 在确立投资主题及投资主题配置比例之后，本基金将选择与投资主题相关联的股票进入备选库，并依据个股的"主题相关度"排序。本基金主要根据企业能够受惠于投资主题的程度来确定"主题相关度"。具体来说，就是由研究员衡量主题因素对企业的主营业务收入、主营业务利润等财务指标的影响程度并打分，作为企业和投资主题的相关度标准。 精选库的构建 在备选库的基础上，精选主题相关度得分高、流动性好、市场估值合理且具有核心竞争力的优质上市公司构成本基金的精选库。 3. 债券投资策略 (1) 平均久期配置 本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，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，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。 (2) 期限结构配置 结合对宏观经济形势和政策的判断，运用统计和数量分析技术，本基金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。 (3) 类属配置 本基金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，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。 (4) 回购套利 本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内，适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率，比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险的套利操作。 4. 权证投资策略 本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。
业绩比较基准	整体业绩比较基准 = 沪深 300 指数× 80%+上证国债指数× 20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 7 月 1 日 － 2018 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	- 85, 410, 902.52
2.本期利润	- 52, 948, 364.87
3.加权平均基金份额本期利润	- 0.0848
4.期末基金资产净值	865, 250, 958.30
5.期末基金份额净值	1.392

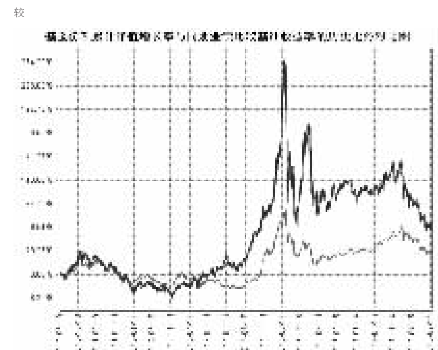
注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	- 5.69%	1.22%	- 1.38%	1.09%	- 4.31%	0.13%

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



注：按相关法规规定，本基金自合同生效日起 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规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈梁	基金经理	2015 年 3 月 13 日	-	8年	曾担任大连实德集团市场专员、华夏基金管理有限公司行业研究员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员，现任中邮创业基金管理股份有限公司投资部副总经理、中邮多策略灵活配置混合基金基金经理、中邮核心主题混合型基金基金经理、中邮稳健合赢债券型基金基金经理。
国晓雯	基金经理	2015 年 8 月 3 日	-	8年	曾任中国人寿资产管理有限公司股票投资部研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员，现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路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基金经理。

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的基金经理注册或变更等通知的日期。

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

目前我们处于是大国关系调整、全球货币环境收缩、中国经济周期下行的三期叠加过程中。经过了上半年的中美冲突加剧和经济去杠杆，7 月 23 日的国常会议和月底的政治局会议基本意味着政策上的转向，经济失速下滑的风险缓释。但在三季度中间陆续出现诸如社保补缴等政策扰动，使得市场情绪出现较大波动，过程中市场震荡下行。

9 月 18 日 2000 亿关税落地，在明确未来关税路径图(2019 年关税税率加征至 25%，后如遇反击，或对另外 2670 亿美元中国商品加征关税)和中方应对模式后，市场遇利空不跌，开始憧憬国内持续回暖的政策，到 9 月底市场进入快速反弹阶段。三季度上证综指下跌 0.92%，创业板综指下跌 11.84%，Wind 全 A 指数下跌 4.81%。

三季度本基金整体保持了较低仓，但结构上不佳，持有较多消费标的。随着棚改货币化政策的调整，市场对消费可持续性的担心加剧，以白酒、家电为代表的消费股出现了明显调整，此外组合中配置较重的分众等泛消费标的也受到了较大的拖累。其后，组合对结构进行了持续调整，目前以自下而上呈现景气的子行业和公司为重点配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.392 元，累计净值 1.552 元。份额净值增长率为 -5.69%，业绩比较基准增长率为 -1.38%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	717, 067, 186.37	82.08
	其中：股票	717, 067, 186.37	82.08
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	150, 940, 715.90	17.28
8	其他资产	5, 597, 148.94	0.64
9	合计	873, 605, 051.21	100.00

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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	55, 240, 000.00	6.38
C	制造业	354, 106, 292.56	40.93
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	18, 872, 000.00	2.18
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	133, 336, 506.78	15.41
J	金融业	17, 738, 000.00	2.05
K	房地产业	114, 797, 487.03	13.27
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9, 486, 900.00	1.10
R	文化、体育和娱乐业	13, 490, 000.00	1.56
S	综合	-	-
	合计	717, 067, 186.37	82.87

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000860	顺鑫农业	1, 050, 000	47, 880, 000.00	5.53
2	600622	光大嘉宝	8, 117, 639	45, 052, 896.33	5.21
3	300470	日机密封	1, 449, 998	36, 496, 449.66	4.22
4	300559	佳发教育	960, 060	35, 848, 640.40	4.14
5	600845	宝信软件	1, 300, 060	31, 864, 470.60	3.68
6	600519	贵州茅台	40, 000	29, 200, 000.00	3.37
7	002376	新北洋	1, 600, 000	28, 368, 000.00	3.28
8	600339	中油工程	5, 000, 000	28, 200, 000.00	3.26
9	002304	洋河股份	220, 000	28, 160, 000.00	3.25
10	603826	坤彩科技	2, 100, 080	27, 847, 060.80	3.22

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与股指期货的投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	907, 026.22
2	应收证券清算款	4, 405, 782.62
3	应收股利	-
4	应收利息	46, 167.25
5	应收申购款	238, 172.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5, 597, 148.94

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600622	光大嘉宝	45, 052, 896.33	5.21	非公开发行

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	625, 924, 935.96
报告期期间基金总申购份额	13, 752, 734.68
减：报告期期间基金总赎回份额	17, 887, 392.91
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	621, 790, 277.73

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	981, 216.06
报告期期间买入／申购总份额	-
报告期期间卖出／赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	981, 216.06
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.16

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮核心主题混合型证券投资基金募集的文件
2.《中邮核心主题混合型证券投资基金基金合同》
3.《中邮核心主题混合型证券投资基金托管协议》
4.《中邮核心主题混合型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 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 10 月 24 日

中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018 年 9 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：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 07 月 01 日起至 2018 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中邮新思路灵活配置混合
交易代码	001224
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年 11 月 11 日
报告期末基金份额总额	28, 415, 812.50 份
投资目标	本基金将灵活应用各种金融工具和风险对冲策略降低投资组合风险，实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金通过多种绝对收益策略、多种交易品种的操作，有效地规避市场的系统性风险。同时在严格控制风险敞口的前提下，捕捉套利机会和趋势性交易机会，力求为基金份额持有人赢取稳定的绝对收益。 （一）股票绝对收益投资策略 本策略积极依托基金管理人投研平台的研究能力进行积极主动的个股选择策略，通过定量与定性相结合的分析方法考量上市公司的盈利状况、估值水平、市场情绪、股价催化剂等因素，辅以量化投资模型从基金管理人的股票库中精选股票，努力获取超额收益，同时在金融衍生品市场上对冲，剥离系统性风险，力争实现较为稳定的绝对收益。在构建投资组合的过程中，本基金将遵循以下投资策略： 1. 定性与定量相结合构建股票组合 本基金选取具有良好投资价值的股票作为投资对象，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，通过定量和定性相结合的方法精选个股。 2. 市场中性策略 现阶段本基金将利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。基金经理根据市场的变化，现货市场与期货市场的相关性等因素，计算需要用到的期货合约数量，对这个数量进行动态跟踪与测算，同时，综合考虑各个月份期货合约之间的定价关系、套利机会、流动性以及保证金要求等因素，在不同月份期货合约之间进行动态配置，通过优化股指期货合约的持仓来创造额外收益。另外当本基金出现大量净申购或净赎回的情况时，本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理，根据基金净申购和净赎回的规模，分别买入数量匹配的多头或者空头股指期货合约，并选择适当的时机平仓。随着监管的放开及其他工具流动性增强，我们会优选空头工具，采用最优的多头系统性风险剥离方式。在数量模型的约束下，严格控制运作风险，并根据市场变化趋势，定期对模型进行调整，以改进模型的有效性，最大化超额收益。 （二）其他绝对收益策略 1. 固定收益品种投资策略 本基金投资债券首先综合考量股票组合及股指期货对冲保值对资金的需求，对闲置资金投资债券做出规划，包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等。然后在这些约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、收益率曲线策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。 2. 衍生品投资策略 本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准构成为：金融机构人民币一年期定期存款基准利率（税后）+2%
风险收益特征	本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 7 月 1 日 － 2018 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	- 34, 728.89
2.本期利润	165, 657.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0058
4.期末基金资产净值	30, 248, 776.76
5.期末基金份额净值	1.065

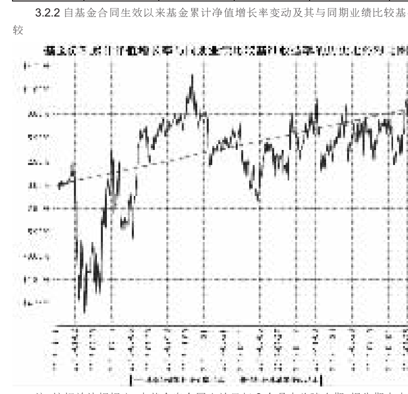
注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.57%	0.87%	0.81%	0.01%	- 0.24%	0.86%

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



注：按相关法规规定，本基金自合同生效日起 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规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
国晓雯	基金经理	2017 年 6 月 27 日	-	8年	曾任中国人寿资产管理有限公司股票投资部研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员，现任中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路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基金经理。

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的基金经理注册或变更等通知的日期。

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

今年三季度市场呈现下跌走势，其中上证指数下跌 0.92%，沪深 300 指数下跌 2.05%，创业板指数下跌 12.16%。期间新思路基金的仓位一直维持在中性偏低的水平，在市场大幅调整过程中，基金净值的回撤幅度得到了有效控制。

今年三季度，政策层面有显著的变化；7 月下旬去杠杆转向稳杠杆，新思路基金重点配置了以银行和保险为主的金融板块；9 月下旬促消费、降税费改革政策细则落地，我们结合消费个股未来 2-3 个季度的业绩趋势判断及前期调整幅度，增加了消费板块股票的配置比例，重点配置了高端白酒板块；9 月中旬新思路基金减持了前期涨幅较大且机构持仓较集中的计算机板块。

展望四季度，我们认为流动性是影响下阶段市场走势的重要因素，全球流动性拐点进一步确认，给全球跨国资金带来了显著的流动性压力。今年四季度需要重点关注国内信用扩张短期是否见效、降低税费举措的实际效果以及美国中期选举结果对中美贸易的影响。

据统计，2010 年以来，每年的 4 月以及 10 和 12 月份低估值个股跑赢高估值个股的概率非常高。今年四季度新思路基金将重点配置低估值金融板块，以及展望 2019 年业绩增速确定性高、估值低的消费板块。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.065 元，累计净值为 1.065 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.57%，业绩比较基准收益率为 0.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内，有连续六十个工作日基金净值低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	14, 999, 586.00	48.10
	其中：股票	14, 999, 586.00	48.10
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	16, 087, 689.77	51.59
8	其他资产	94, 637.96	0.30
9	合计	31, 181, 913.73	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金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4, 715, 800.00	15.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	669, 000.00	2.21
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	2, 965, 136.00	9.80
J	金融业	4, 220, 500.00	13.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	841, 000.00	2.78
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	1, 588, 150.00	5.25
S	综合	-	-
	合计	14, 999, 586.00	49.59

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	20, 000	1, 370, 000.00	4.53
2	600519	贵州茅台	1, 800	1, 314, 000.00	4.34
3	601229	上海银行	100, 000	1, 220, 000.00	4.03
4	000568	泸州老窖	20, 000	950, 200.00	3.14
5	601398	工商银行	150, 000	865, 500.00	2.86
6	601766	中国中车	100, 000	864, 000.00	2.86
7	002707	众信旅游	100, 000	841, 000.00	2.78
8	300454	深信服	10, 000	830, 200.00	2.74
9	000681	视觉中国	30, 000	809, 400.00	2.68
10	603826	坤彩科技	60, 000	795, 600.00	2.63

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。目前衍生品投资策略主要是股指期货套利，即采用股指期货套利的对冲策略积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对收益。股指期货套利包括以下两种方式：

1）期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

2）跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他绝对收益策略。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本基金投资的上海银行股份有限公司(601229)，于 2018 年 1 月 4 日收到了中国银行业监督管理委员会上海监管局行政处罚决定书(沪银监罚决字〔2018〕1 号)。2015 年，上海银行股份有限公司对底层资产为非标准化债权资产的投资投前尽职调查严重不审慎，部分理财资金用于增资和缴交土地出让金，与合同约定用途不一致。依据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第(五)项行政处罚决定，责令其改正，并处以罚款。

除此，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	49, 275.10
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2, 699.68
5	应收申购款	42, 663.18
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	94, 637.96

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	29, 054, 642.87
报告期期间基金总申购份额	884, 028.24
减：报告期期间基金总赎回份额	1, 522, 858.61
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	28, 415, 812.50

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2.《中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3.《中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4.《中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 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 10 月 24 日

中邮战略新兴产业混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

2018 年 9 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：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2018 年 10 月 24 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 07 月 01 日起至 2018 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	中邮战略新兴产业混合
交易代码	590008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年 6 月 12 日
报告期末基金份额总额	799, 620, 116.25 份
投资目标	本基金重点关注国家战略性新兴产业发展过程中带来的投资机会，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	1. 大类资产配置策略 本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。 2. 股票投资策略 本基金采用主题投资策略，通过对战略性新兴产业发展状况持续跟踪，结合对国家政策的解读、重大科技和工艺创新情况调研、上市公司战略规划及商业运营模式分析等方法挖掘属于战略性新兴产业范畴的投资主题及相关股票，作为重点进行投资，分享这类企业带来的较高回报。 3. 债券投资策略 (1) 平均久期配置 本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，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，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。当预期市场利率上升时，本基金将缩短债券投资组合久期，以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时，本基金将拉长债券投资组合久期，以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。 (2) 期限结构配置 结合对宏观经济形势和政策的判断，运用统计和数量分析技术，本基金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。在预期收益率曲线趋向平坦化时，本基金将采取哑铃型策略，重点配置收益率曲线的两端。当预期收益率曲线趋向陡峭化时，采取子弹型策略，重点配置收益率曲线的中部。当预期收益率曲线不变或平行移动时，则采取梯形策略，债券投资资产在各期限间平均配置。 (3) 类属配置 本基金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，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。根据中国债券市场存在市场分割的特点，本基金将考察相同债券在交易所市场和银行间市场的利差情况，结合流动性等因素的分析，选择具有更高投资价值的市场进行配置。 (4) 回购套利 本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内，适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率，比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险的套利操作。 4. 权证投资策略 本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。
业绩比较基准	中证新兴产业指数 *75%+ 上证国债指数 *25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2018 年 7 月 1 日 － 2018 年 9 月 30 日)
1.本期已实现收益	- 150, 222, 316.17
2.本期利润	- 140, 538, 222.37
3.加权平均基金份额本期利润	- 0.1745
4.期末基金资产净值	2, 450, 659, 510.31
5.期末基金份额净值	3.065

注：1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	- 5.40%	1.37%	- 4.63%	1.08%	- 0.77%	0.29%

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

注：按相关法规规定，本基金自合同生效日起 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规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨欢	基金经理	2018 年 6 月 22 日	-	7年	曾担任中国银河证券股份有限公司投资研究部分析师、中邮创业基金管理股份有限公司投资研究部行业研究员、基金经理助理、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理，现担任中邮未来新蓝筹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、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的基金经理注册或变更等通知的日期。

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

4.4 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年三季度后期市场出现较大幅度调整。整体来看，上证指数下跌 0.92%，创业板指数下跌 12.16%。从板块来看，表现居前的板块：银行(中信)上涨 12.41%，石油石化(中信)上涨 11.60%，非银金融(中信)上涨 5.46%，表现较差的板块为：家电(中信)下跌 17.34%，纺织服装(中信)下跌 15.34%，电子元器件(中信)下跌 14.91%。

三季度我们判断经济将缓慢下行，财政政策和货币政策逐步转向，贸易战对市场影响边际减弱，市场会有结构性机会，我们沿着行业景气度以及业绩趋势方向配置了云计算、5G、军工以及石油石化等行业，7-8 月取得较好的相对收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.065 元，累计净值为 3.065 元；本报告期基金份额净值增长率为 -5.40%，业绩比较基准收益率为 -4.63%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警的说明。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1, 820, 218, 940.52	73.20
	其中：股票	1, 820, 218, 940.52	73.20
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	662, 886, 741.75	26.66
8	其他资产	3, 395, 721.37	0.14
9	合计	2, 486, 501, 403.64	100.00

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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1, 182, 804, 616.74	48.26
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	9, 336, 192.00	0.38
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	628, 078, 131.78	25.63
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1, 820, 218, 940.52	74.27

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 报告期末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。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300324	旋极信息	21, 072, 662	161, 627, 317.54	6.60
2	300747	锐科激光	659, 810	104, 249, 980.00	4.25
3	300454	深信服	1, 162, 816	96, 536, 984.32	3.94
4	002841	视源股份	1, 515, 522	91, 234, 424.40	3.72
5	300451	创业软件	5, 000, 000	87, 750, 000.00	3.58
6	000977	浪潮信息	3, 499, 904	84, 277, 688.32	3.44
7	600271	航天信息	2, 999, 864	83, 486, 215.12	3.41
8	603228	景旺电子	1, 499, 852	81, 561, 951.76	3.33
9	600038	中直股份	1, 999, 796	79, 711, 868.56	3.25
10	600570	恒生电子	1, 399, 912	77, 289, 141.52	3.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

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

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与股指期货的投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1, 964, 090.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	266, 662.81
5	应收申购款	1, 164, 968.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3, 395, 721.37

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300324	旋极信息	161, 627, 317.54	6.60	重大事项

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	810, 871, 404.42
报告期期间基金总申购份额	39, 434, 503.65
减：报告期期间基金总赎回份额	50, 685, 791.82
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
报告期期末基金份额总额	799, 620, 116.25

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	407, 250.98
报告期期间买入／申购总份额	-
报告期期间卖出／赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	407, 250.98
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.05

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮战略新兴产业混合型证券投资基金募集的文件
2.《中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金合同》
3.《中邮战略新兴产业混合型证券投资基金托管协议》
4.《中邮战略新兴产业混合型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 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 10 月 24 日