

中邮现金驿站货币市场基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 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:2017 年 4 月 21 日

81 重要提示
基金管理人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 2017 年 04 月 20 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预示其未来表现。投资者有风险,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。
本报告自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 03 月 31 日止。

82 基金产品概况
基金名称:中邮现金驿站货币市场基金
基金代码:000921
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2014 年 12 月 18 日
报告期末基金份额总额:6,408,162,232.97 份

投资策略
1. 资产配置策略
整体资产配置策略主要体现在:(1)根据宏观经济形势、央行货币政策、短期资金市场状况等因素对预期利率走势进行综合判断;(2)根据判断形成的利率预期动态调整投资组合的资产配置策略。
2. 债券投资策略
(1) 利率预期策略
本基金将密切跟踪央行货币政策动向,密切跟踪利率变化,合理预期未来利率走势,并结合全球配置策略,进行利率预期策略的资产配置。
(2) 信用债投资策略
本基金在利率预期策略的基础上,采取自上而下的方法,对各类可投资资产进行合理的配置和选择,投资期限优先匹配资产收益性、流动性及风险性特征,在风险可控的前提下,力争获取超额收益。
(3) 可转债投资策略
本基金在利率预期策略的基础上,采取自上而下的方法,对可转债进行合理的配置和选择,投资期限优先匹配资产收益性、流动性及风险性特征,在风险可控的前提下,力争获取超额收益。
(4) 货币市场工具投资策略
本基金在利率预期策略的基础上,采取自上而下的方法,对货币市场工具进行合理的配置和选择,投资期限优先匹配资产收益性、流动性及风险性特征,在风险可控的前提下,力争获取超额收益。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中邮现金驿站货币市场基金业绩比较基准。
风险收益特征
本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,预期风险和收益均低于股票型基金、混合型基金及股票型基金。

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
基金合同生效日:2014 年 12 月 18 日
报告期末基金份额总额:6,408,162,232.97 份

83 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
报告期间(2017年1月1日至2017年3月31日)

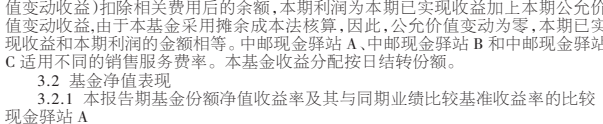
Table with 3 columns: 项目, 报告期末, 本报告期末. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 期末基金资产净值.

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。由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动为负,本期已实现收益和本期利润的金额相等。中邮现金驿站A、中邮现金驿站B和中邮现金驿站C适用不同的销售费率,本基金收益分配按日结转份额。

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

Table showing performance metrics for 过去三个月 and 过去六个月. Columns include 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, etc.

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的比较
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的比较图



注:本基金自 2014 年 12 月 18 日基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期,建仓期间内本基金净值增长率符合基金合同的有关规定。

84 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Row for 余红.

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通知的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的有关规定,基金管理人、基金托管人、基金销售机构均严格遵守了公平交易管理制度的规定,各基金在研究、投资、交易等环节均受到公平对待,确保各基金获得公平交易的机会。

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》、《中邮基金投资管理细则》、《交易部管理细则》、《交易部申购赎回管理细则》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、可转债、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各个环节,形成了有效的公平交易执行体系。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.4 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.5 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.6 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.7 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.8 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.9 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.10 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.11 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.12 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.13 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.14 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资

基金 2017 年第 1 季度报告

2017 年 3 月 31 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:2017 年 4 月 21 日

81 重要提示
基金管理人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 2017 年 04 月 20 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预示其未来表现。投资者有风险,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。
本报告自 2017 年 01 月 01 日起至 2017 年 03 月 31 日止。

82 基金产品概况
基金名称:中邮消费升级灵活配置混合型证券投资基金
基金代码:00513
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2016 年 12 月 15 日
报告期末基金份额总额:137,637,261.33 份

投资策略
1. 资产配置策略
本基金在追求长期资本增值的前提下,采取自上而下的方法,对各类可投资资产进行合理的配置和选择,投资期限优先匹配资产收益性、流动性及风险性特征,在风险可控的前提下,力争获取超额收益。
2. 股票投资策略
(1) 行业配置策略
本基金将密切跟踪宏观经济、政策、市场和行业发展阶段,结合全球配置策略,进行行业配置。
(2) 个股选择策略
本基金在行业配置策略的基础上,采取自上而下的方法,对个股进行合理的配置和选择,投资期限优先匹配资产收益性、流动性及风险性特征,在风险可控的前提下,力争获取超额收益。

业绩比较基准
本基金业绩比较基准为:中证消费升级指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征
本基金为混合型证券投资基金,预期风险和收益均高于货币市场基金、债券型基金,低于股票型基金。

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
基金合同生效日:2016 年 12 月 15 日
报告期末基金份额总额:137,637,261.33 份

83 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
报告期间(2017年1月1日至2017年3月31日)

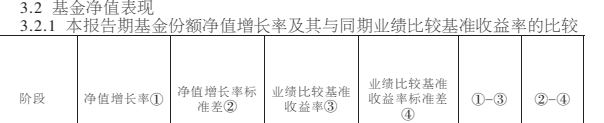
Table with 3 columns: 项目, 报告期末, 本报告期末. Rows include 本期已实现收益, 本期利润, 期末基金资产净值.

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。由于本基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动为负,本期已实现收益和本期利润的金额相等。中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金适用不同的销售费率,本基金收益分配按日结转份额。

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

Table showing performance metrics for 过去三个月 and 过去六个月. Columns include 净值增长率, 净值增长率标准差, 业绩比较基准收益率, etc.

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的比较
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的比较图



注:本基金自 2016 年 12 月 15 日基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期,建仓期间内本基金净值增长率符合基金合同的有关规定。

84 基金经理(或基金经理小组)简介
姓名 职务 任职日期 离任日期 证券从业年限 说明

Table with 6 columns: 姓名, 职务, 任职日期, 离任日期, 证券从业年限, 说明. Row for 周楠.

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通知的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
报告期内,本基金管理人严格遵守了《证券投资基金法》、《证券投资基金管理条例》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》等法律法规及基金合同的有关规定,基金管理人、基金托管人、基金销售机构均严格遵守了公平交易管理制度的规定,各基金在研究、投资、交易等环节均受到公平对待,确保各基金获得公平交易的机会。

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》、《中邮基金投资管理细则》、《交易部管理细则》、《交易部申购赎回管理细则》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、可转债、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各个环节,形成了有效的公平交易执行体系。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。
4.3.3 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.4 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.5 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.6 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.7 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.8 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.9 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.10 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.11 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.12 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

4.3.13 异常交易行为的专项说明
报告期内,未发现异常交易行为。

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。

5.2.1 报告期末按行业分类的股票投资组合
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing industry breakdown of the fund's portfolio. Columns include 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

5.2.2 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing industry breakdown of the fund's portfolio for沪港通. Columns include 行业类别, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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(%)

Table showing top 10 stock holdings. Columns include 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(%)

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing bond portfolio breakdown. Columns include 债券品种, 公允价值(元), 占基金资产净值比例(%)

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
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing top 5 bond holdings. Columns include 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(%)

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
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing top 10 asset-backed securities. Columns include 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(%)

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
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing top 5 precious metal holdings. Columns include 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(%)

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
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing top 5 warrant holdings. Columns include 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(%)

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
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

Table showing derivatives portfolio. Columns include 序号, 名称, 金额(元)

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

5.11 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细
报告期末基金资产组合公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)