

中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金

[2012] 第二季度报告

基金管理人:中邮创业基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司

报告送出日期:2012年7月19日

基金管理人的董事、监事、高级管理人员及基金经理等人员不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性、完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据与本基金于2012年07月17日复核了本报告中的财务指标、净值表现、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。

基金管理人不以任何形式向投资人承诺收益或避免损失，投资人投资于基金前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金报告的财务资料未经审计。

本报告期自2012年04月01日起至2012年06月30日止。

§ 2 基金产品概况

中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金

交易代码 590003

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2009年10月28日

报告期末基金份额总额 1,869,942,933.42份

报告期净值增长率 -0.24%

报告期净值增长率标准差 1.01%

报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率的差额 1.83%

报告期净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动的比较 -0.32%

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 -23,554,967.18

2.本期利润 10,342,528.76

3.加权平均基金份额本期利润 0.0054

4.期末基金份额净值 1,573,505,857.30

5.期末基金份额净值 0.841

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以扣费列示。

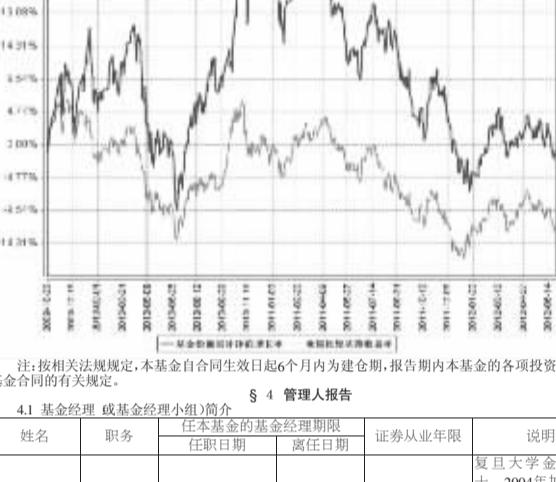
3.2.1 本期报告期末基金份额净值增长率为及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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 收益率差④

过去三个月 0.48% 0.86% 0.63% 0.67% -0.15% 0.19%

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

基金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:按相关法规规定，本基金自合同生效之日起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 基金管理人(基金管理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明

李安心 基金经理 2008年9月1日 - 8年

注:基金管理人的日期及任职日期指基金成立日或公司董事会决议日期。

基金管理人对从业人员资格管理的规定的说明

在报告期内，本公司严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究、投资、交易等方面受到平等对待，未发现不公平交易的情况。

报告期内，本公司严格执行了投资决策、授权限制等方面的约定，执行行为符合规定。

报告期内，本公司严格执行了投资决策、授权限制等方面的约定，执行行为符合规定。

报告期内，本公司严格执行了投资决策、授权限制等方面的约定，执行行为符合规定。

4.2 管理人对旗下基金的公平交易执行情况

在证监会公告《公开募集证券投资基金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，督促相关人严格遵守该制度。为确保该制度的顺利执行，公司与相关部门共同开发了公平交易系统，并每月度对交易部、投资部、风控部门进行公平交易系统的定期检查。

5.7 报告期内本公司旗下基金是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。

否

5.9 其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 1,511,336.60

2 应收证券清算款 -

3 应收股利 -

4 应收利息 7,497,540.81

5 应收申购款 34,617.75

6 其他应收款 -

7 银行存款和结算备付金 50,273.65

8 其他 -

9 合计 9,093,768.81

5.6 前十名证券资产净值占比大小排名的前十名资产支持证券投资明细

5.7 声明基金投资的前十名债券品种未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.9 其他资产构成为各只基金之交割凭证为凭证，为凭证，无交割凭证。

4.4 报告期内基金投资组合和业绩表现说明

4.5 报告期内基金投资组合和运作分析

4.6 基金管理人对宏观经济形势的判断

4.7 基金管理人对行业及市场的评价

4.8 基金管理人对估值方法的说明

4.9 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.10 基金管理人对行业及市场的评价

4.11 基金管理人对估值方法的说明

4.12 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.13 基金管理人对行业及市场的评价

4.14 基金管理人对估值方法的说明

4.15 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.16 基金管理人对行业及市场的评价

4.17 基金管理人对估值方法的说明

4.18 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.19 基金管理人对行业及市场的评价

4.20 基金管理人对估值方法的说明

4.21 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.22 基金管理人对行业及市场的评价

4.23 基金管理人对估值方法的说明

4.24 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.25 基金管理人对行业及市场的评价

4.26 基金管理人对估值方法的说明

4.27 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.28 基金管理人对行业及市场的评价

4.29 基金管理人对估值方法的说明

4.30 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.31 基金管理人对行业及市场的评价

4.32 基金管理人对估值方法的说明

4.33 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.34 基金管理人对行业及市场的评价

4.35 基金管理人对估值方法的说明

4.36 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.37 基金管理人对行业及市场的评价

4.38 基金管理人对估值方法的说明

4.39 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.40 基金管理人对行业及市场的评价

4.41 基金管理人对估值方法的说明

4.42 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.43 基金管理人对行业及市场的评价

4.44 基金管理人对估值方法的说明

4.45 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.46 基金管理人对行业及市场的评价

4.47 基金管理人对估值方法的说明

4.48 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.49 基金管理人对行业及市场的评价

4.50 基金管理人对估值方法的说明

4.51 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.52 基金管理人对行业及市场的评价

4.53 基金管理人对估值方法的说明

4.54 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.55 基金管理人对行业及市场的评价

4.56 基金管理人对估值方法的说明

4.57 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.58 基金管理人对行业及市场的评价

4.59 基金管理人对估值方法的说明

4.60 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.61 基金管理人对行业及市场的评价

4.62 基金管理人对估值方法的说明

4.63 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.64 基金管理人对行业及市场的评价

4.65 基金管理人对估值方法的说明

4.66 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.67 基金管理人对行业及市场的评价

4.68 基金管理人对估值方法的说明

4.69 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.70 基金管理人对行业及市场的评价

4.71 基金管理人对估值方法的说明

4.72 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.73 基金管理人对行业及市场的评价

4.74 基金管理人对估值方法的说明

4.75 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.76 基金管理人对行业及市场的评价

4.77 基金管理人对估值方法的说明

4.78 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.79 基金管理人对行业及市场的评价

4.80 基金管理人对估值方法的说明

4.81 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.82 基金管理人对行业及市场的评价

4.83 基金管理人对估值方法的说明

4.84 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.85 基金管理人对行业及市场的评价

4.86 基金管理人对估值方法的说明

4.87 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.88 基金管理人对行业及市场的评价

4.89 基金管理人对估值方法的说明

4.90 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.91 基金管理人对行业及市场的评价

4.92 基金管理人对估值方法的说明

4.93 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.94 基金管理人对行业及市场的评价

4.95 基金管理人对估值方法的说明

4.96 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.97 基金管理人对行业及市场的评价

4.98 基金管理人对估值方法的说明

4.99 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.100 基金管理人对行业及市场的评价

4.101 基金管理人对估值方法的说明

4.102 基金管理人对宏观经济形势的判断及后市展望

4.103 基金管理人对行业及市场的评价