

中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券
投资基金
2019 年半年度报告

2019 年 6 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

送出日期：2019 年 8 月 26 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金管理人—中邮创业基金管理股份有限公司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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）根据本基金合同规定，于 2019 年 08 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|--|-----------|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示..... | 2 |
| 1.2 目录..... | 3 |
| §2 基金简介 | 6 |
| 2.1 基金基本情况..... | 6 |
| 2.2 基金产品说明..... | 6 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人..... | 7 |
| 2.4 信息披露方式..... | 7 |
| 2.5 其他相关资料..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| 3.3 其他指标..... | 错误!未定义书签。 |
| §4 管理人报告 | 11 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 11 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 12 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 13 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 13 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 14 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 14 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 15 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 15 |
| 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 15 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表..... | 16 |
| 6.2 利润表..... | 17 |

| | |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 18 |
| 6.4 报表附注..... | 19 |
| §7 投资组合报告..... | 35 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 35 |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合..... | 35 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... | 36 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 37 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 46 |
| 7.6 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..... | 46 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 46 |
| 7.8 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..... | 46 |
| 7.9 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..... | 46 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 46 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 47 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 47 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 48 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 48 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 48 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 48 |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况..... | 48 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 49 |
| §10 重大事件揭示..... | 50 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 50 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 50 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 50 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 50 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 50 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 50 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 50 |
| 10.8 其他重大事件..... | 51 |

| | |
|--|-----------|
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| 11.1 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 | 54 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 54 |
| §12 备查文件目录 | 55 |
| 12.1 备查文件目录..... | 55 |
| 12.2 存放地点..... | 55 |
| 12.3 查阅方式..... | 55 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------------|
| 基金名称 | 中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称 | 中邮消费升级灵活配置混合 |
| 基金主代码 | 003513 |
| 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 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 45,630,290.75 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金重点关注消费升级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 | <p>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。</p> <p>1、消费升级主题的定义</p> <p>本基金认为，消费升级是经济可持续发展的重要驱动因素。本基金通过深入研究宏观经济、政策指引、居民消费升级的变化趋势，重点投资于受益于消费升级的行业。</p> <p>2、大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>3、股票投资策略</p> <p>第一步，通过主题相关度筛选，构建消费升级主题股票库。</p> <p>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。</p> <p>第三步，个股定性分析，构建股票精选库</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>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，确定债券的投资组</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>合。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>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。</p> <p>5、股指期货投资策略</p> <p>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。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金整体业绩比较基准构成为：中证消费指数收益率×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。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-----------------------|---------------------|
| 名称 | | 中邮创业基金管理股份有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 侯玉春 | 吴玉婷 |
| | 联系电话 | 010-82295160—157 | 021-52629999-212052 |
| | 电子邮箱 | houyc@postfund.com.cn | xywyt@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 010—58511618 | 95561 |
| 传真 | | 010-82295155 | 021-62535823 |
| 注册地址 | | 北京市东城区和平里中街乙16号 | 福州市湖东路154号 |
| 办公地址 | | 北京市东城区和平里中街乙16号 | 上海市静安区江宁路168号20楼 |
| 邮政编码 | | 100013 | 200041 |
| 法定代表人 | | 曹均 | 高建平 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------|-------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报 |
|----------------|-------|

| | |
|----------------------|---------------------|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.postfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人或基金托管人的办公场所。 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|-------------------|
| 注册登记机构 | 中邮创业基金管理股份有限公司 | 北京市东城区和平里中街乙 16 号 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益 | 7,968,181.12 |
| 本期利润 | 8,928,263.51 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.1929 |
| 本期加权平均净值利润率 | 18.64% |
| 本期基金份额净值增长率 | 28.85% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 期末可供分配利润 | 2,335,822.49 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0512 |
| 期末基金资产净值 | 48,098,181.99 |
| 期末基金份额净值 | 1.054 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2019年6月30日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 5.40% |

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. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当前发生额）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

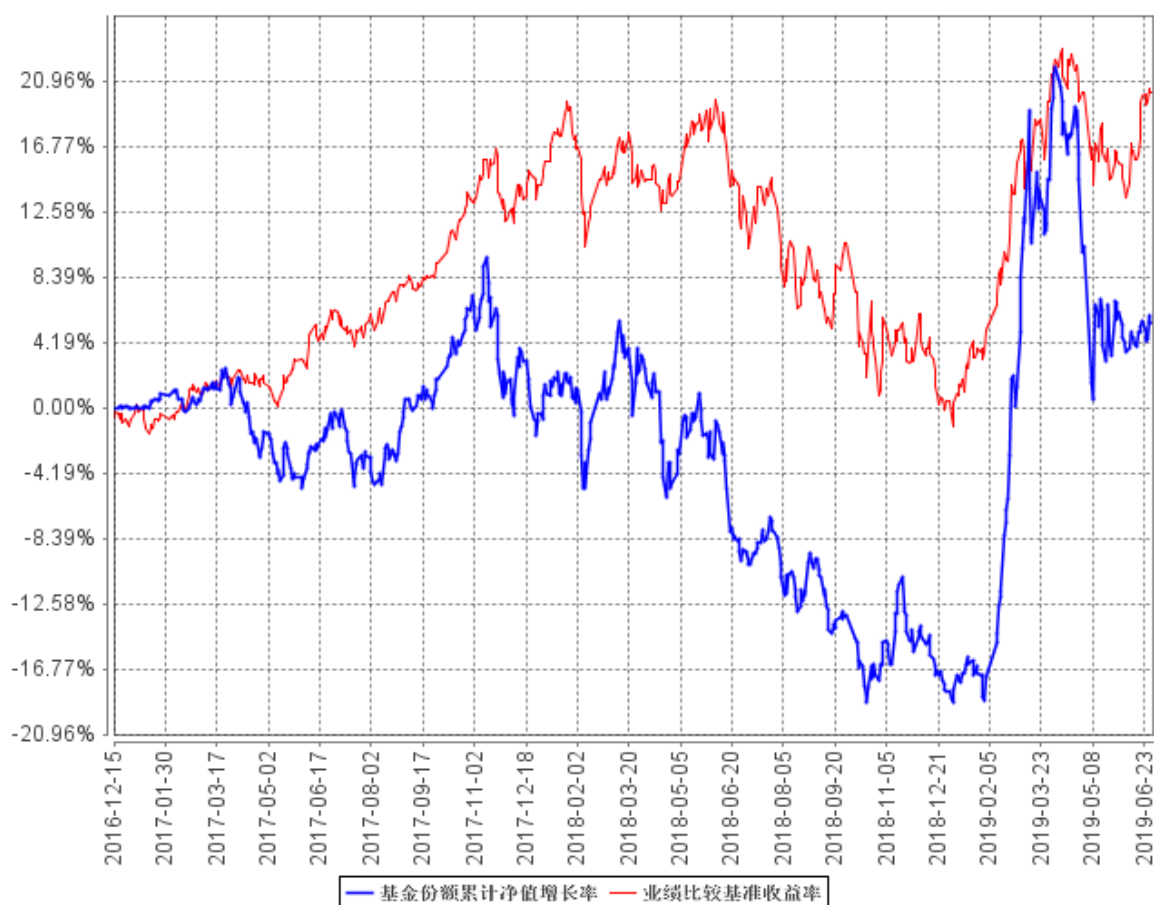
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|--------|
| 过去一个月 | -0.66% | 0.61% | 3.96% | 0.79% | -4.62% | -0.18% |
| 过去三个月 | -8.03% | 1.75% | 0.48% | 0.96% | -8.51% | 0.79% |
| 过去六个月 | 28.85% | 1.74% | 19.74% | 0.97% | 9.11% | 0.77% |
| 过去一年 | 15.95% | 1.36% | 5.88% | 0.98% | 10.07% | 0.38% |
| 自基金合同生效起至今 | 5.40% | 1.07% | 20.27% | 0.75% | -14.87% | 0.32% |

注：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。

本基金业绩比较基准为：中证消费指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

基金份额累计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：按基金合同和招募说明书的约定，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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司成立于 2006 年 5 月 8 日，截至 2019 年 6 月 30 日，本公司共管理 43 开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮上证 380 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利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、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势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、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮增力债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮睿利增强债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮安泰双核混合型证券投资基金、中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 聂璐 | 基金经理 | 2018 年 7 月 10 日 | - | 12 年 | 管理学硕士，曾任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、首誉光控资产管理有限公司投资经理、中 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 邮核心主题混合型证券投资基金基金经理助理、中邮创业基金管理股份有限公司投资经理，现任中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、中邮消费升级灵活配置混合型发起式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《关于基金经理注册通知》、《关于基金经理变更通知》、《关于基金经理注销通知》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合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规及本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

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有关法律法规和基金合同的规定和约定；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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过制度流程和信息技术手段以保证实现公平交易原则。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

报告期内，公司对旗下所有投资组合之间的收益率差异、分投资类别（股票、债券）的收益率差异进行了分析，并采集连续四个季度期间内、不同时间窗口下（1日内、3日、5日）同向交易的样本，根据 95%置信区间下差价率的 T 检验显著程度进行分析，未发现旗下投资组合之间存在利益输送情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人所管理的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%。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，一季度在流动性偏宽松、市场估值偏低、北上资金持续流入等因素的共同影响下，市场呈现“普涨”势态。上证综数上涨了 19.45%，深圳综指上涨 23.23%，创业板指数上涨 20.87%。其中，农林牧渔、计算机和非银金融等涨幅靠前。相对于一季度的普涨行情，二季度的行情更多体现为核心资产的“抱团”，整个二季度只有食品饮料、家电和银行等五个行业获得正收益；国内一方面整体体现为政策的回收；另一方面，经济数据难言企稳，市场风险偏好下降，波动加大；因此市场更为看重业绩的确定性，影响股价的因素由分母端转向分子端。同时海外方面，5 月中美贸易争端反复，进一步加大了市场的风险厌恶情绪。

本基金在报告期内采取了偏积极的高仓位操作策略：一方面重点配置了农业养殖、食品饮料、教育和医药等行业；另一方面围绕行业空间、竞争力和管理层等维度“自下而上”精选个股，保持了对长期看好标的配置。

4.4.2 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 1.054 元，累计净值为 1.054 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.85%，业绩比较基准收益率为 19.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年下半年，中美经济景气度共振走弱拖累全球需求，贸易摩擦不确定性仍存。美国方面，上半年经济增长有韧性，但结构问题显著，企业部门的高杠杆难以持续，库存去化趋势相对明确，衰退预期较强；下半年预计企业部门景气度的继续下行可能导致失业率的上升，对应政策层面美联储开始边际宽松。中国方面，PMI 已经跌至枯荣线以下，经济下行压力仍存，下半年预计投资需求仍将小幅走弱，其中基建的小幅回暖可能较难对冲地产投资和制造业投资的下滑；政策层面，预计下半年国内将重新回到经济退、政策进的环境，但在高质量发展的总体政策框架下，稳增长政策可能更具针对性，全面的经济刺激较难出现。另外，中美贸易摩擦不确定性仍存，英国仍有硬脱欧的可能，全球风险偏好仍将受到风险事件的压制。

2019 年二季度消费行业呈现弱复苏势头，但是在宏观经济偏弱的背景下，我们对于行业复苏的高度持谨慎的态度。我们将控制仓位，自下而上筛选一些商业模式较好、业绩确定性强、估值合理、以及“慢就是快”的公司，努力在中长期给持有人带来好的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、督察长、基金清算部经理、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理，在采用

估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内，有连续二十个工作日基金净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本托管人依据《中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》与《中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》，自 2016 年 12 月 15 日起托管中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下称本基金）的全部资产。报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害基金份额持有人利益的行为。基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 8,661,875.81 | 18,763,982.85 |
| 结算备付金 | | 505,570.55 | 482,227.12 |
| 存出保证金 | | 119,622.78 | 86,699.14 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 40,720,322.71 | 13,277,576.00 |
| 其中：股票投资 | | 40,720,322.71 | 13,277,576.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 应收证券清算款 | | 213,976.60 | 1,995,451.36 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 5,620.93 | 8,414.02 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 6,604.34 | 3,488.12 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 50,233,593.72 | 34,617,838.61 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 1,003,555.71 | - |
| 应付赎回款 | | 264,578.50 | 2,068.90 |
| 应付管理人报酬 | | 61,012.44 | 44,296.29 |
| 应付托管费 | | 10,168.73 | 7,382.72 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 375,655.36 | 169,322.90 |
| 应交税费 | | - | - |

| | | | |
|---------------|----------|---------------|---------------|
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 420,440.99 | 580,002.06 |
| 负债合计 | | 2,135,411.73 | 803,072.87 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 45,630,290.75 | 41,361,660.54 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 2,467,891.24 | -7,546,894.80 |
| 所有者权益合计 | | 48,098,181.99 | 33,814,765.74 |
| 负债和所有者权益总计 | | 50,233,593.72 | 34,617,838.61 |

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.054 元，基金份额总额 45,630,290.75 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 10,362,382.34 | -2,281,354.21 |
| 1.利息收入 | | 112,728.50 | 124,306.37 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 112,728.50 | 124,306.37 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 9,157,681.37 | 462,303.93 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 8,984,347.44 | 342,762.16 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.5 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 173,333.93 | 119,541.77 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 960,082.39 | -2,875,429.88 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.18 | 131,890.08 | 7,465.37 |
| 减：二、费用 | | 1,434,118.83 | 1,287,358.64 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 353,338.00 | 335,733.82 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 58,889.58 | 55,955.59 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |

| | | | |
|---------------------|----------|--------------|---------------|
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 1,000,715.88 | 656,373.22 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | - | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 21,175.37 | 239,296.01 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 8,928,263.51 | -3,568,712.85 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 8,928,263.51 | -3,568,712.85 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | |
|--|--|---------------|----------------|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 41,361,660.54 | -7,546,894.80 | 33,814,765.74 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 8,928,263.51 | 8,928,263.51 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列） | 4,268,630.21 | 1,086,522.53 | 5,355,152.74 |
| 其中：1.基金申购款 | 30,540,129.33 | 4,168,304.67 | 34,708,434.00 |
| 2.基金赎回款 | -26,271,499.12 | -3,081,782.14 | -29,353,281.26 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | - | - | - |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 45,630,290.75 | 2,467,891.24 | 48,098,181.99 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 | | |

| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
|--|---------------|---------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 52,500,859.86 | -221,237.96 | 52,279,621.90 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -3,568,712.85 | -3,568,712.85 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | -9,398,015.84 | -128,555.01 | -9,526,570.85 |
| 其中：1.基金申购款 | 556,132.91 | -11,821.41 | 544,311.50 |
| 2.基金赎回款 | -9,954,148.75 | -116,733.60 | -10,070,882.35 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 43,102,844.02 | -3,918,505.82 | 39,184,338.20 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 孔军 孔军 佟姍
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2016]2015 号《关于准予中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》核准募集，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》发起，并于 2016 年 12 月 15 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集 510,634,432.14 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2016)第 110ZC0681 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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）。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%~95%，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%。本基金投资于消费升级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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）和中国证券业协会 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和所有者权益（基金净值）变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部 国家税务总局 关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2015]101号《财政部 国家税务总局 证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《财政部 国家税务总局 关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部 国家税务总局 关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《财政部 国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2017]56号《财政部 国家税务总局 关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《财政部 国家税务总局 关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1. 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税；基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

2. 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产（质押式、买断式）；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

基金增值税应税行为包括贷款服务和金融商品转让。采用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。基金管理人运营基金提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（1）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（2）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有

限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

5. 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 8,661,875.81 |
| 定期存款 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 合计： | 8,661,875.81 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 | | |
|-------------------|-------------------|---------------|------------|
| | 成本 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 39,991,850.66 | 40,720,322.71 | 728,472.05 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 39,991,850.66 | 40,720,322.71 | 728,472.05 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息 | 5,367.67 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |
| 应收结算备付金利息 | 204.84 |
| 应收债券利息 | - |
| 应收资产支持证券利息 | - |
| 应收买入返售证券利息 | - |
| 应收申购款利息 | - |
| 应收黄金合约拆借孳息 | - |
| 其他 | 48.42 |
| 合计 | 5,620.93 |

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 375,655.36 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 375,655.36 |

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 |
|----|-----|
|----|-----|

| | 2019 年 6 月 30 日 |
|-------------|-----------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 605.20 |
| 预提费用 | 419,835.79 |
| 合计 | 420,440.99 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 41,361,660.54 | 41,361,660.54 |
| 本期申购 | 30,540,129.33 | 30,540,129.33 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -26,271,499.12 | -26,271,499.12 |
| - 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算变动份额 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | - | - |
| 本期末 | 45,630,290.75 | 45,630,290.75 |

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | -4,943,418.67 | -2,603,476.13 | -7,546,894.80 |
| 本期利润 | 7,968,181.12 | 960,082.39 | 8,928,263.51 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -688,939.96 | 1,775,462.49 | 1,086,522.53 |
| 其中：基金申购款 | 774,667.62 | 3,393,637.05 | 4,168,304.67 |
| 基金赎回款 | -1,463,607.58 | -1,618,174.56 | -3,081,782.14 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 2,335,822.49 | 132,068.75 | 2,467,891.24 |

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
| | 活期存款利息收入 |

| | |
|-----------|------------|
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 3,999.40 |
| 其他 | 805.57 |
| 合计 | 112,728.50 |

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 323,417,123.07 |
| 减：卖出股票成本总额 | 314,432,775.63 |
| 买卖股票差价收入 | 8,984,347.44 |

6.4.7.13 债券投资收益

注：本报告期内本基金无债券投资。

6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

注：本报告期内本基金无资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

注：本报告期内本基金无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

注：本报告期内本基金无衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 |
|-------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 173,333.93 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 173,333.93 |

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 960,082.39 |
| ——股票投资 | 960,082.39 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| ——权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税 | - |
| 合计 | 960,082.39 |

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 131,890.08 |
| 合计 | 131,890.08 |

注：本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，随持有期限的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对持续持有期小于 30 日（不含 30 日）的，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日（含 30 日）但少于 93 日的，将不低于赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 93 日（含 93 日）但少于 186 日的，将不低于赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 186 日（含 186 日）的，将不低于赎回费总额的 25% 归基金财产。其余用于注册登记费和其他必要的手续费。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 1,000,715.88 |
| 合计 | 1,000,715.88 |

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 |
|--------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 19,835.79 |
| 信息披露费 | - |
| 银行结算费用 | 1,339.58 |
| 合计 | 21,175.37 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期内，本基金不存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2019 年 08 月 20 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------|-----------------------|
| 中邮创业基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
| 首创证券有限责任公司 | 基金管理人的股东、基金代销机构 |
| 中国邮政集团公司 | 基金管理人的股东 |
| 三井住友银行股份有限公司 | 基金管理人的股东 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本报告期内及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 353,338.00 | 335,733.82 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 71,356.89 | 47,378.40 |

注：支付基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。管理费的计算方法如下：

每日应计提的基金管理费 = 前一日的基金资产净值 × 1.50% / 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 58,889.58 | 55,955.59 |

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值的 0.25% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本报告期内及上年度可比期间，本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------------------------|---------------------------------|---------------------------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
| 基金合同生效日（2016 年 12 月 15 日）持有的基金份额 | 10,000,200.00 | 10,000,200.00 |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,000,200.00 | 10,000,200.00 |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,000,200.00 | 10,000,200.00 |

| | | |
|-------------------------|--------|--------|
| 报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例 | 21.92% | 23.20% |
|-------------------------|--------|--------|

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方 名称 | 本期 2019年1月1日至2019年6月30日 | | 上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日 | |
|----------------|----------------------------|------------|---------------------------------|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 兴业银行股 份有限公司 | 8,661,875.81 | 112,728.50 | 29,689,374.13 | 120,659.44 |

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|----------|--------------------|-------------------|------------|----------|------------|--------------|------------|------------|----|
| 证券 代码 | 证券 名称 | 成功 认购日 | 可流 通日 | 流通受 限类型 | 认购 价格 | 期末估 值单价 | 数量 (单位:股) | 期末 成本总额 | 期末估值 总额 | 备注 |
| 601236 | 红塔 证券 | 2019年 6月28 日 | 2019 年7月 5日 | 新股流 通受限 | 3.46 | 3.46 | 5,873 | 20,320.58 | 20,320.58 | - |

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

注：本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.1 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控和可承受。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理组织架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助进行风险管理决策，以实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险限度，及时对各种风险进行监督、分析和评估，并制定应对措施，将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的信用风险状况进行评级，并对交易对手设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。

本基金管理人通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险。本基金所投资的证券在证券交易所或银行间市场交易，除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，其余均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金在运作过程中未发生过流动性风险情况。在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。公司每日跟踪监测本基金持有资产的交易量、持仓集中度、流通受限资产占比、可流通资产变现天数、7 日可变现资产比例、信用债券和逆回购质押券最新主体及债项评级、利率债券组合久期、基金杠杆率等涉及资产流动性风险的指标，并设置合理有效的风控阈值进行持续监测。

在负债端，基金管理人详细分析本基金投资者类型、投资者结构、投资者风险偏好和历史申购与赎回数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者赎回需求，制定了健全有效的流动性风险压力测试方法。当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整基金投资策略，预留充足现金头寸、确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如果遇到极端市场情形或发生巨额赎回情形，公司将采取本基金合同约定的巨额赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险指因受各种因素影响而引起的证券及其衍生品市场价格不利波动，使投资组合资产、公司资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控分析，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|--------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 8,661,875.81 | - | - | - | 8,661,875.81 |
| 结算备付金 | 505,570.55 | - | - | - | 505,570.55 |
| 存出保证金 | 119,622.78 | - | - | - | 119,622.78 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 40,720,322.71 | 40,720,322.71 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|-------|----------------|---------------|
| 应收证券清算款 | - | - | - | 213,976.60 | 213,976.60 |
| 应收利息 | - | - | - | 5,620.93 | 5,620.93 |
| 应收申购款 | - | - | - | 6,604.34 | 6,604.34 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 9,287,069.14 | - | - | 40,946,524.58 | 50,233,593.72 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,003,555.71 | 1,003,555.71 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 264,578.50 | 264,578.50 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 61,012.44 | 61,012.44 |
| 应付托管费 | - | - | - | 10,168.73 | 10,168.73 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 375,655.36 | 375,655.36 |
| 其他负债 | - | - | - | 420,440.99 | 420,440.99 |
| 负债总计 | - | - | - | 2,135,411.73 | 2,135,411.73 |
| 利率敏感度缺口 | 9,287,069.14 | - | - | -38,811,112.85 | 48,098,181.99 |
| 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 18,763,982.85 | - | - | - | 18,763,982.85 |
| 结算备付金 | 482,227.12 | - | - | - | 482,227.12 |
| 存出保证金 | 86,699.14 | - | - | - | 86,699.14 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 13,277,576.00 | 13,277,576.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 1,995,451.36 | 1,995,451.36 |
| 应收利息 | - | - | - | 8,414.02 | 8,414.02 |
| 应收申购款 | - | - | - | 3,488.12 | 3,488.12 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 19,332,909.11 | - | - | 15,284,929.50 | 34,617,838.61 |
| 负债 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,068.90 | 2,068.90 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 44,296.29 | 44,296.29 |
| 应付托管费 | - | - | - | 7,382.72 | 7,382.72 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 169,322.90 | 169,322.90 |
| 其他负债 | - | - | - | 580,002.06 | 580,002.06 |
| 负债总计 | - | - | - | 803,072.87 | 803,072.87 |
| 利率敏感度缺口 | 19,332,909.11 | - | - | -14,481,856.63 | 33,814,765.74 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：本基金本报告期末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以

外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

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。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%。本基金投资于消费升级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。

于 2019 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2018 年 12 月 31 日 | |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
| | 公允价值 | 占基金 资产净 值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资 产净值比 例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 40,720,322.71 | 84.66 | 13,277,576.00 | 39.27 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 40,720,322.71 | 84.66 | 13,277,576.00 | 39.27 |

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1% | | |
|----|-------------------------|-----------------------------|-------------------|
| | 2. 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1% | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2019年6月30日） | 上年度末（2018年12月31日） |
| | 基金净资产变动 | 377,790.85 | 75,776.12 |
| | 基金净资产变动 | -377,790.85 | -75,776.12 |

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果，其中，无风险收益率取 2019 年 6 月 30 日十年期国债收益率 3.2254%，利用 2019 年 1 月 1 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 0.93。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 40,720,322.71 | 81.06 |
| | 其中：股票 | 40,720,322.71 | 81.06 |
| 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 | 9,167,446.36 | 18.25 |
| 8 | 其他各项资产 | 345,824.65 | 0.69 |
| 9 | 合计 | 50,233,593.72 | 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。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 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 | 3,117,156.25 | 6.48 |
| C | 制造业 | 25,290,686.58 | 52.58 |
| 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 | 5,800,100.00 | 12.06 |
| 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 | 4,962,400.00 | 10.32 |
| J | 金融业 | 20,320.58 | 0.04 |
| 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 | 1,529,659.30 | 3.18 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 40,720,322.71 | 84.66 |

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。

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 000651 | 格力电器 | 38,000 | 2,090,000.00 | 4.35 |
| 2 | 600859 | 王府井 | 130,000 | 1,974,700.00 | 4.11 |
| 3 | 300755 | 华致酒行 | 55,000 | 1,936,550.00 | 4.03 |
| 4 | 603589 | 口子窖 | 30,000 | 1,932,600.00 | 4.02 |
| 5 | 601933 | 永辉超市 | 185,000 | 1,888,850.00 | 3.93 |
| 6 | 000568 | 泸州老窖 | 23,000 | 1,859,090.00 | 3.87 |
| 7 | 002301 | 齐心集团 | 155,000 | 1,796,450.00 | 3.73 |
| 8 | 600612 | 老凤祥 | 39,927 | 1,784,736.90 | 3.71 |
| 9 | 300206 | 理邦仪器 | 250,000 | 1,682,500.00 | 3.50 |
| 10 | 002675 | 东诚药业 | 150,000 | 1,638,000.00 | 3.41 |
| 11 | 002100 | 天康生物 | 200,000 | 1,620,000.00 | 3.37 |
| 12 | 603986 | 兆易创新 | 18,480 | 1,602,216.00 | 3.33 |
| 13 | 002607 | 亚夏汽车 | 111,410 | 1,529,659.30 | 3.18 |
| 14 | 603605 | 珀莱雅 | 22,600 | 1,495,668.00 | 3.11 |
| 15 | 300033 | 同花顺 | 15,000 | 1,475,400.00 | 3.07 |
| 16 | 002371 | 北方华创 | 20,000 | 1,385,000.00 | 2.88 |
| 17 | 002230 | 科大讯飞 | 40,000 | 1,329,600.00 | 2.76 |
| 18 | 000876 | 新希望 | 70,000 | 1,215,900.00 | 2.53 |
| 19 | 300450 | 先导智能 | 35,000 | 1,176,000.00 | 2.44 |
| 20 | 002237 | 恒邦股份 | 70,000 | 1,169,700.00 | 2.43 |
| 21 | 603363 | 傲农生物 | 60,000 | 1,149,600.00 | 2.39 |
| 22 | 002555 | 三七互娱 | 80,000 | 1,084,000.00 | 2.25 |
| 23 | 600536 | 中国软件 | 20,000 | 1,073,400.00 | 2.23 |
| 24 | 000975 | 银泰资源 | 80,000 | 1,055,200.00 | 2.19 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 25 | 600489 | 中金黄金 | 100,000 | 1,027,000.00 | 2.14 |
| 26 | 002155 | 湖南黄金 | 100,000 | 1,007,000.00 | 2.09 |
| 27 | 600362 | 江西铜业 | 60,000 | 944,400.00 | 1.96 |
| 28 | 300577 | 开润股份 | 20,000 | 704,600.00 | 1.46 |
| 29 | 600968 | 海油发展 | 7,875 | 27,956.25 | 0.06 |
| 30 | 601236 | 红塔证券 | 5,873 | 20,320.58 | 0.04 |
| 31 | 300782 | 卓胜微 | 173 | 18,843.16 | 0.04 |
| 32 | 603867 | 新化股份 | 522 | 13,472.82 | 0.03 |
| 33 | 300594 | 朗进科技 | 270 | 11,909.70 | 0.02 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|-----------------|
| 1 | 002100 | 天康生物 | 10,854,918.00 | 32.10 |
| 2 | 002124 | 天邦股份 | 10,052,866.00 | 29.73 |
| 3 | 002567 | 唐人神 | 7,307,694.00 | 21.61 |
| 4 | 002157 | 正邦科技 | 7,052,784.00 | 20.86 |
| 5 | 600975 | 新五丰 | 6,682,107.43 | 19.76 |
| 6 | 000876 | 新希望 | 5,922,347.00 | 17.51 |
| 7 | 300451 | 创业慧康 | 5,386,544.82 | 15.93 |
| 8 | 601555 | 东吴证券 | 4,954,636.00 | 14.65 |
| 9 | 002912 | 中新赛克 | 4,343,660.00 | 12.85 |
| 10 | 603363 | 傲农生物 | 4,292,025.00 | 12.69 |
| 11 | 601138 | 工业富联 | 4,173,508.14 | 12.34 |
| 12 | 601066 | 中信建投 | 4,171,730.00 | 12.34 |
| 13 | 300604 | 长川科技 | 3,888,822.00 | 11.50 |
| 14 | 300659 | 中孚信息 | 3,826,526.67 | 11.32 |
| 15 | 300033 | 同花顺 | 3,750,365.00 | 11.09 |
| 16 | 002675 | 东诚药业 | 3,627,191.00 | 10.73 |
| 17 | 002714 | 牧原股份 | 3,593,144.00 | 10.63 |
| 18 | 601233 | 桐昆股份 | 3,502,476.00 | 10.36 |
| 19 | 000066 | 中国长城 | 3,491,367.00 | 10.32 |
| 20 | 600990 | 四创电子 | 3,438,843.00 | 10.17 |
| 21 | 300578 | 会畅通讯 | 3,438,164.00 | 10.17 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|-------|
| 22 | 600536 | 中国软件 | 3,412,632.00 | 10.09 |
| 23 | 002607 | 亚夏汽车 | 3,281,673.00 | 9.70 |
| 24 | 000568 | 泸州老窖 | 3,136,685.00 | 9.28 |
| 25 | 000063 | 中兴通讯 | 3,088,488.00 | 9.13 |
| 26 | 002234 | 民和股份 | 3,081,800.00 | 9.11 |
| 27 | 300395 | 菲利华 | 2,948,203.38 | 8.72 |
| 28 | 300119 | 瑞普生物 | 2,927,486.00 | 8.66 |
| 29 | 603019 | 中科曙光 | 2,804,307.52 | 8.29 |
| 30 | 002385 | 大北农 | 2,800,372.00 | 8.28 |
| 31 | 002371 | 北方华创 | 2,774,826.00 | 8.21 |
| 32 | 000651 | 格力电器 | 2,718,245.00 | 8.04 |
| 33 | 300496 | 中科创达 | 2,714,750.00 | 8.03 |
| 34 | 002368 | 太极股份 | 2,679,246.15 | 7.92 |
| 35 | 002373 | 千方科技 | 2,647,800.00 | 7.83 |
| 36 | 603587 | 地素时尚 | 2,595,947.00 | 7.68 |
| 37 | 000729 | 燕京啤酒 | 2,578,597.00 | 7.63 |
| 38 | 601933 | 永辉超市 | 2,460,909.00 | 7.28 |
| 39 | 601990 | 南京证券 | 2,354,590.00 | 6.96 |
| 40 | 601878 | 浙商证券 | 2,340,040.00 | 6.92 |
| 41 | 603136 | 天目湖 | 2,325,247.00 | 6.88 |
| 42 | 000156 | 华数传媒 | 2,279,123.00 | 6.74 |
| 43 | 002555 | 三七互娱 | 2,270,400.00 | 6.71 |
| 44 | 300474 | 景嘉微 | 2,248,681.02 | 6.65 |
| 45 | 002237 | 恒邦股份 | 2,246,572.00 | 6.64 |
| 46 | 600996 | 贵广网络 | 2,178,057.00 | 6.44 |
| 47 | 002376 | 新北洋 | 2,172,282.00 | 6.42 |
| 48 | 300523 | 辰安科技 | 2,166,871.00 | 6.41 |
| 49 | 603200 | 上海洗霸 | 2,103,987.00 | 6.22 |
| 50 | 300166 | 东方国信 | 2,083,978.00 | 6.16 |
| 51 | 002236 | 大华股份 | 2,067,400.00 | 6.11 |
| 52 | 300017 | 网宿科技 | 2,066,000.00 | 6.11 |
| 53 | 300377 | 赢时胜 | 2,030,007.00 | 6.00 |
| 54 | 600088 | 中视传媒 | 1,996,785.00 | 5.91 |
| 55 | 600859 | 王府井 | 1,991,999.00 | 5.89 |
| 56 | 601238 | 广汽集团 | 1,962,149.52 | 5.80 |
| 57 | 002397 | 梦洁股份 | 1,916,448.40 | 5.67 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 58 | 002311 | 海大集团 | 1,881,500.00 | 5.56 |
| 59 | 002396 | 星网锐捷 | 1,851,499.00 | 5.48 |
| 60 | 603186 | 华正新材 | 1,835,075.00 | 5.43 |
| 61 | 002301 | 齐心集团 | 1,804,670.00 | 5.34 |
| 62 | 600754 | 锦江股份 | 1,804,322.00 | 5.34 |
| 63 | 300755 | 华致酒行 | 1,804,019.00 | 5.34 |
| 64 | 603589 | 口子窖 | 1,803,313.23 | 5.33 |
| 65 | 603516 | 淳中科技 | 1,797,586.00 | 5.32 |
| 66 | 300770 | 新媒股份 | 1,786,861.78 | 5.28 |
| 67 | 300212 | 易华录 | 1,783,020.00 | 5.27 |
| 68 | 600037 | 歌华有线 | 1,771,654.00 | 5.24 |
| 69 | 300338 | 开元股份 | 1,759,876.00 | 5.20 |
| 70 | 002734 | 利民股份 | 1,755,172.60 | 5.19 |
| 71 | 000732 | 泰禾集团 | 1,753,428.07 | 5.19 |
| 72 | 600612 | 老凤祥 | 1,748,268.79 | 5.17 |
| 73 | 603160 | 汇顶科技 | 1,739,091.00 | 5.14 |
| 74 | 603609 | 禾丰牧业 | 1,733,979.00 | 5.13 |
| 75 | 000538 | 云南白药 | 1,726,256.00 | 5.11 |
| 76 | 600637 | 东方明珠 | 1,709,375.12 | 5.06 |
| 77 | 300206 | 理邦仪器 | 1,708,959.00 | 5.05 |
| 78 | 000710 | 贝瑞基因 | 1,705,802.00 | 5.04 |
| 79 | 000858 | 五粮液 | 1,697,634.40 | 5.02 |
| 80 | 603986 | 兆易创新 | 1,697,165.40 | 5.02 |
| 81 | 300633 | 开立医疗 | 1,684,330.00 | 4.98 |
| 82 | 000676 | 智度股份 | 1,667,597.00 | 4.93 |
| 83 | 603099 | 长白山 | 1,626,440.00 | 4.81 |
| 84 | 603083 | 剑桥科技 | 1,620,706.00 | 4.79 |
| 85 | 000665 | 湖北广电 | 1,601,041.00 | 4.73 |
| 86 | 002803 | 吉宏股份 | 1,569,672.10 | 4.64 |
| 87 | 603208 | 江山欧派 | 1,568,726.00 | 4.64 |
| 88 | 600959 | 江苏有线 | 1,556,000.00 | 4.60 |
| 89 | 601881 | 中国银河 | 1,533,980.00 | 4.54 |
| 90 | 002238 | 天威视讯 | 1,523,604.40 | 4.51 |
| 91 | 601788 | 光大证券 | 1,521,019.00 | 4.50 |
| 92 | 002320 | 海峡股份 | 1,505,500.00 | 4.45 |
| 93 | 600831 | 广电网络 | 1,500,453.43 | 4.44 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 94 | 600346 | 恒力石化 | 1,482,000.00 | 4.38 |
| 95 | 600389 | 江山股份 | 1,464,453.00 | 4.33 |
| 96 | 300773 | 拉卡拉 | 1,458,960.00 | 4.31 |
| 97 | 300229 | 拓尔思 | 1,405,341.00 | 4.16 |
| 98 | 603826 | 坤彩科技 | 1,405,183.60 | 4.16 |
| 99 | 300413 | 芒果超媒 | 1,401,070.00 | 4.14 |
| 100 | 603605 | 珀莱雅 | 1,380,480.00 | 4.08 |
| 101 | 600837 | 海通证券 | 1,374,000.00 | 4.06 |
| 102 | 002670 | 国盛金控 | 1,310,114.00 | 3.87 |
| 103 | 300552 | 万集科技 | 1,298,982.00 | 3.84 |
| 104 | 300271 | 华宇软件 | 1,295,576.00 | 3.83 |
| 105 | 300144 | 宋城演艺 | 1,285,755.00 | 3.80 |
| 106 | 600737 | 中粮糖业 | 1,269,153.00 | 3.75 |
| 107 | 002230 | 科大讯飞 | 1,265,882.00 | 3.74 |
| 108 | 002123 | 梦网集团 | 1,253,270.00 | 3.71 |
| 109 | 000917 | 电广传媒 | 1,249,447.00 | 3.69 |
| 110 | 002796 | 世嘉科技 | 1,210,588.00 | 3.58 |
| 111 | 600201 | 生物股份 | 1,197,976.00 | 3.54 |
| 112 | 002809 | 红墙股份 | 1,197,868.00 | 3.54 |
| 113 | 600369 | 西南证券 | 1,190,000.00 | 3.52 |
| 114 | 300450 | 先导智能 | 1,186,040.00 | 3.51 |
| 115 | 600398 | 海澜之家 | 1,165,500.00 | 3.45 |
| 116 | 603708 | 家家悦 | 1,164,654.00 | 3.44 |
| 117 | 600390 | 五矿资本 | 1,163,527.00 | 3.44 |
| 118 | 002321 | 华英农业 | 1,157,378.00 | 3.42 |
| 119 | 002195 | 二三四五 | 1,143,000.00 | 3.38 |
| 120 | 600735 | 新华锦 | 1,129,005.00 | 3.34 |
| 121 | 601398 | 工商银行 | 1,128,000.00 | 3.34 |
| 122 | 300567 | 精测电子 | 1,125,807.00 | 3.33 |
| 123 | 300308 | 中际旭创 | 1,123,928.00 | 3.32 |
| 124 | 300134 | 大富科技 | 1,122,983.00 | 3.32 |
| 125 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,095,000.00 | 3.24 |
| 126 | 000975 | 银泰资源 | 1,094,500.00 | 3.24 |
| 127 | 300482 | 万孚生物 | 1,069,366.00 | 3.16 |
| 128 | 300282 | 三盛教育 | 1,046,681.56 | 3.10 |
| 129 | 600728 | 佳都科技 | 1,040,850.00 | 3.08 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 130 | 300473 | 德尔股份 | 1,035,385.00 | 3.06 |
| 131 | 603690 | 至纯科技 | 1,029,070.00 | 3.04 |
| 132 | 300352 | 北信源 | 1,028,120.00 | 3.04 |
| 133 | 002155 | 湖南黄金 | 1,027,950.00 | 3.04 |
| 134 | 600489 | 中金黄金 | 1,005,984.00 | 2.97 |
| 135 | 601577 | 长沙银行 | 1,001,323.00 | 2.96 |
| 136 | 002153 | 石基信息 | 996,623.00 | 2.95 |
| 137 | 002405 | 四维图新 | 993,583.00 | 2.94 |
| 138 | 600362 | 江西铜业 | 951,373.00 | 2.81 |
| 139 | 000001 | 平安银行 | 946,400.00 | 2.80 |
| 140 | 601212 | 白银有色 | 946,000.00 | 2.80 |
| 141 | 001979 | 招商蛇口 | 937,240.00 | 2.77 |
| 142 | 603214 | 爱婴室 | 926,500.00 | 2.74 |
| 143 | 002878 | 元隆雅图 | 925,595.00 | 2.74 |
| 144 | 300498 | 温氏股份 | 897,477.14 | 2.65 |
| 145 | 000547 | 航天发展 | 886,443.44 | 2.62 |
| 146 | 600958 | 东方证券 | 860,300.00 | 2.54 |
| 147 | 300251 | 光线传媒 | 849,000.00 | 2.51 |
| 148 | 300177 | 中海达 | 848,854.00 | 2.51 |
| 149 | 603181 | 皇马科技 | 848,435.00 | 2.51 |
| 150 | 300031 | 宝通科技 | 840,465.00 | 2.49 |
| 151 | 600977 | 中国电影 | 829,621.40 | 2.45 |
| 152 | 002299 | 圣农发展 | 827,557.00 | 2.45 |
| 153 | 002696 | 百洋股份 | 800,000.00 | 2.37 |
| 154 | 002832 | 比音勒芬 | 779,486.00 | 2.31 |
| 155 | 300548 | 博创科技 | 773,448.00 | 2.29 |
| 156 | 002563 | 森马服饰 | 761,156.00 | 2.25 |
| 157 | 000703 | 恒逸石化 | 748,113.00 | 2.21 |
| 158 | 600919 | 江苏银行 | 718,011.00 | 2.12 |
| 159 | 601009 | 南京银行 | 709,300.00 | 2.10 |
| 160 | 600030 | 中信证券 | 705,200.00 | 2.09 |

注：买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值 |
|----|------|------|----------|-----------|
|----|------|------|----------|-----------|

| | | | | 比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|--------|
| 1 | 002100 | 天康生物 | 9,677,342.00 | 28.62 |
| 2 | 002567 | 唐人神 | 9,547,667.84 | 28.24 |
| 3 | 002124 | 天邦股份 | 9,460,009.00 | 27.98 |
| 4 | 600975 | 新五丰 | 9,099,763.20 | 26.91 |
| 5 | 002157 | 正邦科技 | 7,585,309.00 | 22.43 |
| 6 | 300451 | 创业慧康 | 5,530,210.00 | 16.35 |
| 7 | 601066 | 中信建投 | 5,193,079.00 | 15.36 |
| 8 | 601555 | 东吴证券 | 5,130,567.30 | 15.17 |
| 9 | 000876 | 新希望 | 4,797,564.00 | 14.19 |
| 10 | 300659 | 中孚信息 | 4,689,599.00 | 13.87 |
| 11 | 002912 | 中新赛克 | 4,441,783.00 | 13.14 |
| 12 | 601138 | 工业富联 | 4,272,688.00 | 12.64 |
| 13 | 300604 | 长川科技 | 4,267,814.07 | 12.62 |
| 14 | 000066 | 中国长城 | 4,038,581.00 | 11.94 |
| 15 | 601233 | 桐昆股份 | 3,772,271.00 | 11.16 |
| 16 | 300578 | 会畅通讯 | 3,694,485.00 | 10.93 |
| 17 | 002714 | 牧原股份 | 3,557,807.00 | 10.52 |
| 18 | 300119 | 瑞普生物 | 3,379,915.00 | 10.00 |
| 19 | 002234 | 民和股份 | 3,172,650.00 | 9.38 |
| 20 | 603363 | 傲农生物 | 3,116,941.00 | 9.22 |
| 21 | 600990 | 四创电子 | 3,065,890.80 | 9.07 |
| 22 | 000063 | 中兴通讯 | 2,987,626.00 | 8.84 |
| 23 | 002385 | 大北农 | 2,858,328.00 | 8.45 |
| 24 | 300395 | 菲利华 | 2,772,071.94 | 8.20 |
| 25 | 300496 | 中科创达 | 2,712,015.00 | 8.02 |
| 26 | 603587 | 地素时尚 | 2,630,546.72 | 7.78 |
| 27 | 002373 | 千方科技 | 2,622,356.00 | 7.76 |
| 28 | 603019 | 中科曙光 | 2,612,261.00 | 7.73 |
| 29 | 600536 | 中国软件 | 2,608,431.00 | 7.71 |
| 30 | 002607 | 亚夏汽车 | 2,508,280.50 | 7.42 |
| 31 | 000729 | 燕京啤酒 | 2,467,914.00 | 7.30 |
| 32 | 002368 | 太极股份 | 2,456,592.08 | 7.26 |
| 33 | 601990 | 南京证券 | 2,427,151.00 | 7.18 |
| 34 | 601878 | 浙商证券 | 2,389,868.00 | 7.07 |
| 35 | 300377 | 赢时胜 | 2,335,716.00 | 6.91 |
| 36 | 002376 | 新北洋 | 2,314,200.00 | 6.84 |
| 37 | 300474 | 景嘉微 | 2,283,970.10 | 6.75 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 38 | 002397 | 梦洁股份 | 2,251,063.20 | 6.66 |
| 39 | 300166 | 东方国信 | 2,220,000.00 | 6.57 |
| 40 | 603516 | 淳中科技 | 2,189,491.00 | 6.47 |
| 41 | 603186 | 华正新材 | 2,127,265.00 | 6.29 |
| 42 | 002236 | 大华股份 | 2,106,572.00 | 6.23 |
| 43 | 300033 | 同花顺 | 2,103,400.00 | 6.22 |
| 44 | 000156 | 华数传媒 | 2,100,438.00 | 6.21 |
| 45 | 300567 | 精测电子 | 2,071,939.00 | 6.13 |
| 46 | 603200 | 上海洗霸 | 2,069,344.00 | 6.12 |
| 47 | 002734 | 利民股份 | 2,011,420.00 | 5.95 |
| 48 | 603136 | 天目湖 | 1,962,382.70 | 5.80 |
| 49 | 002396 | 星网锐捷 | 1,938,262.95 | 5.73 |
| 50 | 600977 | 中国电影 | 1,931,350.00 | 5.71 |
| 51 | 002371 | 北方华创 | 1,900,823.00 | 5.62 |
| 52 | 300523 | 辰安科技 | 1,884,741.00 | 5.57 |
| 53 | 300017 | 网宿科技 | 1,884,000.00 | 5.57 |
| 54 | 601238 | 广汽集团 | 1,869,500.00 | 5.53 |
| 55 | 002311 | 海大集团 | 1,869,025.00 | 5.53 |
| 56 | 300770 | 新媒股份 | 1,817,577.60 | 5.38 |
| 57 | 002803 | 吉宏股份 | 1,808,132.00 | 5.35 |
| 58 | 000732 | 泰禾集团 | 1,782,014.00 | 5.27 |
| 59 | 002675 | 东诚药业 | 1,757,604.00 | 5.20 |
| 60 | 000710 | 贝瑞基因 | 1,743,236.00 | 5.16 |
| 61 | 600996 | 贵广网络 | 1,720,000.00 | 5.09 |
| 62 | 000538 | 云南白药 | 1,716,235.00 | 5.08 |
| 63 | 300413 | 芒果超媒 | 1,714,588.00 | 5.07 |
| 64 | 603609 | 禾丰牧业 | 1,708,005.00 | 5.05 |
| 65 | 603160 | 汇顶科技 | 1,700,784.00 | 5.03 |
| 66 | 300212 | 易华录 | 1,693,212.00 | 5.01 |
| 67 | 600754 | 锦江股份 | 1,689,139.00 | 5.00 |
| 68 | 300633 | 开立医疗 | 1,662,837.98 | 4.92 |
| 69 | 000568 | 泸州老窖 | 1,643,970.00 | 4.86 |
| 70 | 601881 | 中国银河 | 1,607,700.00 | 4.75 |
| 71 | 000676 | 智度股份 | 1,585,820.00 | 4.69 |
| 72 | 002123 | 梦网集团 | 1,578,805.00 | 4.67 |
| 73 | 603099 | 长白山 | 1,570,904.00 | 4.65 |
| 74 | 603103 | 横店影视 | 1,528,682.00 | 4.52 |
| 75 | 603208 | 江山欧派 | 1,527,009.00 | 4.52 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 76 | 601788 | 光大证券 | 1,516,000.00 | 4.48 |
| 77 | 600037 | 歌华有线 | 1,503,200.00 | 4.45 |
| 78 | 600346 | 恒力石化 | 1,492,066.00 | 4.41 |
| 79 | 300747 | 锐科激光 | 1,491,242.00 | 4.41 |
| 80 | 600389 | 江山股份 | 1,487,247.00 | 4.40 |
| 81 | 603826 | 坤彩科技 | 1,479,625.00 | 4.38 |
| 82 | 600637 | 东方明珠 | 1,475,366.00 | 4.36 |
| 83 | 000858 | 五粮液 | 1,464,565.00 | 4.33 |
| 84 | 600088 | 中视传媒 | 1,459,222.00 | 4.32 |
| 85 | 603690 | 至纯科技 | 1,455,784.00 | 4.31 |
| 86 | 002320 | 海峡股份 | 1,437,592.40 | 4.25 |
| 87 | 603083 | 剑桥科技 | 1,422,000.00 | 4.21 |
| 88 | 601888 | 中国国旅 | 1,419,733.00 | 4.20 |
| 89 | 600837 | 海通证券 | 1,416,994.00 | 4.19 |
| 90 | 300338 | 开元股份 | 1,410,245.00 | 4.17 |
| 91 | 600959 | 江苏有线 | 1,406,336.70 | 4.16 |
| 92 | 300271 | 华宇软件 | 1,382,094.00 | 4.09 |
| 93 | 000665 | 湖北广电 | 1,341,306.60 | 3.97 |
| 94 | 300251 | 光线传媒 | 1,321,400.00 | 3.91 |
| 95 | 002237 | 恒邦股份 | 1,305,355.00 | 3.86 |
| 96 | 600737 | 中粮糖业 | 1,293,995.00 | 3.83 |
| 97 | 300352 | 北信源 | 1,292,500.00 | 3.82 |
| 98 | 300773 | 拉卡拉 | 1,292,252.00 | 3.82 |
| 99 | 603708 | 家家悦 | 1,254,730.00 | 3.71 |
| 100 | 300144 | 宋城演艺 | 1,239,705.00 | 3.67 |
| 101 | 002153 | 石基信息 | 1,239,000.00 | 3.66 |
| 102 | 002238 | 天威视讯 | 1,236,538.72 | 3.66 |
| 103 | 300552 | 万集科技 | 1,230,122.00 | 3.64 |
| 104 | 002405 | 四维图新 | 1,230,000.00 | 3.64 |
| 105 | 600369 | 西南证券 | 1,220,800.00 | 3.61 |
| 106 | 300282 | 三盛教育 | 1,213,018.00 | 3.59 |
| 107 | 600831 | 广电网络 | 1,205,315.00 | 3.56 |
| 108 | 002191 | 劲嘉股份 | 1,202,730.00 | 3.56 |
| 109 | 000802 | 北京文化 | 1,200,600.00 | 3.55 |
| 110 | 002809 | 红墙股份 | 1,196,277.00 | 3.54 |
| 111 | 600373 | 中文传媒 | 1,189,542.89 | 3.52 |
| 112 | 002321 | 华英农业 | 1,184,911.00 | 3.50 |
| 113 | 002670 | 国盛金控 | 1,180,482.00 | 3.49 |

| | | | | |
|-----|--------|------|--------------|------|
| 114 | 600390 | 五矿资本 | 1,177,147.00 | 3.48 |
| 115 | 600340 | 华夏幸福 | 1,171,178.83 | 3.46 |
| 116 | 601398 | 工商银行 | 1,168,000.00 | 3.45 |
| 117 | 600398 | 海澜之家 | 1,158,660.00 | 3.43 |
| 118 | 002796 | 世嘉科技 | 1,157,104.00 | 3.42 |
| 119 | 600201 | 生物股份 | 1,136,900.00 | 3.36 |
| 120 | 600728 | 佳都科技 | 1,130,002.00 | 3.34 |
| 121 | 002555 | 三七互娱 | 1,124,343.00 | 3.33 |
| 122 | 300498 | 温氏股份 | 1,117,861.00 | 3.31 |
| 123 | 600735 | 新华锦 | 1,106,917.00 | 3.27 |
| 124 | 000001 | 平安银行 | 1,096,000.00 | 3.24 |
| 125 | 000917 | 电广传媒 | 1,092,913.00 | 3.23 |
| 126 | 300229 | 拓尔思 | 1,080,588.00 | 3.20 |
| 127 | 300134 | 大富科技 | 1,073,762.00 | 3.18 |
| 128 | 002739 | 万达电影 | 1,067,500.00 | 3.16 |
| 129 | 001979 | 招商蛇口 | 1,061,940.00 | 3.14 |
| 130 | 300482 | 万孚生物 | 1,049,712.00 | 3.10 |
| 131 | 002878 | 元隆雅图 | 1,047,019.00 | 3.10 |
| 132 | 000547 | 航天发展 | 1,021,241.10 | 3.02 |
| 133 | 002195 | 二三四五 | 1,010,000.00 | 2.99 |
| 134 | 601577 | 长沙银行 | 972,400.00 | 2.88 |
| 135 | 002832 | 比音勒芬 | 968,030.00 | 2.86 |
| 136 | 000681 | 视觉中国 | 954,580.00 | 2.82 |
| 137 | 300473 | 德尔股份 | 949,929.47 | 2.81 |
| 138 | 603444 | 吉比特 | 944,611.00 | 2.79 |
| 139 | 600030 | 中信证券 | 934,000.00 | 2.76 |
| 140 | 002905 | 金逸影视 | 918,000.00 | 2.71 |
| 141 | 601212 | 白银有色 | 908,000.00 | 2.69 |
| 142 | 300308 | 中际旭创 | 875,142.00 | 2.59 |
| 143 | 603214 | 爱婴室 | 871,239.00 | 2.58 |
| 144 | 603181 | 皇马科技 | 843,924.00 | 2.50 |
| 145 | 600958 | 东方证券 | 840,000.00 | 2.48 |
| 146 | 300177 | 中海达 | 816,000.00 | 2.41 |
| 147 | 300548 | 博创科技 | 808,594.00 | 2.39 |
| 148 | 002299 | 圣农发展 | 796,504.00 | 2.36 |
| 149 | 002696 | 百洋股份 | 790,630.50 | 2.34 |
| 150 | 300031 | 宝通科技 | 788,015.00 | 2.33 |
| 151 | 002563 | 森马服饰 | 751,828.00 | 2.22 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 152 | 600919 | 江苏银行 | 738,000.00 | 2.18 |
| 153 | 000703 | 恒逸石化 | 726,222.00 | 2.15 |
| 154 | 601009 | 南京银行 | 711,000.00 | 2.10 |
| 155 | 601933 | 永辉超市 | 684,500.00 | 2.02 |

注：卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 340,915,439.95 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 323,417,123.07 |

注：买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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

注：本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本报告期末本基金未持有股指期货。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 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。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 119,622.78 |
| 2 | 应收证券清算款 | 213,976.60 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 5,620.93 |
| 5 | 应收申购款 | 6,604.34 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 345,824.65 |

7.12.4 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。

7.12.5 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的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|---------------|------------|---------------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份 额比例 | 持有份额 | 占总份 额比例 |
| 2,557 | 17,845.24 | 10,000,200.00 | 21.92% | 35,630,090.75 | 78.08% |

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 8,904.43 | 0.0195% |

注：本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 0~10 万份。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占 基金总份额 比例（%） | 发起份额总数 | 发起份额占 基金总份额 比例（%） | 发起份额承 诺持有期限 |
|-------------|---------------|-------------------------|---------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资金 | 10,000,200.00 | 21.92 | 10,000,200.00 | 21.92 | 不少于 3 年 |
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,000,200.00 | 21.92 | 10,000,200.00 | 21.92 | 不少于 3 年 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2016年12月15日）基金份额总额 | 510,634,432.14 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 41,361,660.54 |
| 本报告期基金总申购份额 | 30,540,129.33 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 26,271,499.12 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 45,630,290.75 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

自 2019 年 1 月 22 日起，叶文煌先生担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，吴若曼女士不再担任基金托管人资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东吴证券 | 2 | 606,967,703.43 | 91.41% | 565,269.28 | 91.41% | - |
| 东方证券 | 1 | 57,042,017.87 | 8.59% | 53,123.92 | 8.59% | - |
| 长江证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

(1) 券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与中邮创业基金管理股份有限公司有互补性、在最近一年内无重大违规行为。

(2) 券商经纪人具有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、

资本市场、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据中邮创业基金管理股份有限公司所管理基金的特定要求，提供研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

(3) 券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠合理的佣金率。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。基金管理人与被选择的证券公司签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。

2、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金不存在交易单元退租情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|--------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东吴证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|-----------|------------|
| 1 | 关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额并参加基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019年1月3日 |
| 2 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳前海财厚基金销售有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报 | 2019年1月3日 |
| 3 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于网上直销平台、官方微信平台申购及定投费率优惠的公告 | 中国证券报 | 2019年1月4日 |
| 4 | 关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整东海证券基金定投业务单笔最低限额的公告 | 中国证券报 | 2019年1月18日 |
| 5 | 中邮消费升级灵活配置混合型发 | 中国证券报、上海证 | 2019年1月22日 |

| | | | |
|----|---|-----------------------|-----------------|
| | 起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告 | 券报、证券时报、证券日报 | |
| 6 | 中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金更新招募说明书（2019 年 1 号） | 上海证券报 | 2019 年 1 月 24 日 |
| 7 | 关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加代销机构基金申购及定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019 年 2 月 20 日 |
| 8 | 关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通国信证券股份有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019 年 3 月 4 日 |
| 9 | 中邮创业基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报 | 2019 年 3 月 5 日 |
| 10 | 关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通基金定投业务并参加基金申购及定投申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019 年 3 月 5 日 |
| 11 | 关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加基金申购费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019 年 3 月 7 日 |
| 12 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于增加江苏天鼎证券投资咨询有限公司为代销机构的公告 | 中国证券报 | 2019 年 3 月 7 日 |
| 13 | 中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告 | 中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2019 年 3 月 28 日 |
| 14 | 中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告 | 上海证券报 | 2019 年 4 月 19 日 |
| 15 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金申购金额下限的公告 | 中国证券报 | 2019 年 5 月 15 日 |
| 16 | 关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通上海天天基金销售有限公司基金定投业务并参加基金定投费率优惠活动的公告 | 中国证券报 | 2019 年 5 月 15 日 |
| 17 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于代销机构调整基金定期定额投资金额下限的公告 | 中国证券报 | 2019 年 5 月 17 日 |

| | | | |
|----|---|-------|-----------------|
| 18 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于增加海银基金销售有限公司等机构为代销机构的公告 | 中国证券报 | 2019 年 5 月 22 日 |
| 19 | 中邮创业基金管理股份有限公司直销平台认购费率及申购费率优惠的公告 | 中国证券报 | 2019 年 5 月 24 日 |
| 20 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告 | 中国证券报 | 2019 年 6 月 21 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|--|---------------|------|------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20190101-20190313 20190403-20190407 20190423-20190423 20190506-20190630 | 10,000,200.00 | - | - | 10,000,200.00 | 21.92% |
| 个人 | 1 | 20190101-20190313 20190403-20190407 20190423-20190423 20190506-20190630 | 10,001,800.00 | - | - | 10,001,800.00 | 21.92% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%引起的风险，主要是由于持有人结构相对集中，机构同质化，资金呈现“大进大出”特点，在市场突变情况下，赎回行为高度一致，给基金投资运作可能会带来较大压力，使得基金资产的变现能力和投资者赎回管理的匹配与平衡可能面临较大考验，继而可能给基金带来潜在的流动性风险。 | | | | | | | |

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》
4. 《中邮消费升级灵活配置混合型发起式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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 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

2019年8月26日