(上接B81版)

(101)上海凯石财富基金销售有限公司
上海凯石财富基金销售有限公司
注册地址:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号4楼
法定代表人:陈继武
联系人:黄玮
电话:021-63333389
传真:021-63333390
客户服务电话:4006-433-389
公司网址:www.vstonewealth.com
(102)济安财富(北京)基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环中路7号4号楼40层4601室
办公地址:北京市朝阳区东三环中路7号北京财富中心A座46层
法定代表人:杨健
联系人:李海燕
电话:010-65309516
传真:010-65330699
客户服务电话:400-673-7010
网址:www.jianfortune.com
(103)北京格上富信基金销售有限公司
注册地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路19号楼701内09室
法定代表人:李悦章
联系人:张林
电话:010-85594745
传真:010-65983333
客户服务电话:400-066-8586
网址:www.igesafe.com
(104)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
(105)上海华信证券有限责任公司
注册地址:上海浦东新区世纪大道100号环球金融中心9楼
办公地址:上海市黄浦区南京西路399号明天广场18—22楼
法定代表人:郭林
联系人:陈媛
客服电话:4008205999
网址信息:www.shhxzq.com
(106)深圳市前海排排网基金销售有限责任公司
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:深圳市福田区福强路4001 号深圳市世纪工艺品文化市场313 栋E-403
法定代表人:李春瑜
联系人:华荣杰
电话:13926542587
传真:0755-82912445
客服电话:400-680-3928
网址:www.simuwang.com
(107)深圳盈信基金销售有限公司
注册地址:深圳市福田区莲花街道商报东路英龙 商务大厦8楼A-1(811-812)
办公地址:大连市中山区南山路155号南山1910小区A3-1
法定代表人:苗宏升
联系人: 王清臣
电话:0411-66889822
传真:0411-66889827
客服电话:4007903688
网址:www.fundying.com
(108)华瑞保险销售有限公司
注册地址:上海市嘉定区南翔镇众仁路399号运通星财富广场1号楼B座13、14层
办公地址:上海市浦东新区银城中路501号上海中心大厦32层
法定代表人:路昊
联系人:郭勇强
电话:021-61058785
传真:021-61098515
客服电话:4001115818
网址:www.huaruisales.com
(109)北京植信基金销售有限公司
注册地址:北京市密云县兴盛南路8号院2号楼106室-67
办公地址:北京市朝阳区惠河南路盛世龙源10号
法定代表人:于龙
联系人:吴鹏
电话:010-56075718
传真:010-67767615
客服电话:4006-802-123
网址:www.zhixin-inv.com
(110)上海华夏财富投资管理有限公司
注册地址: 上海市虹口区东大名路687号1幢2楼268室
办公地址: 北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层
法定代表人:毛淮平
联系人:仲秋玥
电话:010-88066632
传真: 010-63136184
客户服务电话:400-817-5666
华夏财富网址:www.amcfortune.com
(111)南京证券股份有限公司
注册地址:南京市江东中路389号
法定代表人:步国旬
联系人:王万君
客服电话:95386
网址:www.njzq.cn.cn
(112)通华财富(上海)基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区同丰路667弄107号201室
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴世纪金融广场杨高南路799号3号楼9楼
法定代表人:马刚
电话:021-60818249
传真:021-60818280
联 系 人:杨徐霆
客服电话:95156
网址:https://www.tonghuafund.com
(113)南京苏宁基金销售有限公司
注册地址:南京玄武区苏宁大道1-5号
办公地址:南京玄武区苏宁大道1-5号
法定代表人:刘汉青
电话:18512581255
传真:025-66996699-884131
联 系 人:喻明明
客服电话:95177
网址:www.snjjjn.com
(114)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
(115)上海联泰资产管理有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3层
法定代表人:燕斌
联系人:陈东
电话:021-52822063
传真:021-52975270
客服电话:400-166-6788
网址: www.66zichan.com
(116)凤凰金信(银川)基金销售有限公司
注册地址: 宁夏回族自治区银川市金凤区阅海湾中央商务区万寿路142号14层1402
办公地址:北京市朝阳区紫月路18号院 朝来高科技产业园18号楼
法定代表人:程刚
联系人: 张旭
电话:010-58160168
传真:010-58160173
客服电话:400-810-5919
网址:www.fengfd.com
(117)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:0755-82880158
传真:0755-83655518
联 系 人:廖嘉琦
客服电话:400-804-8688
网址:http://www.foreseakeynes.com/
(118)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
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销售本基金,并及时公告。

(二) 基金注册登记机构
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) 律师事务所和经办律师
名称:北京市瑞天律师事务所
住所:北京市西城区莲花池东路甲5号院1号楼2单元15层1507室
负责人:李飒
联系人:李飒
电话:010-62116298
传真:010-62216298
经办律师:李飒 刘敬华

(四) 会计师事务所和经办注册会计师
名称:致同会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:北京市建国门外大街22号赛特广场五层
法定代表人:徐华
联系人:卫俏婉
联系电话:010-85665232
传真电话:010-85665320
经办注册会计师:卫俏婉 李惠琦

四、基金的名称
本基金名称:中邮风格轮动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
本基金在分析我国宏观经济形势及政策导向的基础上,根据经济周期和市场阶段的不同,利用多种方法确定阶段性市场投资风格偏好及风格轮动特征,积极寻找结构性投资机会提升业绩表现。

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(含中小企业私募债券)、可转换债券、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%,投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、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证券品种占基金资产的比例为5%-100%,其中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%,本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%。
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
(一)大类资产配置策略
本基金依靠定性及定量研究,优化以投资时钟为基础的资产配置策略,以风格轮动为主,行业轮动、区域轮动、主题轮动为辅,积极寻求市场风格轮动所带来的结构性投资机会。大类资产配置主要涉及股票、债券和现金类等资产在投资组合中的比例调整。根据经济周期理论,经济周期可以被分为繁荣、衰退、萧条和复苏四个阶段。本基金通过对经济增长和通货膨胀等趋势的判断,确定经济周期所处阶段。具体考量因素如下:(1)宏观经济指标;包括GDP增速、居民消费价格指数、广义和狭义货币供应量、采购经理人指数等。(2)国家政策;包括国家的财政政策和货币政策,涉及信贷规模、利率水平、存款准备金率、政府支出及转移支付等。本基金将根据经济周期所处的不同阶段和市场间的相对估值水平,科学分配大类资产比例。
(二)股票资产配置策略
1、风格轮动策略
我国市场存在较为明显的风格轮动特征。市场阶段性的投资风格偏好也产生了风格动量效应及风格反转效应。本基金对股票投资时不再拘泥于单纯的行业及板块分类,更倾向于根据上市公司自身的属性进行类别划分,如市场规模、价值属性等。通过对影响市场投资风格的估值、经济周期、货币政策及市场周期等因素的研判,并配合市场所处阶段,本基金力图准确预测未来市场风格,并进行轮动操作。根据风格区分,本基金主要使用以下风格轮动策略:
(1)大/小盘风格轮动策略
小市值与大市值公司在经济发展的不同阶段有不同的发展速度,在股票市场的不同阶段,小盘股与大盘股的表现也存在差异。本基金将深入研究公司规模对经济周期、市场周期、资金流向等因素的敏感度差异,力图发现影响市场风格轮动的主要因素和轮动周期,并通过风格动量效应及风格反转效应择时介入,捕捉公司规模差异带来的投资机会。
规模分类方法如下:本基金将按照总市值规模将上市公司分为大盘、中盘、小盘三类,将股票按总市值进行降序排列,计算各股票对应的累计市值占全部股票累计总市值的百分比。其中,大盘股:累计市值百分比小于或等于70%的股票;中盘股:累计市值百分比在70%-90%之间的股票;小盘股:累计市值百分比大于90%的股票。
(2)价值/成长风格轮动策略
根据风格箱法,投资风格可以按价值/成长进行分类。本基金根据每股收益价格比、每股净资产价格比、每股红利价格比及每股收益增长率等因素确定股票归类,在判断风格轮动影响因素和轮动周期的基础上择时进行轮换操作,并可根据规模因素进行二次资产配置,在大盘成长、中盘成长、小盘成长、大盘价值、中盘价值、小盘价值等风格组合间进行倾斜性投资,尽量减小换仓频率及冲击成本。
(3)其他风格轮动策略
本基金还将根据市场情况变化、量化研究成果等寻求新的投资风格轮动所带来的交易机会。
2、行业轮动策略
在经济周期的不同阶段,由于产业政策、竞争环境、资源供给及产品需求等因素的变化,各行业间呈现不同的景气程度。基于美林投资时钟理论,本基金在通过相关指标判断出经济周期所处阶段后,结合资本市场运行情况对行业轮动趋势进行预测并以此指导基金投资。
3、区域轮动策略
上市公司的景气程度一定程度上反映了所在区域的经济发展状况,而区域经济发展状况是受区域的资源禀赋、人口数量及结构、地理环境等因素的影响。当影响因素及政策导向发生变化时,会涌现一批受惠于区域整合、产业结构调整、经济转型的上市公司。本基金将积极利用区域轮动的机会提升投资收益。
4、主题轮动策略
本基金通过对宏观经济中结构性、周期性、政策性以及突发性事件的研究,挖掘事件背后的驱动因素,并分析主题事件对资本市场及对应板块、个股所产生的影响,进而精选投资标的,拓展获取超额收益的能力。
(三)个股投资策略
本基金通过定性分析和定量分析相结合的办法,结合市场择时,重点投资符合国家战略方向,受益于大国崛起和综合国力提高过程中的优质上市公司。
1、定性分析
在定性分析方面,本基金关注于具备以下特征的上市公司:
A、公司所处的行业符合国家战略发展方向,未来空间大且增速高;
B、公司具有清晰的盈利模式和明显的竞争优势,战略匹配度高,执行能力强;
C、公司具有良好的治理结构和激励机制,信息披露公开透明;
D、公司具有良好的创新能力,包括产品创新、模式创新和外延并购创新等。
2、定量分析
本基金将通过关键财务指标对上市公司的成长性与风险因素进行分析,结合估值指标最终决定投资标的:
A、财务指标:盈利能力(ROE、利润率、财务杠杆);运营效率(每股现金流,存货周转率,应收账款周转率);偿债能力(流动比率、速动比率,资产负债率);增长能力(营业收入增长率,利润增长率,净利润增长率)等;
B、估值指标:结合市值空间判断,充分运用DCF、市盈率、市销率、市净率等指标。
3、市场择时
本基金将以持续深入研究为基础,长期价值投资为理念,密切跟踪相关行业和上市公司的核心趋势,结合市场化特征和催化因素,灵活操作阶段性的买卖时点,并将通过对资金流向、市场情绪及市场所处阶段的判断,力图准确的捕捉风格轮动所带来的投资机会,及时介入阶段性投资热点,提升投资业绩。
(四)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、含权等因素进行分析,选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。
(五)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。
(六)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,特别是在科技创新受经济环境、政策监管等外部重要因素影响时相应行业的上市公司股价变化可能出现一定程度的波动,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,并充分利用期货合约间的差异及特征,配合风格轮动带来的结构性投资机会,选择合适的股指期货合约进行对冲,提高投资组合的运作水平。

九、业绩比较基准
本基金整体业绩比较基准构成为:沪深300指数×60%+上证国债指数×40%
本基金股票投资的业绩比较基准为沪深300指数,债券投资的业绩比较基准为上证国债指数,主要基于以下原因:
沪深300指数是由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成分股指数,覆盖了沪深市场六成左右的市值,具有良好的市场代表性和市场流动性。沪深300指数与市场整体表现具有较高的相关性,且指数历史表现强于市场平均收益水平,具有良好的投资价值。该指数由中证指数公司在引进国际指数编制和管理经验的基础上编制和维护,编制方法的透明度高,具有独立性。
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%,投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、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证券品种占基金资产的比例为5%-100%;
(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)基金管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)本基金持有的单只中小企业私募债券,其市值不得超过基金资产净值的10%;
(17)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,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。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10月1日起至12月31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	64,168,455.74	72.14
	其中:股票	64,168,455.74	72.14
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	24,558,118.13	27.61
8	其他资产	224,664.70	0.25
9	合计	88,951,238.57	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。
2.报告期末按行业分类的股票投资组合
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	1,158,500.00	1.34
C	制造业	33,433,125.44	38.56
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	1,448,514.34	1.67
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	4,806,936.50	5.54
J	金融业	8,005,200.00	9.23
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	5,473,814.09	6.31
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,327,965.37	7.30
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	3,514,400.00	4.05
S	综合	-	-
	合计	64,168,455.74	74.01

注:由于四舍五入的原因报告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。
2.2报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合
注:本报告期末本基金未投资港股通股票。
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	600519	贵州茅台	5,500	3,836,195.00	4.42
2	300662	科锐国际	150,917	3,738,214.09	4.31
3	002573	清新环境	150,000	3,409,500.00	3.93
4	002035	华帝股份	100,000	3,014,000.00	3.48
5	000888	峨眉山A	270,981	2,918,465.37	3.37
6	000001	平安银行	200,000	2,660,000.00	3.07
7	600703	三安光电	100,000	2,539,000.00	2.93
8	600584	长电科技	110,000	2,346,300.00	2.71
9	600036	招商银行	80,000	2,321,600.00	2.68
10	600690	青岛海尔	119,991	2,260,630.44	2.61

4.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。
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。
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。
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权证投资明细
注:本报告期末本基金未持有权证。
8.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。
9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本报告期末本基金未持有国债期货。
10.投资组合报告附注
10.1本基金投资的中信证券(600030),中信证券股份有限公司于二〇一七年五月二十四日发布《关于收到中国证监会行政处罚事先告知书的公告》,违反了《证券公司融资融券业务管理办法》第十一条的规定,未按照规定与客户签订业务合同;收到了中国证券监督管理委员会《行政处罚事先告知书》(处罚字【2017】57号),对公司及相关责任人给予拟处罚的决定。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。
10.2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。
11.其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	206,587.33
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,077.63
5	应收申购款	10,999.74
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	224,664.70

12.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。
13.报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
注:本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况
14.基金的业绩
基金管理人承诺以恪尽职守、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12月31日,过去三个月的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	1.65%	0.80%	3.10%	0.48%	-1.45%	0.32%

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、律师费和诉讼或仲裁费;
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。
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)基金管理费、基金托管费的调整
基金管理人和基金托管人可根据基金规模等因素协商一致,酌情调低基金管理费率、基金托管费率,无须召开基金份额持有人大会。提高上述费率需经基金份额持有人大会决议通过。基金管理人须最迟于新费率实施日2日前在指定媒介刊登公告。
(五)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9月8日刊登的本基金招募说明书(《中邮风格轮动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
2018年3月17日

证券代码:300540 证券简称:深冷股份 公告编号:2018-014

成都深冷液化设备股份有限公司关于召开2018年第一次临时股东大会的补充通知

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

重要内容提示:
1、取消审议“关于公司《2018年限制性股票激励计划(草案)》及其摘要的议案”及“关于公司《2018年限制性股票激励计划实施考核管理办法》的议案”;
2、增加审议“关于公司《2018年限制性股票激励计划(草案修订稿)》及其摘要的议案”及“关于公司《2018年限制性股票激励计划实施考核管理办法(修订稿)》的议案”
成都深冷液化设备股份有限公司(以下简称“公司”)第二届董事会第二十一次会议审议通过了“关于召开2018年第一次临时股东大会的议案”,决定于2018年4月9日(星期一)下午14:00在公司会议室召开2018年第一次临时股东大会。2018年3月14日,公司董事会收到公司股东黄肃先生(持有公司股份321.43万股,占公司当前总股本的4.02%)提交的临时提案,提请公司将“关于公司《2018年限制性股票激励计划(草案修订稿)》及其摘要的议案”、“关于公司《2018年限制性股票激励计划实施考核管理办法(修订稿)》的议案”作为临时提案提交公司2018年第一次临时股东大会审议,该议案已经公司第二届董事会第二十二次会议审议通过,此外该次董事会同时审议通过了“关于取消审议公司《2018年限制性股票激励计划(草案)》及其摘要的议案”、“关于取消审议公司《2018年限制性股票激励计划实施考核管理办法》的议案”。
除了上述取消议案和增加临时提案外,公司于2018年3月13日公告的原股东 大会通知其他事项不变,股东大会的有关情况如下:
一、召开会议的基本情况
1. 股东大会届次:2018年第一次临时股东大会
2. 股东大会的召集人:公司董事会
3. 会议召开的合法、合规性:本次股东大会的召开符合有关法律、行政法规、部门规章、规范性文件、深圳证券交易所业务规则和公司章程的规定。
4. 会议召开的日期、时间
现场会议时间为:2018年4月9日(星期一)下午14:00。
网络投票时间为:2018年4月8日至2018年4月9日。其中,通过深圳证券交易所交易系统进行网络投票的具体时间为:2018年4月9日上午9:30至11:30,下午13:00-至15:00;通过深圳证券交易所互联网投票系统进行网络投票的具体时间为:2018年4月8日下午15:00至2018年4月9日下午15:00期间的任意时间。
独立董事征集投票权的时间为:2018年4月2日至2018年4月3日(每日上午9:00-11:30,下午13:30-17:00)。独立董事冯良荣受其他独立董事的委托作为征集人,就公司拟于2018年4月9日召开的2018年第一次临时股东大会的有关议案向公司全体股东征集投票权,具体内容详见同日于巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)上披露的《独立董事公开征集委托投票权报告书》。
5. 会议的召开方式:本次股东大会采取现场表决、网络投票与独立董事征集投票权相结合的方式召开。
本次股东大会将通过深圳证券交易所交易系统和互联网投票系统向公司股东提供网络形式的投票平台,公司股东可以在网络投票时间内通过深圳证券交易所交易系统或互联网投票系统对本次股东大会审议事项进行投票表决。公司股东应选择现场投票、网络投票中、独立董事征集投票权相结合的一种方式,如果同一表决权出现重复投票表决的,以第一次投票表决结果为准。
6. 会议的股权登记日:2018年3月29日
7. 出席对象:
(1)于2018年3月29日下午收市时在中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司登记在册的公司全体股东均有权出席股东大会,并可以以书面形式委托代理人出席会议和参加表决,该股东代理人不必是本公司股东;
特别提示:本次股东大会议案1—3,与激励对象存在关联关系的股东谢乐敏、成都盈信和投资中心(有限合伙)需在股东大会上回避表决相关议案,《第二届董事会第二十一次会议决议公告》及《第二届董事会第二十二次会议决议公告》已披露相关情况,该等股东不接受其他股东委托进行投票。
(2)公司董事、监事和高级管理人员;
(3)公司聘请的律师。
8. 会议地点:成都市郫都区成都现代工业港北片区港北四路335号公司会议室
二、会议审议事项
1.审议“关于公司《2018年限制性股票激励计划(草案修订稿)》及其摘要的议案”;
2.审议“关于公司《2018年限制性股票激励计划实施考核管理办法(修订稿)》的议案”;
3.审议“关于提请股东大会授权董事会办理股权激励相关事宜的议案”。
上述议案已经公司2018年3月12日召开的第二届董事会第二十一次会议、2018年3月16日召开的第二届董事会第二十二次会议、第二届监事会第十五次会议审议通过,具体内容详见公司刊登于巨潮资讯网(http://www.cninfo.com.cn)的相关公告。
特别提示:对于本次会议审议的所有议案均须经出席会议的股东所持表决权的三分之二以上通过;对于本次会议审议的所有议案公司将对中小投资者的表决单独计票并公开披露。中小投资者是指除公司董事、监事、高级管理人员以及单独或者合计持有公司5%以上股份的股东以外的其他股东。
三、提案编码

提案编码	提案名称	备注
		该列打勾的栏目可以投票
100	总议案:所有提案	√
1.00	“关于公司《2018年限制性股票激励计划(草案修订稿)》及其摘要的议案”	√
2.00	“关于公司《2018年限制性股票激励计划实施考核管理办法(修订稿)》的议案”	√
3.00	“关于提请股东大会授权董事会办理股权激励相关事宜的议案”	√

四、会议登记方法
1、登记方式:
(1)出席会议的自然人股东持本人身份证、股东账户卡及持股凭证办理登记手续;委托代理人持本人身份证、委托人身份证复印件、授权委托书、委托人股东账户卡及持股凭证办理登记手续。
(2)法人股东法定代表人出席会议的,应出示本人身份证、能证明其具有法定代表人资格的有效证明;股东账户卡及持股凭证办理登记手续;委托代理人出席会议的,代理人应出示本人身份证、法人股东单位的法定代表人依法出具的书面授权委托书、能证明其具有法定代表人资