（上接B69版）

客户服务电话：4006-433-389

公司网址：www.vstonewealth.com

（91）大泰金石基金销售有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路222号南京奥体中心现代五项馆2105室

办公地址：上海市浦东新区峨山路505号东方纯一大厦15楼

法定代表人：袁顾明

电话：021-20324155

传真：021-20324199

联 系 人：赵明

客服电话：400-928-2266

网址：www.dtfunds.com

（92）北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区中关村东路66号1号楼22层2603-06

法定代表人：江卉

联系人：万容

联系电话：010-89188345

客服电话：400-098-8511

传真：010-89188000

公司网址：http://jr.jd.com

（93）深圳前海凯恩斯基金销售有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市福田区福华路355号皇庭中心8楼DE

法定代表人：高锋

电话：0755-82810011

传真：0755-83655518

联 系 人：叶健辉

客服电话：400-804-8688

网址：http://www.foreseakeynes.com/

（94）东方证券股份有限公司

注册地址：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：潘鑫军

联系人：胡月茹

电话：021-63325888

客服电话：95503

网址：http://www.dfzq.com.cn/

（95）南京证券股份有限公司

注册地址：江苏省南京市大钟亭8号

法定代表人：步国旬

联系人：王万君

客服电话：95386

网址：www.njzq.com.cn

（96）联储证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区华强北路圣廷苑酒店B座26楼

办公地址：北京市东城区北三环东路36号环球贸易中心A座27层

法定代表人：沙常明

联系人：丁倩云

联系方式：010-56177851

客户服务电话：400-620-6868

公司网站：www.lczq.com

（97）金惠家保险代理有限公司

注册地址：北京市海淀区东升园公寓1号楼1层南部

办公地址：北京西城区阜成门外大街2号万通新世界A座2107

法定代表人：夏予柱

联系人：胡明哲

电话：010-68091380

传真：010-68091380

客户服务电话：400-855-7333

网址：www.jhjfund.com

（98）北京蛋卷基金销售有限公司

注册地址：北京市朝阳区阜通东大街1号院6号楼2单元2层222507

办公地址：北京市朝阳区阜通东大街望京SOHO T3 A座19层

法定代表人：钟斐斐

电话：010-61840688

传真：010-61840699

联 系 人：袁永姣

客服电话：4000-618-518

网址：www.danjuanapp.com

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择符合要求的机构销售本基金，并及时公告。

（二）注册登记机构

名称：中邮创业基金管理股份有限公司

住所：北京市东城区和平里中街乙16号

办公地址：北京市东城区和平里中街乙16号

法定代表人：曹均

联系人：李淼

电话：010-82295160

传真：010-82292422

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称：山东京鲁律师事务所

住所：济南市文化东路16号中建文化广场A座12层

负责人：姜文钢

电话：0531-55686979

传真：0531-55686969

经办律师：董勤美、张双丽

（四）审计基金财产的会计师事务所

名称：致同会计师事务所（特殊普通合伙）

住所：北京市朝阳区建国门外大街22号赛特广场五层

执行事务合伙人：徐华

联系人：卫俏嫔

联系电话：010-85665232

传真电话：010-85665320

经办注册会计师：卫俏嫔 李惠琦

基金管理人可根据有关法律、法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时履行公告义务。

**四、基金的名称**

本基金名称：中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金

**五、基金的类型**

本基金类型：契约开放式、混合型

**六、投资目标**

本基金重点关注从事或受益于军民融合主题的上市公司，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。

**七、投资范围**

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（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、可转换债券、债券回购、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、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相关规定)。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金股票投资占基金资产的比例为 0%－95%，权证投资占基金资产净值的比例为0%－3%，扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后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%。本基金投资于军民融合主题的证券不低于非现金基金资产的80%。

本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

**八、投资策略**

本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的股票投资策略相结合的方法进行投资。

（一）大类资产配置策略

本基金将根据对宏观经济、政策、市场和行业发展阶段判定当前所处的经济周期，进而科学地指导大类资产配置。通过对各类资产的市场趋势和预期风险收益特征的判定，来确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例，规避系统性风险。

本基金将综合运用定量和定性分析手段，通过对宏观经济指标、政策层面因素、市场层面因素及行业层面因素等多种指标的综合分析，从宏观、中观、微观等多个角度，综合考虑整体资产组合的风险、收益、流动性及各类资产相关性等因素，对大类资产配置比例进行灵活优化，精选具有内在价值和成长潜力的股票和流动性好、到期收益率与信用质量相对较高的债券等资产构建投资组合。

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。

（二）股票投资策略

本基金采用主题投资策略围绕军民融合这一主题进行投资，选择具有长期持续增长能力的、具有核心竞争力的军民融合主题的上市公司股票进行投资。

1、军民融合主题的定义

本基金所指的军民融合主题是由国防安全技术研发、国防生产建设以及由军工技术衍生的民用应用领域所涉及的相关公司组成，主要包括航空、航天、兵器、船舶、通信、电子、信息安全等子行业。具体来讲，军民融合主题的涵盖范围包括：

1）航空：包括从事民用和军用航空器整机及配件研究、生产、销售、维修或其他相关业务的公司；

2）航天：包括从事航天器制造和发射，民用及军用卫星通信、导航、遥感、测绘相关业务的公司；

3）兵器：包括从事面向陆、海、空、天以及各军兵种研发生产武器装备、技术服务或其他相关业务的公司；

4）船舶：包括从事民用和军用船舶、海上平台及配套设施等领域的设备制造、技术服务、维修或其他相关业务的公司；

5）通信：包括从事通信设备及配套设施制造、技术服务、增值服务或其他相关业务的公司；

6）电子：包括从事电子元器件、电子消费品、军工电子产品等领域的设计、开发、制造等相关业务的公司；

7）信息安全：包括从事城市安全、网络安全、通信安全、基础电子产业安全等领域的设备制造、技术服务或其他相关业务的公司。

本基金将对影响军民融合行业涵盖范围的因素进行持续跟踪研究，适时对军民融合主题行业的涵盖范围进行动态调整，并在更新的招募说明书中公告。

若未来由于技术进步或政策变化导致本基金军民融合主题相关行业和公司相关业务的覆盖范围发生变动，基金管理人有权适时对上述定义进行补充和修订。

2、军民融合的投资主题挖掘

在确定了军民融合主题的范畴之后，本基金将进行主题挖掘和主题配置，通过深入分析宏观经济指标和不同行业自身的周期变化特征以及在国民经济中所处的位置，确定在当前宏观背景下适宜投资的重点行业。在投资组合管理过程中，基金管理人也将根据宏观经济形势以及各个行业的基本面特征对行业配置进行持续动态地调整。

军民融合主题行业根据产品或服务类别的不同，可划分为不同的细分子行业。本基金将综合考虑以下因素，对股票资产在军民融合的各细分子行业之间进行配置：

1）军费及相关重大专项主题挖掘

国防军费及相关专项投入将直接影响军民融合各细分子行业的景气度，长期看也将影响各子行业的成长性。本基金将对国防军费及相关专项的投资方向进行持续跟踪研究，适时对军民融合主题行业各细分子行业的景气度变化情况进行研判，超配国防军费和专项重点投向的细分子行业。

2）行业格局主题挖掘

军民融合行业各细分子行业的行业格局不同，导致各细分子行业的竞争结构和盈利能力存在较大差异。本基金将重点投资行业壁垒较高、集中度较高、议价能力较强的细分子行业。

3）政府政策主题挖掘

军民融合行业受政府政策影响较大。本基金将通过对政府政策的分析研究，把握政府政策趋势，重点投资受益于政府政策的细分子行业；不仅投资于优质的国有背景军工企业，也投资于优质的民参军企业。

3、个股选择

第一步，通过主题相关度筛选，构建军民融合主题股票库。

在确定了军民融合范畴和相关投资主题之后，基金管理人每半年末根据股票“主题相关度”指标打分情况，确定军民融合主题的相关股票。在此期间对于未被纳入最近一次筛选范围的股票(如新股上市等)，如果其“主题相关度”可满足标准，也称为军民融合主题相关股票。

本基金主要根据公司战略定位、公司营业收入和利润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。

本基金将军民融合主题的相关股票纳入股票库。

第二步，综合考虑企业成长、价值及盈利特性，构建股票备选库。

本基金重点选择市场估值合理、盈利能力出色且营业收入和利润稳定增长的股票进入备选库。研究员对上市公司的财务报表和经营数据进行分析预测，分别评估企业成长、价值及盈利特性。通过对各项指标设定一定的权重进行加权打分排序，选取排名在前50%的个股进入股票备选库。

建立股票备选库参考指标包括：

（1）成长特性指标：包括营业利润同比增长率、经营性现金流同比增长率、净利润同比增长率、营业收入同比增长率等；

（2）价值特性指标：包括市盈率、市净率、PEG、市销率等；

（3）盈利特性指标：包括净资产收益率、总资产净利率、投入资本回报率、销售净利率等。

由于公司经营状况和市场环境在不断发生变化，基金将实时跟踪上市公司风险因素和成长性因素的变动，对分析指标及其权重设置进行动态调整。

第三步，个股定性分析，构建股票精选库

在股票备选库的基础上，本基金从公司治理结构、公司经营运行等方面对个股进行定性分析，构建股票精选库。

精选库股票在公司治理结构方面需满足以下标准：

（1）主要股东资信良好，持股结构相对稳定，注重中小股东利益，无非经营性占款；

（2）公司主营业务突出，发展战略明晰，具有良好的创新能力和优良的核心竞争力，信息披露透明；

（3）管理规范，企业家素质突出，具有合理的管理层激励与约束机制，建立科学的管理与组织架构。

精选库股票在公司经营运行方面需满足以下标准：

（1）具有持续经营能力和偿债能力，资产负债率合理。具有持续的成长能力，通过对公司商业模式的全方位分析判断公司成长动力来源和持续性；

（2）主营业务稳定运行，收入及利润保持合理增长，资产盈利能力较高；

（3）净资产收益率处在领先水平；

（4）财务管理能力较强，现金收支安排有序；

（5）公司拥有创新能力、专有技术、特许权、品牌、渠道优势、重要客户等；

（三）债券投资策略

在债券投资部分，本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上，对影响个别债券定价的主要因素，包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、合权等因素进行分析，选择具有良好投资价值的债券品种进行投资，确定债券的投资组合。

1、久期策略

根据国内外的宏观经济形势、经济周期、国家的货币政策、汇率政策等经济因素，对未来利率走势做出准确预测，并确定本基金投资组合久期的长短。考虑到收益率变动对久期的影响，若预期利率将持续下行，则增加信用投资组合的久期；相反，则缩短信用投资组合的久期。组合久期选定之后，要根据各相关经济因素的实时变化，及时调整组合久期。考虑信用溢价对久期的影响，若经济下行，预期利率持续下行的同时，长久期产品比短久期产品将面临更多的信用风险，信用溢价要求更高。因此应缩短久期，并尽量配置更多的信用级别较高的产品。

2、期限结构策略

本基金根据国际国内经济形势、国家的货币政策、汇率政策、货币市场的供需关系、投资者对未来利率的预期等因素，对收益率曲线的变动趋势及变动幅度做出预测。收益率曲线的变动趋势包括：向上平行移动、向下平行移动、曲线趋缓转折、曲线陡峭转折、曲线正蝶式移动和曲线反蝶式移动等。本基金根据变动趋势及变动幅度预测来决定信用投资产品组合的期限结构，然后选择采取相应期限结构的策略：子弹策略、杠铃策略或梯式策略。若预期收益曲线平行移动，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小，宜采用子弹策略；若预期收益曲线做趋缓转折，宜采用杠铃策略；若预期收益曲线做陡峭转折，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小宜采用子弹策略。用做判断依据的具体正向及负向变动幅度临界点，需要运用测算模型进行测算。

3、个券选择策略

（1）特定跟踪策略

特定是指某类或某个信用产品具有某种特别的特点，这种特点会造成此类信用产品的价值被高估或者低估。特定跟踪策略，就是要根据特定信用产品的特定特点，进行跟踪和选择。在所有的信用产品中，寻找在持有期内级别上调可能性比较大的产品，并进行配置；对在持有期内级别下调可能性比较大的产品，要进行规避。判断的基础就是对信用产品进行持续内部跟踪评级及对信用评级要素进行持续跟踪与判断，简单的做法就是跟踪特定事件：国家特定政策及特定事件变动态势、行业特定政策及特定事件变动态势、公司特定事件变动态势，并对特定政策及事件对于信用产品的级别变化影响程度进行评估，从而决定对于特定信用产品的取舍。

（2）相对价值策略

本策略的宗旨是要找到价值被低估的信用产品。属于同一个行业、类属同一个信用级别且具有相近期限的不同债券，由于息票因素、流动性因素及其他因素的影响程度不同，可能具有不同的收益水平和收益变动趋势，对同类债券的利差收益进行分析，找到影响利差的因素，并对利差水平的未来走势做出判断，找到价值被低估的个券，进而相应地进行债券置换。本策略实际上是某种形式上的债券互换，也是寻求相对价值的一种投资选择策略。

这种投资策略的一个切实可行的操作方法是：在一级市场上，寻找并配置在同等行业、同等期限、同等信用级别下拥有较高票面利率的信用产品；在二级市场上，寻找并配置同等行业、同等信用级别、同等票面利率下具有较低二级市场信用溢价（价值低估）的信用产品并进行配置。

4、可转换债券的投资策略

1）普通可转换债券投资策略

普通可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值，本基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券。

本基金管理人将对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。

此外，本基金还将根据新发可转换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与一级市场可转债新券的申购。

2）可分离交易可转债

分离交易可转债是指认股权和债券分离交易的可转债，它与普通可转债的区别在于上市后可分离为可转换债券和股票权证两部分，且两部分各自单独交易。也就是说，分离交易可转债的投资者在行使了认股权利后，其债权依然存在，仍可持有到期归还本金并获得利息；而普通可转债的投资者一旦行使了认股权利，则其债权就不复存在了。当可分离交易可转债上市后，对分离出的可转债，其投资策略与本基金普通可转债的投资策略相同；而对分离出的股票权证，其投资策略与本基金权证的投资策略相同。

5、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。

（四）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。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，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。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。

（五）股指期货投资策略

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

**九、业绩比较基准**

本基金股票投资的业绩比较基准为：中证军工指数收益率×60%＋上证国债指数收益率×40%，主要基于以下原因：

本基金的资产主要投资于从事或受益于军民融合主题的证券，投资于军民融合主题的证券不低于非现金基金资产的80%；中证军工指数将符合由十大军工集团控股且主营业务与军工行业相关的上市公司、业务范围涵盖航空、航天、船舶、兵器、军事电子和卫星等军工领域的其他军工类上市公司纳入军工产业主题的范畴，可以综合反映沪深两市属于军民融合主题的公司股票的整体走势。

上证国债指数是以上海证券交易所上市的所有固定利率国债为样本，按照国债发行量加权而成。上证国债指数编制合理、透明、运用广泛，具有较强的代表性和权威性，能够满足本基金的投资管理需要。

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时，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，并按照监管部门的要求履行适当程序，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介上刊登公告。

**十、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高等风险品种。

**十一、投资限制**

1、组合限制

基金的投资组合应遵循以下限制：

（1）本基金股票投资占基金资产的比例为0%－95%；本基金投资于军民融合主题的证券不低于非现金基金资产的80%；

（2）本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当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；

（3）本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的10%；

（4）本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的10%；

（5）本基金持有的全部权证，其市值不得超过基金资产净值的3%；

（6）本基金管理人管理的全部基金持有的同一权证，不得超过该权证的 10%；

（7）本基金在任何交易日买入权证的总金额，不得超过上一交易日基金资产净值的0.5%；

（8）本基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券的比例，不得超过基金资产净值的10%；

（9）本基金持有的全部资产支持证券，其市值不得超过基金资产净值的20%；

（10）本基金持有的同一（指同一信用级别）资产支持证券的比例，不得超过该资产支持证券规模的10%；

（11）本基金管理人管理的全部基金投资于同一原始权益人的各类资产支持证券，不得超过其各类资产支持证券合计规模的10%；

（12）本基金应投资于信用级别评级为BBB以上(含BBB)的资产支持证券。基金持有资产支持证券期间，如果其信用等级下降、不再符合投资标准，应在评级报告发布之日起3个月内予以全部卖出；

（13）基金财产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不超过本基金的总资产，本基金所申报的股票数量不超过拟发行股票公司本次发行股票的总量；

（14）进入全国银行间同业市场的债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的40%。债券回购最长期限为1年，债券回购到期后不得展期；本基金的基金资产总值不得超过基金资产净值的140%；

（15）本基金参与股指期货交易依据以下标准构建组合：

（15.1）本基金在任何交易日日终，持有的买入股指期货合约价值，不得超过基金资产净值的10%；

（15.2）本基金在任何交易日日终，持有的买入期货合约价值与有价证券市值之和不得超过基金资产净值的95%，其中，有价证券指股票、债券（不含到期日在一年以内的政府债券）、权证、资产支持证券、买入返售金融资产（不含质押式回购）等；

（15.3）本基金在任何交易日日终，持有的卖出期货合约价值不得超过本基金持有的股票总市值的20%；

（15.4）本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）应当符合基金合同关于股票投资比例的有关约定，即占基金资产的0%-95%；

（15.5）本基金在任何交易日内交易（不包括平仓）的股指期货合约的成交金额不得超过上一交易日基金资产净值的20%；

（16）法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他投资限制。

因证券、期货市场波动、上市公司合并、基金规模变动等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合上述规定投资比例的，除上述第（12）条的情形外，基金管理人应当在10个交易日内进行调整。但中国证监会规定的特殊情形除外。法律法规另有规定的，从其规定。

基金管理人运用基金财产买卖基金管理人、基金托管人及其控股股东、实际控制人或者与其有重大利害关系的公司发行的证券或者承销期内承销的证券，或者从事其他重大关联交易的，应当符合基金的投资目标和投资策略，遵循持有人利益优先原则，防范利益冲突，建立健全内部审批机制和评估机制，按照市场公平合理价格执行。相关交易必须事先得到基金托管人的同意，并按法律法规予以披露。重大关联交易应提交基金管理人董事会审议，并经过三分之二以上的独立董事通过。基金管理人董事会应至少每半年对关联交易事项进行审查。

基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。期间，本基金的投资范围、投资策略应当符合本基金合同的约定。基金托管人对基金的投资的监督与检查自本基金合同生效之日起开始。

法律法规或监管部门取消上述限制，如适用于本基金，基金管理人在履行适当程序后，则本基金投资不再受相关限制。

**十二、禁止行为**

为维护基金份额持有人的合法权益，基金财产不得用于下列投资或者活动：

（1）承销证券；

（2）违反规定向他人贷款或者提供担保；

（3）从事承担无限责任的投资；

（4）买卖其他基金份额，但是国务院证券监督管理机构另有规定的除外；

（5）向其基金管理人、基金托管人出资；

（6）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；

（7）法律、行政法规和国务院证券监督管理机构规定禁止的其他活动。

上述组合限制、禁止行为的设定依据为本基金合同生效时法律法规及监管机关的要求，如果法律法规或监管机关对上述组合限制、禁止行为进行调整的，基金管理人将按照调整后的规定执行。

**十三、基金的投资组合报告**

本投资组合报告期为2017年7月1日起至9月30日止。

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 | 118,255,501.85 | 67.56 |
| | 其中：股票 | 118,255,501.85 | 67.56 |
| 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 | 56,196,424.23 | 32.10 |
| 8 | 其他资产 | 598,429.84 | 0.34 |
| 9 | 合计 | 175,050,355.92 | 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.

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

3、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 | 102,384,200.00 | 59.36 |
| 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 | 7,891,301.85 | 4.57 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 7,980,000.00 | 4.63 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| 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 | 118,255,501.85 | 68.56 |

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。

4、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。

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 | 002664 | 信质电机 | 300,000 | 8,802,000.00 | 5.10 |
| 2 | 002519 | 银河电子 | 1,000,000 | 8,700,000.00 | 5.04 |
| 3 | 600760 | 中航黑豹 | 250,000 | 8,412,500.00 | 4.88 |
| 4 | 300600 | 瑞特股份 | 150,000 | 8,175,000.00 | 4.74 |
| 5 | 600990 | 四创电子 | 140,000 | 8,073,800.00 | 4.68 |
| 6 | 600269 | 赣粤高速 | 1,500,000 | 7,980,000.00 | 4.63 |
| 7 | 600180 | 瑞茂通 | 600,099 | 7,891,301.85 | 4.57 |
| 8 | 000951 | 中国重汽 | 400,000 | 7,616,000.00 | 4.42 |
| 9 | 600038 | 中直股份 | 160,000 | 6,993,600.00 | 4.05 |
| 10 | 300065 | 海兰信 | 300,000 | 6,597,000.00 | 3.82 |

6、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本报告期末本基金未持有债券。

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十名资产支持证券投资明细

注：本报告期末本基金未持有资产支持证券。

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：本报告期末本基金未持有贵金属投资。

9、报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本报告期末本基金未持有权证。

10、报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注：本报告期末本基金未持有股指期货。

11、本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

12、报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：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。

12、投资组合报告附注

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。

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。

13、报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

14、报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

15、基金的业绩

基金管理人承诺以格尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不向投资者保证最低收益。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。

截至2017年9月30日，过去三个月的投资业绩及同期基准的比较如下表所示：

| 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 | 3.36% | 0.51% | 2.84% | 0.76% | 0.52% | -0.25% |

**十四、基金的费用与税收**

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费；

2、基金托管人的托管费；

3、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；

4、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；

5、基金份额持有人大会费用；

6、基金的证券账户开户费及交易费用；

7、基金的银行汇划费用；

8、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.5%÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延至法定节假日、休息日结束之日起3个工作日内或不可抗力情形消除之日起3个工作日内支付。

上述“一、基金费用的种类中第3－7项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；

3、《基金合同》生效前的相关费用；

4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）基金税收

基金财产投资的相关税收，由基金份额持有人承担，基金管理人或者其他扣缴义务人按照国家有关税收征收的规定代扣代缴。本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

**十五、对招募说明书更新部分的说明**

本招募说明书依据《基金法》、《运作办法》、《销售管理办法》、《信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，对本基金管理人于2017年4月1日刊登的本基金招募说明书（《中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》）进行了更新，主要更新的内容如下：

1、在“一、基金管理人”，对基金管理人情况进行了更新；

2、在“四、基金托管人”，对基金托管人情况进行了更新；

3、在“五、相关服务机构”，对基金份额发售机构的内容均进行了更新；

4、在“九、基金的投资”，对基金的组合报告等内容进行了更新；

5、在“二十一、其他应披露事项”，增加了本次更新内容期间的历次公告。

中邮创业基金管理股份有限公司

2017年11月11日

---

证券代码：603169 证券简称：兰石重装 公告编号：临2017-103

# 兰州兰石重型装备股份有限公司 关于持股5%以上股东减持股份计划实施完毕的公告

**本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。**

重要内容提示：

●减持计划的主要内容：公司于2017年7月22日披露了持股5%以上股东金石投资有限公司（以下简称“金石投资”）减持股份计划，减持计划为：自2017年7月22日（金石投资减持计划公告之日）起十五个交易日后的90日内，通过集中竞价交易方式，以不低于10元/股的价格减持不超过 10,254,155 股，即不超过公司总股本的 1.00%。

●减持计划的实施情况：金石投资自2017年8月21日至2017年11月8日，通过集中竞价交易方式累计减持公司股份10,254,749股，占公司总股本的1.00%，减持价格区间为10.00元/股至11.37元/股。截至本公告日，金石投资已完成此前公布的减持股份计划。

公司于2017年11月10日收到金石投资发来的《关于股份减持计划实施完毕的告知函》，金石投资自2017年8月21日至2017年11月8日通过集中竞价交易方式累计减持公司股份10,254,749股，其本次减持公司股份计划实施完毕，现将具体情况公告如下：

一、股东的基本情况

截至本次减持股份计划实施前，金石投资持有公司无限售条件流通股 77,186,766 股，占本公司总股本的 7.53%。根据金石投资出具的《股份减持计划告知函》，公司披露了金石投资减持股份相关计划，具体内容详见公司于2017年 7 月22日刊登在《上海证券报》《证券时报》《证券日报》和上海证券交易所网站（http://www.sse.com.cn）的《关于持股5%以上股东减持股份计划公告》（公告编号：临2017-074号）。

二、股东实施股份减持计划及相关持股变动情况

（一）股东实施减持计划的具体情况

| 股东名称 | 减持期间 | 减持方式 | 减持价格区间（元/股） | 减持股数（股） | 减持比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 金石投资 | 2017.08.21-2017.11.08 | 集中竞价 | 10.00—11.37 | 10,254,749 | 1.00 |

（二）本次减持股份计划的实施遵循此前披露的减持计划进行，但由于金石投资工作人员在2017年11月8日的减持过程中出现误操作，造成实际减持数量超出了本次减持计划所公告的拟减持数量上限（不超过10,254,155 股），超出部分为594股。除此之外，本次减持与此前披露的减持计划及承诺不存在不一致的情况。

（三）股东持股变动情况

| 股东名称 | 减持前持股情况 | | 减持后持股情况 | |
|---|---|---|---|---|
| | 股份数（股） | 持股比例（%） | 股份数（股） | 持股比例（%） |
| 金石投资 | 77,186,766 | 7.53 | 66,932,017 | 6.53 |

三、本次减持对公司的影响

金石投资不属于公司控股股东、实际控制人。本次减持计划实施不会导致上市公司控制权发生变更，不会对公司治理结构、股权结构及持续性经营产生影响。

四、其他说明

金石投资对工作人员误操作造成的与前期减持计划的差异致歉，并表示将加强内部管理，规避此类情形的发生。

五、备查文件

《金石投资关于股份减持计划实施完毕的告知函》

特此公告。

兰州兰石重型装备股份有限公司

董事会

2017年11月11日

---

证券代码：603360 证券简称：百傲化学 公告编号：2017-051

# 大连百傲化学股份有限公司 关于继续使用闲置募集资金进行现金管理的实施公告

**本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，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。**

大连百傲化学股份有限公司（以下简称"公司"）第二届董事会第十五次会议于2017年4月5日审议通过了《关于对暂时闲置的募集资金进行现金管理的议案》，董事会同意在不影响募集资金项目建设和募集资金使用的情况下，使用最高额人民币10,000万元（含10,000万元）的暂时闲置募集资金进行现金管理，主要用于投资保本理财产品、结构性存款和大额存单以及其他低风险、保本型投资产品。决议有效期为12个月，在决议有效期内，该资金额度可滚动使用。具体内容详见2017年4月6日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》及上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）公告的《大连百傲化学股份有限公司关于对暂时闲置的募集资金进行现金管理的公告》（公告编号2017-009）。

一、前次使用暂时闲置的募集资金进行现金管理的收回情况

1、公司于2017年4月12日与盛京银行大连五四广场支行签订《盛京银行理财业务协议书》，使用暂时闲置募集资金10,000万元购买"红玫瑰稳盈系列人民币理财产品201730期"产品，具体内容详见公司于2017年4月14日于指定信息披露媒体发布的《关于使用闲置募集资金进行现金管理的实施公告》（公告编号2017-011）。

上述理财产品已于2017年6月29日到期，公司收回本金10,000万元，并取得理财收益81.22万元，与预期收益不存在重大差异，本金和理财收益已归还募集资