中邮核心主题混合型证券投资基金
2020 年年度报告

2020 年 12 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 11 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮核心主题混合型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。

基金托管人招商银行股份有限公司（简称：招商银行）根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 10 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。

本报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 8
2.4 信息披露方式 8
2.5 其他相关资料 9
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 10
3.1 主要会计数据和财务指标 10
3.2 基金净值表现 10
3.3 其他指标 ..... **错误！未定义书签。**
3.4 过去三年基金的利润分配情况 12
§4 管理人报告 13
4.1 基金管理人及基金经理情况 13
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 19
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 19
4.10 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 19
§5 托管人报告 20
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 20
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 20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 20
§6 审计报告 21
6.1 审计报告基本信息 21
6.2 审计报告的基本内容 21
§7 年度财务报表 24
7.1 资产负债表 24
7.2 利润表 25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 26
7.4 报表附注 27
§8 投资组合报告 55
8.1 期末基金资产组合情况 55
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 55
8.3 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 56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 65

8.6 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 65
8.7 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 65
8.8 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 65
8.9 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 65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 65
8.12 投资组合报告附注 66
§9 基金份额持有人信息 67
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 67
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 67
9.3 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 67
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 ..... **错误！未定义书签。**
§10 开放式基金份额变动 68
§11 重大事件揭示 69
11.1 基金份额持有人大会决议 69
11.2 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 69
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 69
11.4 基金投资策略的改变 69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 69
11.8 其他重大事件 71
§12 影响投资者决策的其他重要信息 76
12.1 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 76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 76
§13 备查文件目录 77
13.1 备查文件目录 77
13.2 存放地点 77
13.3 查阅方式 77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮核心主题混合型证券投资基金
基金简称	中邮核心主题混合
基金主代码	590005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 5 月 19 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	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	284,386,007.83 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注中国经济结构调整过程中带来的投资机会，采用主题策略和核心策略相结合的方法筛选核心主题企业，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	1. 大类资产配置策略 本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行大类资产配置。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。 2. 股票投资策略 本基金采用主题投资策略与核心投资策略相结合的方法进行股票投资：主题投资策略是自上而下挖掘出可能导致经济结构发生根本性变化的因素，分析这些根本变化的内涵，再形成与之相匹配的投资主题，然后再选择能够受益于该投资主题的上市公司，构建股票组合进行投资。本基金采用主题投资策略作为股票投资的主要策略，在具体的择股过程中还将核心投资策略作为辅助策略，同等条件下优先选择具有核心竞争力的企业进行投资。 （1）主题挖掘 本基金在进行主题挖掘的时候采用纵向和横向相结合的方式，同时关注主题的生命周期。 本基金将通过自上而下的方式，从宏观经济、国家政策、社会文化、人口结构、科技进步等多个纵向角度出发，在深入研究的基础上，分析影响经济发展和企业盈利的关键性因素，从而前瞻性地挖掘出中国经济结构调整过程中不断涌现出的有深刻影响力的投资主题。横向的主题挖掘主要是指将“中国经济结构调整”

	从生产领域、流通领域、消费领域、区域经济和资本市场五个方向分解，把握经济结构调整的脉搏，细分出具有实际投资意义的细分主题。 在主题挖掘同时，本基金还将判断“主题的生命周期”并对其进行阶段划分。“主题的生命周期”是指投资主题对经济和资本市场的影响持续期。对“主题的生命周期”进行阶段划分的根据是投资主题对经济和资本市场影响力的强弱。主题的生命周期一般分为四个阶段：主题萌芽、主题形成、主题实现和主题衰退。 (2) 主题配置 在主题挖掘的基础上，基金管理人定期召开投资决策委员会会议，由宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员和基金经理对主题进行评估，综合考虑主题发展阶段、主题催化因素、主题市场容量、主题估值水平等因素，确定每个主题的配置权重范围，从而进行主题配置。 (3) 个股选择 本基金通过主题投资策略和核心投资策略相结合的方法构建股票备选库和精选库，重点投资核心主题企业。核心主题企业是指与本基金确立的投资主题相符且具有核心竞争力的企业。核心投资策略是指对企业核心竞争力的综合评价方法，主要从公司盈利模式、政策环境、财务状况、治理结构以及市场估值等方面进行评估。通过定性和定量分析相结合的方法筛选出具有如下特质的上市公司进行投资：主营业务突出，发展战略明晰，具有良好的创新能力，信息披露透明；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；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；具有持续经营能力和偿债能力，资产负债率合理；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，净资产收益率处在领先水平；财务管理能力较强，现金收支安排有序；股东回报良好，分红比例稳定。 备选库的构建 在确立投资主题及投资主题配置比例之后，本基金将选择与投资主题相关联的股票进入备选库，并依据个股的“主题相关度”排序。本基金主要根据企业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。打分的依据主要有以下几个方面： 公司所处行业受宏观经济环境和国家产业政策的影响程度。

	公司主营业务收入和利润受此主题驱动的变动幅度。 公司的盈利模式。 公司竞争力分析，包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等。 公司财务状况及财务管理能力，包括财务安全性指标，反映行业特性的主要财务指标、公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等。 精选库的构建 在备选库的基础上，精选主题相关度得分高、流动性好、市场估值合理且具有核心竞争力的优质上市公司构成本基金的精选库。 主题相关度由研究员根据公司业绩受主题驱动弹性的大小进行打分确定； 流动性指标主要参考流动市值、总市值和日均成交金额等指标； 估值指标选用市盈率、市净率和市销率； 企业核心竞争力的评价采用核心投资策略，兼顾价值和成长因素，采用定性和定量相结合的方法配合研究员实地调研结果筛选公司发展战略明晰、具备比较优势、治理结构良好的企业。具体而言，应从以下方面精选个股： 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。 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；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。 具有持续经营能力和偿债能力，资产负债率合理。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。净资产收益率处在领先水平。 财务管理能力较强，现金收支安排有序。 股东回报良好，分红比例较为稳定。 3. 债券投资策略 (1) 平均久期配置 本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。 (2) 期限结构配置 结合对宏观经济形势和政策的判断，运用统计和数量分析技术，本基金对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析，预测收益率曲线的变化趋势，制定组合的期限结构配置策略。

	(3) 类属配置 本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。 (4) 回购套利 本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内，适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率，比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险的套利操作。 4. 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。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%＋上证国债指数×20%
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	张燕
	联系电话	010-82295160—157	0755-83199084
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		010－58511618	95555
传真		010-82295155	0755-83195201
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100013	518040
法定代表人		毕劲松	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn

基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	致同会计师事务所（特殊普通合伙人）	北京市建国门外大街 22 号赛特广场五层
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	461,700,768.27	176,350,715.09	-266,051,018.96
本期利润	564,610,233.22	295,903,228.06	-459,777,411.31
加权平均基金份额本期利润	1.4324	0.5043	-0.7246
本期加权平均净值利润率	61.27%	33.75%	-47.68%
本期基金份额净值增长率	82.86%	41.32%	-37.96%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	499,406,086.96	300,043,534.23	120,117,114.70
期末可供分配基金份额利润	1.7561	0.5650	0.1931
期末基金资产净值	876,901,808.56	895,199,992.52	742,062,843.26
期末基金份额净值	3.083	1.686	1.193
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	256.27%	94.83%	37.86%

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
过去三个月	16.91%	1.54%	10.88%	0.79%	6.03%	0.75%
过去六个月	21.33%	1.78%	20.06%	1.08%	1.27%	0.70%
过去一年	82.86%	1.84%	22.61%	1.14%	60.25%	0.70%
过去三年	60.32%	1.57%	27.50%	1.07%	32.82%	0.50%
过去五年	29.59%	1.54%	37.37%	1.00%	-7.78%	0.54%
自基金合同生效起至今	256.27%	1.61%	87.04%	1.16%	169.23%	0.45%

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

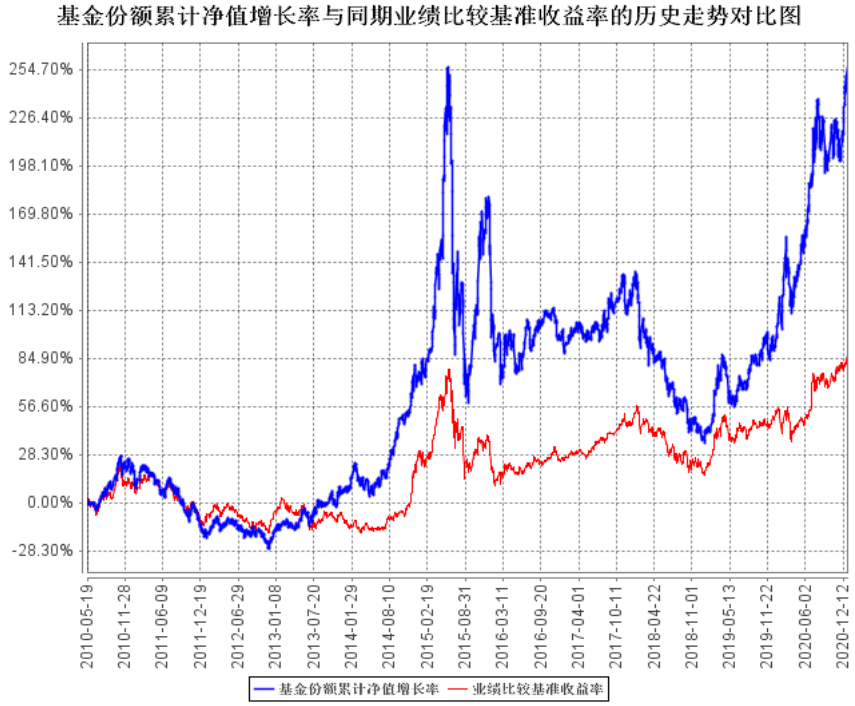
于所列数字。

本基金业绩衡量基准＝沪深 300 指数×80%＋上证国债指数×20%

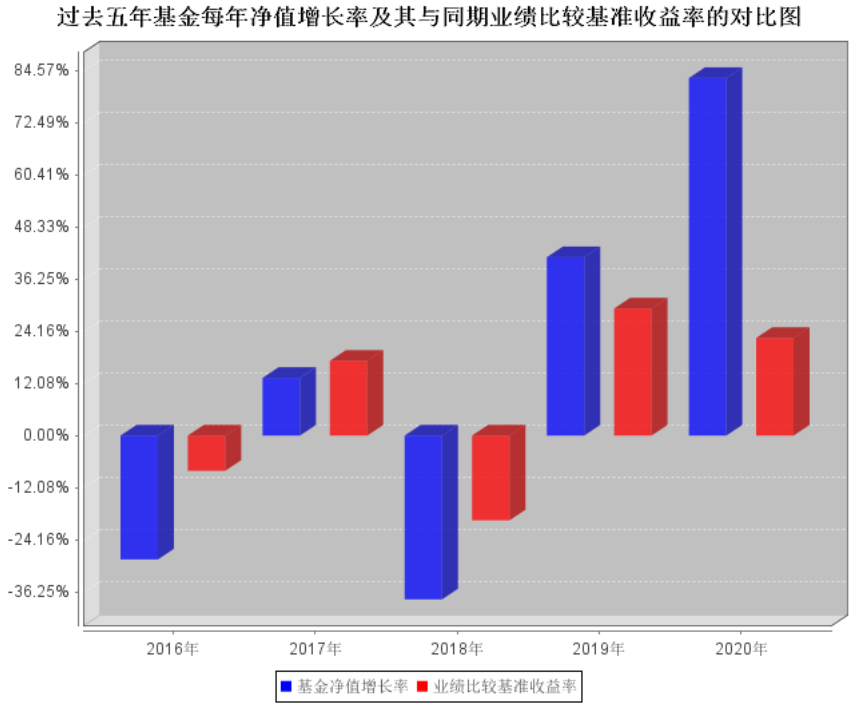
沪深 300 指数作为按流通股本加权的跨两市蓝筹股指数，其指数样本股市值覆盖了上交所和深交所上市的所有股票市值的 70%，具有较强的代表意义。

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数中沪深 300 指数和上证国债指数每日分别计算收益率，然后按 80%、20%的比例采取再平衡，再用循环计算的方式得到基准指数的时间序列。

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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金在过去的三年未实施利润分配。

§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 12 月 31 日，本公司共管理 42 只开放式基金产品，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、中邮中证 5000 指数增强型证券投资基金(转型前：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者证券投资基金、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、中邮中证价值回报量化策略指数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、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、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、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金。

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		
陈梁	基金经理	2015 年 3 月 13 日	-	11 年	曾担任大连实德集团市场专员、华夏基金管理有限公司行业研究

					员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员，中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理；现任中邮创业基金管理股份有限公司投资部副总经理、中邮核心主题混合型证券投资基金基金经理、中邮稳健合赢债券型证券投资基金基金经理、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型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基金经理注册或变更等通知的日期。

4.1.3 基金经理薪酬机制

公司用职级职等管理办法作为薪酬管理机制，根据员工不同的工作内容及工作表现，设立不同序列、不同职级以及不同职等。基金经理作为公司运营的核心，设立单独职级序列。基金经理薪酬严格按照职级职等管理办法进行管理。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，制定了《中邮基金管理股份有限公司公平交易制度》。从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内

控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

基金经理严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易相关制度要求执行，对公平交易进行管理，独立确定投资组合的交易价格和数量。报告期内，不存在违反公平交易制度的情况。

4.3.3 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

开年市场延续了从中美达成第一阶段协议开始（19 年 12 月 15 日）的春季躁动状态，外资在全球市场的再配置和国内资金的持续性流入使得开年市场呈现很好的赚钱效应，医药和新兴方向的个股都得了资金的追捧。

春节后第一个交易日（2 月 3 日），由于疫情的影响市场出现恐慌，单日上证综指下跌 7.72%，

创业板指数下跌 6.85%，大量个股跌停。但从第二个交易日开始市场开始强劲反弹，新兴成长方向快速上涨，5G、新能源汽车、半导体和消费电子得到资金的持续追捧，市场情绪狂热。

但着新冠疫情在全球范围的扩散，美股从 2 月下旬开始明显调整，2 月最后一周美股跌幅超过 10%。海外进入 Risk Off 模式，外资开始持续性流出，同时海外的巨幅波动，对 A 股投资者的风险偏好产生影响。2 月 25 日 A 股暴跌后拉回，从 26 日起，A 股同样进入了 Risk Off 状态。

截至 3 月下旬本轮美股在短短 1 月份内各主要指数分别下跌了 30-35%,期间出现了多次熔断。随着一季度末美联储宣布将实施不限量、开放式量化宽松，包括不设上限购买国债和 MBS，向消费者和企业提供信贷，通过 PMCCF、SMCCF 购买公司债，扩大 CPFF 购买范围等。基于疫情恐慌下的流动性危机得到了遏制，同时各国财政大幅发力，虽然疫情在全球继续肆虐，经济状况承压，但全球经济大萧条的预期得到了修正，全球金融市场企稳并大幅反弹。

国内疫情在二季度基本得到控制，复工复产稳步推行。二季度政治局会议明确“做好较长时间应对外部环境变化的思想准备和工作准备”，同时出台了《中共中央、国务院关于构建更加完善的要素市场化配置体制机制的意见》。并在两会期间提出了“构建国内国际双循环相互促进的新发展格局”。加强内部改革，进一步释放内需和活力，“以我为主”的政策导向明确。

在经历了三个月连续的 PMI 超过 50 的枯荣线后，国内经济复苏态势明朗。从 7 月份起市场的交易状态发生了比较明显的变化，从之前的衰退交易开始转为复苏交易，同时国内积极的财政和货币政策仍在持续，并最终形成了指数级别的暴涨。7 月单月上证综指上涨 10.9%、创业板综指上涨 13.85%、Wind 全 A 上涨 13.06%。

随着 7 月底政治局会议对政策正常化的定调，8 月复苏交易开始明显占优，上半年表现较好的科技和医药出现了较大幅度的调整。20 年 8 月 20 日出台了对房地产企业融资“三道红线”的政策，并从 2021 年开始执行。市场开始担心作为信用扩张主体的房地产投资的系统性放缓，影响经济复苏的持续度，在微观上地产相关链条开始出现明显调整，轻工、家电、建材等部分标的出现比较大调整。

随着 9 月欧洲疫情的二次爆发和美国疫情三次爆发的苗头，美股波动率抬升出现较大幅度回撤，也带来医药和消费的大调整。9 月上证综指下跌 5.23%、创业板综指下跌 4.80%，Wind 全 A 下跌 5.97%。

10 月份市场进入到三季报的集中披露期，对成长标的而言进入到估值切换期。而在美国大选上，拜登呈现出明显的优势，市场开始同步进行拜登交易，新能源方向表现较好。汽车（12.24%）、家电（7.44%）和电新（6.23%）涨幅居前。10 月成长明显跑赢价值。上证综指上涨 0.2%，创业板综指上涨 3.14%，Wind 全 A 上涨 1.05%，创成长上涨 5.88%，上 50 上涨 1.48%。

11 月份美国选举的初步尘埃落定，同时辉瑞等公司疫苗的三期数据显示出了很好的有效性。市场开始交易疫苗接种后的的复苏过程。市场价值方向明显占优，呈现全球复苏交易状态，有色 21.84%、煤炭 16.12%、石油石化 14.95%、钢铁 11.85%涨幅明显。各主要指数中，上证综指上涨 5.19%，创业板综指下跌 2.10%，Wind 全 A 上涨 3.98%，创成长下跌 0.87%，上 50 上涨 5.76%。医药由于高值耗材集采的大幅降价，系统性拖累了整个医药行业的表现，本月医药指数下跌 7.22%，对组合造成了很大拖累。

12 月份随着市场主流机构内部考核完毕，市场主要交易力量开始对 2021 年做布局，长期逻辑更顺畅的方向和景气度高企的方向更容易得到资金的追捧。电新、军工、白酒得到了市场的强追捧，特别是在 11 月份因为风格切换为价值出现了迅猛的调整后。

2020 年全年，上证综指上涨 13.87%、创业板综指上涨 47.85%、中证 800 上涨 25.79%，Wind 全 A 上涨 25.62%，宽基指数中表现最好的是创成长涨幅 97.14%。

从行业来看，电力设备和新能源（88.34%）、食品饮料（88.06）、社服（81.06%）、军工（72.47%）和医药（50.40%）涨幅居前；综合金融（-18.11%）、地产（-9.49%）、通信（-8.72%）、建筑（-6.78%）和综合（-5.46%）上半年表现较弱。

行业上下半年表现差异较大，上半年医药独强（41.54%），下半年复苏交易态势明显，超额行业主要是电力设备和新能源（62.12%）、军工（57.46%）、食品饮料（51.79%）、社服（50.53%）、汽车（48.10%）和有色（42%）。

报告期本基金整体保持了较为灵活的操作思路，1、2 月份在消费、医药和社服的基本结构外，大幅加仓了以新能源车、消费电子、半导体、通信、信创等为代表的科技方向，并在 2 月底市场遭遇外部冲击时，及时将仓位重新调整回医药、消费的主结构中，有效把握了市场之后的反弹。下半年组合大幅减仓了医药，大幅加仓了白酒和新能源（光伏和电动车），有效匹配了市场节奏。

2020 年中邮核心主题收益率 82.86%，基准上涨 22.62%，超过基准 48.58%，取得了较好的回报。

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 3.083 元，累计净值为 3.243 元；本报告期基金份额净值增长率为 82.86%，业绩比较基准收益率为 22.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年市场将面临更大的调整，在经历了疫情后的大宽松，21 年流动性环境的边际收紧对组合的配置和操作提出了更高的挑战。

具体来看，信用收缩+名义经济增长向上组合，将对国内股市流动性构成双重压制；海外政策

退出带来的跨境资本流出是另一需要警惕的风险；此外群体免疫的实现一则会带动大宗商品；二则会加快内外政策退出，在三个变量传递机制下都对应流动性收缩风险。

我们对全年回报率相对谨慎，在经历了 19/20 年两年的投资大年后，21 年的收益率可能会相对平淡。但从中观和微观结构上，我们可以看到产业层面，光伏和电动车的进程如火如荼；自主可控、“卡脖子”的材料和设备领域的攻关砥砺前行。

本产品将立足于“追求平稳、可控的较好回报”，以泛消费领域（医药、食品饮料、社服、教育等）为基础结构，通过动态选择高胜率的景气领域实现有效增强，为投资人创造较好的回报。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人致力于建立和健全公司内部控制制度，努力防范和化解公司各项经营管理活动中的风险，促进公司诚信、合法、有效经营，切实保障基金份额持有人的利益。

公司建立了督察长制度，督察长全权负责公司的监察与稽核工作，对基金运作的合法合规性进行全面检查与监督，遇有重大风险事件立即向公司董事长和中国证监会报告。公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，由督察长直接领导。监察稽核部按照规定的权限和程序，通过日常实时监控、现场专项检查、定期监察稽核评估等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向公司董事和管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人主要内部监察稽核工作如下：

1．制度建设不断完善

基金管理人进一步健全公司内控体系，保持了良好的内控环境、完善了内部控制的三道防线，并根据公司实际业务情况细化了岗位风险控制。在制订部门规章制度和业务流程时，将内控要求融入到各业务规范当中。同时根据公司业务的发展及监管部门法律法规的更新， 对公司和部门制度进行持续的完善、修订及补充。对公司《反洗钱内控制度》进行了修改和完善，制定了《重大可疑交易的报告操作规程》、《涉嫌恐怖融资的可疑交易的报告操作规程》、《协助人民银行行政调查的操作规程》、《反洗钱工作保密的操作规程》及《人工识别可疑交易操作规程》；制定了《投资管理人员后续职业培训管理办法》、《员工教育培训管理办法》，修改并完善了《公司财务制度》、《人力资源部管理制度》、《绩效考评评估管理办法》等，进一步完善了公司的制度体系。

2．日常监察稽核工作

为规范基金投资运作、防范风险、更好的保护基金份额持有人的利益，对基金投资运作进行日常的监察工作，保障研究、投资决策、交易执行等环节严格执行法律法规及基金合同的有关规定。在日常实时电脑监控中，对基金投资及相关业务进行事中的风险控制，保障公司管理的基金

规范运作。此外对信息技术、基金的注册登记、基金会计、信息披露等业务进行例行检查。

3．专项监察稽核工作

根据监管部门的要求及公司业务开展情况，对相关业务部门进行专项监察稽核。报告期内，对公司的公司研究业务、投资、交易业务、信息技术部、人力资源部、公共事务部、营销部、直销柜台、清算部等进行了专项稽核，通过检查发现内部控制薄弱点，及时提出了整改意见及建议。

4．定期监察稽核及内控检查评估工作

每季度对公司及基金运作的合法合规性及内部控制情况进行检查，对公司各项业务的制度建设、制度执行、风险控制等情况进行评估，发现内控的薄弱环节，并提出相应改进措施，促进公司内部控制和风险管理水平的加强和提高。

在本报告期内，本基金管理人运用基金财产进行投资严格按照招募说明书所披露的投资决策程序进行，无不当内幕交易和关联交易。没有发生重大违法违规行为。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持内部控制优先原则，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 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。

4.8 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，未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

否。

4.10 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

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§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

托管人声明:

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字（2021）第 110A002288 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中邮核心主题混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中邮核心主题混合型证券投资基金(以下简称中邮核心主题基金）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表、所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定编制，公允反映了中邮核心主题基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中邮核心主题基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	中邮核心主题基金的基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中邮核心主题基金 2020 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、

	执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中邮核心主题基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中邮核心主题基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中邮核心主题基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据所获取的审计证据，就可能导致对中邮核心主题基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截

	至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中邮核心主题基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	致同会计师事务所 （特殊普通合伙人）	
注册会计师的姓名	卫俏嫔	张丽雯
会计师事务所的地址	中国•北京　朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 10 日	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中邮核心主题混合型证券投资基金

报告截止日： 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	67,027,207.62	109,239,074.08
结算备付金		1,789,547.70	2,496,167.52
存出保证金		655,613.41	796,872.28
交易性金融资产	7.4.7.2	820,529,084.65	792,155,126.07
其中：股票投资		820,529,084.65	792,155,126.07
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,923,233.25	-
应收利息	7.4.7.5	25,539.67	44,386.07
应收股利		-	-
应收申购款		258,281.06	278,576.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		896,208,507.36	905,010,202.65
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2020 年 12 月 31 日**	**上年度末 2019 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		11,763,402.92	5,455,938.81
应付赎回款		3,953,678.86	662,586.17
应付管理人报酬		1,095,127.78	1,136,965.32
应付托管费		182,521.29	189,494.21
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,687,995.03	1,644,880.63
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	623,972.92	720,344.99
负债合计		19,306,698.80	9,810,210.13
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	284,386,007.83	531,092,386.51
未分配利润	7.4.7.10	592,515,800.73	364,107,606.01
所有者权益合计		876,901,808.56	895,199,992.52
负债和所有者权益总计		896,208,507.36	905,010,202.65

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.083 元，基金份额总额 284,386,007.83 份。

7.2 利润表

会计主体：中邮核心主题混合型证券投资基金

本报告期： 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		599,084,030.84	324,879,570.53
1.利息收入		1,392,506.08	1,965,767.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,392,506.08	1,965,767.53
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		494,489,942.26	203,271,292.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	491,140,203.22	196,008,827.25
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	3,349,739.04	7,262,465.63
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	102,909,464.95	119,552,512.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	292,117.55	89,997.15
减：二、费用		34,473,797.62	28,976,342.47
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,817,641.78	13,124,011.08
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,302,940.38	2,187,335.21
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-

4．交易费用	7.4.7.19	18,079,454.54	13,399,668.22
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	7.4.7.20	273,760.92	265,327.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		564,610,233.22	295,903,228.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		564,610,233.22	295,903,228.06

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮核心主题混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	531,092,386.51	364,107,606.01	895,199,992.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	564,610,233.22	564,610,233.22
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）	-246,706,378.68	-336,202,038.50	-582,908,417.18
其中：1.基金申购款	74,963,597.71	107,496,683.52	182,460,281.23
2.基金赎回款	-321,669,976.39	-443,698,722.02	-765,368,698.41
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）	284,386,007.83	592,515,800.73	876,901,808.56
项目	**上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	621,945,728.56	120,117,114.70	742,062,843.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	295,903,228.06	295,903,228.06
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）	-90,853,342.05	-51,912,736.75	-142,766,078.80
其中：1.基金申购款	50,267,120.17	24,609,362.99	74,876,483.16
2.基金赎回款	-141,120,462.22	-76,522,099.74	-217,642,561.96
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）	531,092,386.51	364,107,606.01	895,199,992.52

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

孔军	孔军	佟姗
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中邮核心主题混合型证券投资基金（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[2010] 319 号《关于核准中邮核心主题股票型证券投资基金募集的批复》核准，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《中邮核心主题股票型证券投资基金基金合同》发起，并于 2010 年 5 月 19 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 2,233,879,213.39 元，业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字（2010）第 057 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮核心主题股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，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（包括创业板）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当

程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券资产占基金资产的比例为 0%~40%，权证的投资比例为基金资产净值的 0%~3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于核心主题企业的股票比例不低于基金股票资产的 80%。

根据中邮创业基金管理股份有限公司 2015 年 8 月 7 日发布的《中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金更名的公告》，本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型证券投资基金，基金代码保持不变，更名前基金全称为“中邮核心主题股票型证券投资基金”，更名后基金全称为“中邮核心主题混合型证券投资基金”。

7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《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。

7.4.3 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，真实完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年度，即从每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

（1）金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款、应收款项。除与权证投资有关的金融资产外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示；与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的各类应收款项等在活跃市场没有报价、回收金额固定或可以确定的非衍生金融资产分类为贷款与应收款项。

（2）金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示，与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金目前持有的金融负债全部为其他金融负债，包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（1）股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。股票投资收益按卖出股票成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出股票的公允价值变动损益转入股票投资收益，卖出股票应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

股票持有期间分派的股票股利，应于除权除息日根据上市公司股东大会决议公告，按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量，在本账户“数量”栏进行记录。因持有股票而享有的配股权，配股除权日在配股缴款截止日之后的，在除权日按所配的股数确认未流通部分的股票投资，与已流通部分分别核算。配股除权日在配股缴款截止日之前的，按照权证的有关原则进行核算。

股票投资应分派的现金股利，在除息日确认为股利收入。

估值日对持有的股票估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

（2）债券投资

买入债券于交易日确认债券投资；债券投资按交易日债券的公允价值（不含支付价款中所包含的应收利息）入账，应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金

交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行资金交收。

持有债券期间，每日确认利息收入，计入应收利息和利息收入科目。

债券派息日，按应收利息金额，与证券登记结算机构进行资金交收。

估值日对持有的债券估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

卖出债券应于交易日确认债券投资收益。债券投资收益按卖出债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该卖出债券的公允价值变动损益转入债券投资收益，卖出债券应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

到期收回债券本金和利息，债券投资收益按收回债券应收取的全部价款与其成本、应收利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该收回债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

可转换债券转股时，按可转换股票的公允价值计入股票投资科目，按应收取的现金余额返还扣除可转换股票的公允价值后的余额，与可转换债券成本、应收利息和估值增值或减值的差额计入债券投资收益，同时，将原计入该转换债券的公允值变动损益转入债券投资收益。

（3）权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日权证的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

获赠权证（包括配股权证）在除权日应按持有的股数及获赠比例，计算确定增加的权证数量，在本账户“数量”栏进行记录。

卖出权证于交易日确认衍生工具收益。衍生工具收益按卖出权证成交总额与其成本和估值增值或减值的差额入账，同时将原计入该卖出权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

权证行权按结算方式分为证券结算方式和现金结算方式，具体核算如下：

A、证券结算方式

认购权证以证券结算方式行权时，按股票的公允价值确认股票投资成本，按股票公允价值与权证成本、估值增值或减值、行权价款及相关费用的差额确认衍生工具收益，同时将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

认沽权证以证券结算方式行权时，按认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）确认衍生工具收益，按行权价款扣除费用后的余额与权证投资成本、估值增值或减值、结转的股票投资成本、估值增值或减值、认沽权证的理论价值与账面价值之差（若有）的差额确认股票投资收益，同时，将原计入卖出股票和原计入权证的公允价值变动损益转入股票投资收益和衍生工具收益。

B、现金结算方式

权证以现金结算方式行权时，按确定的金额扣减交易费用后的余额与结转的权证成本、估值增值或减值的差额确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

放弃行权，在放弃行权确定日，按结转的权证成本、估值增值或减值，确认衍生工具收益，同时，将原计入该权证的公允价值变动损益转入衍生工具收益。

（4）资产支持证券

取得资产支持证券时，按公允价值入账；取得资产支持证券支付的款项时，区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分，将收到的本金部分冲减成本，将收到的收益部分冲减应计利息（若有）后的差额，记入资产支持证券利息收入，其他与资产支持证券投资相关业务的账务处理比照债券投资。

（5）买入返售金融资产和卖出回购金融资产

根据返售协议，按照应付和实际支付的金额确认入账；返售前，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；返售日，按照应收或实际收到的金额与账面余额和应收利息的差额，计算确认利息收入。

根据回购协议，按照应收和实际收到的金额确认入账；融资期限内，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；到期回购时，按照应付或实际支付的金额与账面余额和应付利息的差额，计算确认利息支出。

（6）其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值原则遵循《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13 号）及《中国基金估值标准 2018》中的相关法规，具体估值方法如下：

（1）股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件，应采用最近交易市价确定公允价值；有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估

值日的基金资产净值的影响在 0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售的股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，参考《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发〔2017〕6 号）进行估值。

（2）债券投资

本基金在对银行间和交易所市场的固定收益品种估值时，主要依据由第三方估值机构提供的价格数据。第三方估值机构包括中央国债登记结算公司（以下简称“中央结算公司”）和中证指数有限公司。第三方估值机构根据以下原则确定估值品种公允价值：对于存在活跃市场的情况下，以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于活跃市场报价未能代表计量日公允价值的情况下，对市场报价进行调整以确认计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的情况下，采用估值技术确定其公允价值。

未上市流通的债券在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量。

（3）权证投资

上市权证按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，但最近交易日后经济环境未发生重大变化的，应采用最近交易市价确定公允价值。估值日无市价，且最近交易日后经济环境发生了重大变化的，应参考类似投资品种的现行市价及重大变化因素，调整最近交易市价，确定公允价值。有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；首次发行未上市的权证，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本计量；因持有股票而享有的配股权，以及停止交易、但未行权的权证，采用估值技术确定公允价值。

（4）其他投资品种

交易所以大宗交易方式转让的资产支持证券，采用估值技术确定公允价值，在估值技术难以可靠计量公允价值的情况下，按成本进行后续计量；

资产支持证券等固定收益品种采用估值技术确定公允价值。

（5）估值不能客观反映其公允价值的处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

（6）实际投资成本与估值的差异处理

实际投资成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示不得相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

本基金单位总额不固定，基金单位总数随时增减。基金合同生效时，实收基金按实际收到的基金单位发行总额入账；基金合同生效后，实收基金应于基金申购、赎回确认日根据基金契约和招募说明书中载明的有关事项进行确认和计量。

7.4.4.8 损益平准金

基金管理公司于收到基金投资人申购或转换申请之日起在规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，计算有效申购或转换款中含有的实收基金部分，确认并增加实收基金，按基金申购或转换款与实收基金的差额，确认并增加损益平准金。

基金管理公司于收到基金投资人赎回或转换申请之日起在规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，对基金赎回款或转换转出款中含有的实收基金，确认并减少实收基金，按基金赎回款或转换转出款与实收基金的差额，确认并减少损益平准金。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

（1）股票投资收益

于卖出股票交易日确认，按卖出股票成交总额与其成本的差额入账。

（2）债券投资收益

于卖出债券交易日确认，按应收取的全部价款与其成本、应收利息的差额入账。

（3）股利收入

于除息日确认，按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

（4）债券利息收入

在债券实际持有期内逐日计提，按摊余成本和实际利率计算确定的金额入账。

（5）存款利息收入

逐日计提，按本金与适用的利率计提的金额入账。

（6）买入返售证券收入

在证券持有期内采用实际利率逐日计提，按计提的金额入账。

（7）公允价值变动损益

于估值日，对采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的损益进行确认；卖出股票、债券、权证等资产时，将原计入该卖出资产的公允价值变动损益转入股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益等科目。

7.4.4.10 费用的确认和计量

（1）基金管理人报酬

按前一日基金资产净值 1.50%的年费率逐日计提。

（2）基金托管费

按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

（3）交易费用

对股票、债券、资产支持证券、基金、权证等交易过程中发生的，可直接归属于取得或处置某项基金资产或承担某项基金负债的新增外部成本，包括支付给交易代理机构的规费、佣金、代征的税金及其他必要的可以正确估算的支出，在资产交易日确认各项交易费用。

（4）利息支出

对银行借款利息支出、交易性金融负债利息支出和卖出回购金融资产支出，在借款期或融资期内按实际利率逐日计提并确认入账。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权；基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；基金收益分配每年不超过 12 次；每次基金收益分配比例不低于期末可供分配利润的 50%，收益分配比例以期末可供分配利润为基准计算，基金期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按除息日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资人不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；若《基金合同》生效未满 3 个月可以不进行收益分配；法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

7.4.6 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[2012]85 号《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[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；对个人持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	67,027,207.62	109,239,074.08
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：	67,027,207.62	109,239,074.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	637,420,103.55	820,529,084.65	183,108,981.10

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		637,420,103.55	820,529,084.65	183,108,981.10
项目		上年度末 2019 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		711,955,609.92	792,155,126.07	80,199,516.15
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		711,955,609.92	792,155,126.07	80,199,516.15

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有买断式逆回购金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	24,329.00	42,755.98
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	885.83	1,235.63
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	0.34	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	324.50	394.46
合计	25,539.67	44,386.07

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	1,687,995.03	1,644,880.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,687,995.03	1,644,880.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,972.92	344.99
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	620,000.00	720,000.00
合计	623,972.92	720,344.99

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	531,092,386.51	531,092,386.51
本期申购	74,963,597.71	74,963,597.71

本期赎回（以“-”号填列）	-321,669,976.39	-321,669,976.39
- 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	284,386,007.83	284,386,007.83

7.4.7.10 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	300,043,534.23	64,064,071.78	364,107,606.01
本期利润	461,700,768.27	102,909,464.95	564,610,233.22
本期基金份额交易产生的变动数	-262,338,215.54	-73,863,822.96	-336,202,038.50
其中：基金申购款	83,549,725.16	23,946,958.36	107,496,683.52
基金赎回款	-345,887,940.70	-97,810,781.32	-443,698,722.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	499,406,086.96	93,109,713.77	592,515,800.73

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,310,923.42	1,896,066.34
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	68,534.09	57,534.52
其他	13,048.57	12,166.67
合计	1,392,506.08	1,965,767.53

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,109,654,318.75	4,412,006,409.00
减：卖出股票成本总额	5,618,514,115.53	4,215,997,581.75
买卖股票差价收入	491,140,203.22	196,008,827.25

7.4.7.13 债券投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无债券投资。

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间本基金无衍生工具投资。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,349,739.04	7,262,465.63
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,349,739.04	7,262,465.63

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	102,909,464.95	119,552,512.97
——股票投资	102,909,464.95	119,552,512.97
——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	102,909,464.95	119,552,512.97

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	291,931.99	89,997.15
其他	185.56	-
合计	292,117.55	89,997.15

注：本基金赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，不低于赎回费总额的 25%应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	18,079,454.54	13,399,668.22
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	18,079,454.54	13,399,668.22

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行结算费	34,560.92	26,127.96
上清所债券账户维护费	18,000.00	18,600.00
其他	1,200.00	600.00
合计	273,760.92	265,327.96

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

本报告期内，本基金不存在或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2021 年 3 月 10 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国邮政集团有限公司	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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付	13,817,641.78	13,124,011.08

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	5,382,374.12	4,929,603.05

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算公式为：日基金管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.50% / 当年天数

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,302,940.38	2,187,335.21

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金合同生效日（ 2010 年 5 月 19 日 ）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	981,216.06	981,216.06
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	981,216.06	-
报告期末持有的基金份额	-	981,216.06
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.1800%

7.4.10.5.2 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

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。

7.4.10.6 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	67,027,207.62	1,310,923.42	109,239,074.08	1,896,066.34

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末（ 2020 年 12 月 31 日 ）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688617	惠泰医疗	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 1 月 7 日	新股流通受限	13.39	13.39	2,163	28,962.57	28,962.57	-
605277	新亚电子	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
003030	祖名股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 6 日	新股流通受限	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股流通受限	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
601995	中金公司	2020 年 10 月 22 日	2021 年 5 月 6 日	新股流通受限	28.78	68.71	24,951	718,089.78	1,714,383.21	-
688289	圣湘生物	2020 年 8 月 20 日	2021 年 3 月 1 日	新股流通受限	50.48	109.84	6,806	343,566.88	747,571.04	-
300999	金龙鱼	2020 年 9 月 29 日	2021 年 4 月 15	新股流通受限	25.70	88.29	4,089	105,087.30	361,017.81	-

			日							
688330	宏力达	2020 年 9 月 28 日	2021 年 4 月 15 日	新股流通受限	88.23	75.87	3,573	315,245.79	271,083.51	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股流通受限	118.27	603.36	317	37,491.59	191,265.12	-
688219	会通股份	2020 年 11 月 6 日	2021 年 5 月 18 日	新股流通受限	8.29	13.70	7,336	60,815.44	100,503.20	-
300869	康泰医学	2020 年 8 月 12 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	10.16	110.88	862	8,757.92	95,578.56	-
688560	明冠新材	2020 年 12 月 16 日	2021 年 6 月 24 日	新股流通受限	15.87	22.86	3,832	60,813.84	87,599.52	-
688571	杭华股份	2020 年 12 月 2 日	2021 年 6 月 11 日	新股流通受限	5.33	7.92	8,200	43,706.00	64,944.00	-
300860	锋尚文化	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020 年 8 月 6 日	2021 年 2 月 24 日	新股流通受限	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股流通受限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300872	天阳科技	2020 年 8 月 14 日	2021 年 2 月 25 日	新股流通受限	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64	-
300870	欧陆通	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 24	新股流通受限	36.81	65.67	478	17,595.18	31,390.26	-

			日							
300894	火星人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 7 月 1 日	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300910	瑞丰新材	2020 年 11 月 20 日	2021 年 5 月 27 日	新股流通受限	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300891	惠云钛业	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股流通受限	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020 年 11 月 13 日	2021 年 5 月 24 日	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300884	狄耐克	2020 年 11 月 5 日	2021 年 5 月 12 日	新股流通受限	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 3 月 24 日	新股流通受限	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股流通受限	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300887	谱尼测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300913	兆龙互连	2020 年 11 月 27 日	2021 年 6 月 7 日	新股流通受限	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300864	南大环境	2020 年 8 月 13 日	2021 年 2 月 25	新股流通受限	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-

			日							
300889	爱克股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 17 日	新股流通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300902	国安达	2020 年 10 月 22 日	2021 年 4 月 29 日	新股流通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	-
300925	法本信息	2020 年 12 月 21 日	2021 年 6 月 30 日	新股流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300879	大叶股份	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 1 日	新股流通受限	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020 年 8 月 27 日	2021 年 3 月 10 日	新股流通受限	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300893	松原股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300918	南山智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新股流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020 年 8 月 25 日	2021 年 3 月 5	新股流通受限	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-

			日							
300922	天秦装备	2020 年 12 月 18 日	2021 年 6 月 25 日	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300886	华业香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股流通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-

注：①圣湘生物（688289）于 2020 年 12 月 03 日实施分红：A 股每股现金红利 0.75 元（含税）。

②博俊科技（300926）期末限售 3,584 股，其中 359 股限售期限为自上市交易之日起 6 个月，可流通日为 2021 年 7 月 7 日。

③江天化学（300927）期末限售 2,163 股，其中 217 股限售期限为自上市交易之日起 6 个月，可流通日为 2021 年 7 月 7 日。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金在报告期内的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阀值进行持续监测。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	67,027,207.62	-	-	-	67,027,207.62
结算备付金	1,789,547.70	-	-	-	1,789,547.70
存出保证金	655,613.41	-	-	-	655,613.41
交易性金融资产	-	-	-	820,529,084.65	820,529,084.65
应收证券清算款	-	-	-	5,923,233.25	5,923,233.25
应收利息	-	-	-	25,539.67	25,539.67
应收申购款	-	-	-	258,281.06	258,281.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	69,472,368.73	-	-	826,736,138.63	896,208,507.36
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,763,402.92	11,763,402.92
应付赎回款	-	-	-	3,953,678.86	3,953,678.86

应付管理人报酬	-	-	-	1,095,127.78	1,095,127.78
应付托管费	-	-	-	182,521.29	182,521.29
应付交易费用	-	-	-	1,687,995.03	1,687,995.03
其他负债	-	-	-	623,972.92	623,972.92
负债总计	-	-	-	19,306,698.80	19,306,698.80
利率敏感度缺口	69,472,368.73	-	-	807,429,439.83	876,901,808.56
上年度末 2019 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	109,239,074.08	-	-	-	109,239,074.08
结算备付金	2,496,167.52	-	-	-	2,496,167.52
存出保证金	796,872.28	-	-	-	796,872.28
交易性金融资产	-	-	-	792,155,126.07	792,155,126.07
应收利息	-	-	-	44,386.07	44,386.07
应收申购款	-	-	-	278,576.63	278,576.63
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	112,532,113.88	-	-	792,478,088.77	905,010,202.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	5,455,938.81	5,455,938.81
应付赎回款	-	-	-	662,586.17	662,586.17
应付管理人报酬	-	-	-	1,136,965.32	1,136,965.32
应付托管费	-	-	-	189,494.21	189,494.21
应付交易费用	-	-	-	1,644,880.63	1,644,880.63
其他负债	-	-	-	720,344.99	720,344.99
负债总计	-	-	-	9,810,210.13	9,810,210.13
利率敏感度缺口	112,532,113.88	-	-	782,667,878.64	895,199,992.52

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险

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（包括创业板）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 60%~95%，债券资产占基金资产的 0%~40%，权证占基金资产净值的 0%~3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于核心主题企业的股票比例不低于基金股票资产的 80%。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

7.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	820,529,084.65	93.57	792,155,126.07	88.49
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	820,529,084.65	93.57	792,155,126.07	88.49

7.4.13.4.2.2 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（ 2020 年 12 月 31 日 ）	上年度末（ 2019 年 12 月 31 日 ）
	1.基金净资产变动	9,242,866.54	8,716,701.85
	2.基金净资产变动	-9,242,866.54	-8,716,701.85

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，利用 2020 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 1.13。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 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	820,529,084.65	91.56
	其中：股票	820,529,084.65	91.56
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	68,816,755.32	7.68
8	其他各项资产	6,862,667.39	0.77
9	合计	896,208,507.36	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。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	723,724,199.74	82.53
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	16,322.72	0.00
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	5,329,072.27	0.61
J	金融业	1,714,383.21	0.20
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	51,612,449.20	5.89
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,215,600.00	0.48
Q	卫生和社会工作	33,844,740.00	3.86
R	文化、体育和娱乐业	48,261.27	0.01
S	综合	-	-
	合计	820,529,084.65	93.57

注：由于四舍五入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。

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未投资港股通股票。

8.3 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	000858	五粮液	300,000	87,555,000.00	9.98
2	300122	智飞生物	320,065	47,340,814.15	5.40
3	000568	泸州老窖	195,000	44,101,200.00	5.03
4	002304	洋河股份	160,000	37,758,400.00	4.31
5	300274	阳光电源	500,000	36,140,000.00	4.12
6	600519	贵州茅台	18,000	35,964,000.00	4.10
7	000661	长春高新	80,000	35,912,800.00	4.10
8	603806	福斯特	420,000	35,868,000.00	4.09
9	603259	药明康德	240,000	32,332,800.00	3.69
10	300760	迈瑞医疗	75,000	31,950,000.00	3.64
11	600809	山西汾酒	75,000	28,146,750.00	3.21
12	002460	赣锋锂业	260,000	26,312,000.00	3.00
13	601012	隆基股份	240,000	22,128,000.00	2.52
14	600660	福耀玻璃	450,000	21,622,500.00	2.47
15	300750	宁德时代	60,067	21,090,124.37	2.41
16	300450	先导智能	250,000	20,997,500.00	2.39
17	688408	中信博	120,000	20,491,200.00	2.34
18	300759	康龙化成	160,000	19,264,000.00	2.20
19	000799	酒鬼酒	120,000	18,780,000.00	2.14
20	300601	康泰生物	100,000	17,450,000.00	1.99
21	600438	通威股份	450,000	17,298,000.00	1.97
22	688567	孚能科技	375,000	17,156,250.00	1.96
23	300347	泰格医药	75,000	12,120,750.00	1.38

24	600763	通策医疗	42,000	11,613,840.00	1.32
25	300357	我武生物	150,000	11,505,000.00	1.31
26	002821	凯莱英	35,000	10,469,900.00	1.19
27	300896	爱美客	16,000	10,463,943.78	1.19
28	300015	爱尔眼科	135,000	10,110,150.00	1.15
29	300595	欧普康视	120,000	9,830,400.00	1.12
30	601633	长城汽车	250,000	9,452,500.00	1.08
31	300751	迈为股份	13,500	9,139,635.00	1.04
32	300014	亿纬锂能	110,075	8,971,112.50	1.02
33	603456	九洲药业	250,000	8,950,000.00	1.02
34	300724	捷佳伟创	60,000	8,736,000.00	1.00
35	300271	华宇软件	220,000	5,251,400.00	0.60
36	603755	日辰股份	60,000	4,687,800.00	0.53
37	688363	华熙生物	32,000	4,685,760.00	0.53
38	002607	中公教育	120,000	4,215,600.00	0.48
39	601995	中金公司	24,951	1,714,383.21	0.20
40	688289	圣湘生物	6,806	747,571.04	0.09
41	300999	金龙鱼	4,089	361,017.81	0.04
42	688157	松井股份	3,402	282,366.00	0.03
43	688330	宏力达	3,573	271,083.51	0.03
44	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
45	688219	会通股份	7,336	100,503.20	0.01
46	300920	润阳科技	2,503	97,316.64	0.01
47	300869	康泰医学	862	95,578.56	0.01
48	688560	明冠新材	3,832	87,599.52	0.01
49	688571	杭华股份	8,200	64,944.00	0.01
50	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.01
51	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.01
52	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
53	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
54	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
55	300870	欧陆通	478	31,390.26	0.00
56	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
57	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
58	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
59	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
60	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
61	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
62	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00

63	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
64	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
65	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
66	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
67	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
68	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
69	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
70	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
71	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
72	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
73	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
74	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
75	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
76	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
77	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
78	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
79	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
80	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
81	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
82	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
83	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
84	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
85	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
86	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
87	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
88	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
89	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600519	贵州茅台	149,162,547.82	16.66
2	000858	五粮液	140,476,269.66	15.69
3	000568	泸州老窖	117,242,452.68	13.10
4	603369	今世缘	113,390,135.30	12.67

5	000661	长春高新	94,339,704.81	10.54
6	002475	立讯精密	92,795,175.25	10.37
7	000063	中兴通讯	85,905,190.78	9.60
8	002600	领益智造	85,606,852.35	9.56
9	002460	赣锋锂业	79,104,973.42	8.84
10	300144	宋城演艺	75,516,666.59	8.44
11	300142	沃森生物	71,869,795.55	8.03
12	002241	歌尔股份	71,259,364.64	7.96
13	002078	太阳纸业	68,659,229.03	7.67
14	300750	宁德时代	66,986,779.37	7.48
15	600882	妙可蓝多	63,168,687.96	7.06
16	300122	智飞生物	61,933,259.22	6.92
17	601318	中国平安	61,176,665.43	6.83
18	688363	华熙生物	59,575,175.38	6.65
19	002916	深南电路	59,149,946.01	6.61
20	002607	中公教育	58,745,516.90	6.56
21	002304	洋河股份	58,516,258.07	6.54
22	601888	中国中免	58,111,474.57	6.49
23	002007	华兰生物	56,321,860.14	6.29
24	688139	海尔生物	52,811,237.10	5.90
25	300832	新产业	49,311,250.08	5.51
26	300601	康泰生物	49,255,077.60	5.50
27	300529	健帆生物	48,448,784.87	5.41
28	603233	大参林	47,376,797.32	5.29
29	600809	山西汾酒	46,170,318.63	5.16
30	688111	金山办公	44,707,532.14	4.99
31	603456	九洲药业	44,617,238.00	4.98
32	603882	金域医学	44,615,040.59	4.98
33	603806	福斯特	44,493,237.17	4.97
34	603259	药明康德	44,219,798.06	4.94
35	002371	北方华创	43,354,740.51	4.84
36	300760	迈瑞医疗	43,061,150.86	4.81
37	300006	莱美药业	42,288,170.81	4.72
38	600048	保利地产	40,964,197.00	4.58
39	300598	诚迈科技	38,535,510.40	4.30
40	002821	凯莱英	38,337,639.00	4.28

41	601012	隆基股份	38,260,208.00	4.27
42	000333	美的集团	37,670,036.80	4.21
43	000799	酒鬼酒	35,760,940.00	3.99
44	603986	兆易创新	35,730,996.00	3.99
45	300059	东方财富	34,286,470.18	3.83
46	300502	新易盛	34,085,369.54	3.81
47	688018	乐鑫科技	33,763,180.11	3.77
48	300567	精测电子	33,466,545.42	3.74
49	300659	中孚信息	32,939,291.90	3.68
50	600183	生益科技	32,068,725.32	3.58
51	002311	海大集团	31,585,146.00	3.53
52	300573	兴齐眼药	31,470,040.00	3.52
53	002194	武汉凡谷	31,075,698.08	3.47
54	688266	泽璟制药	30,990,492.25	3.46
55	688016	心脉医疗	30,262,732.24	3.38
56	300604	长川科技	29,968,519.93	3.35
57	688158	优刻得	29,903,570.83	3.34
58	300326	凯利泰	29,340,850.47	3.28
59	300010	豆神教育	29,330,789.00	3.28
60	300253	卫宁健康	29,288,550.93	3.27
61	300841	康华生物	29,189,829.00	3.26
62	603019	中科曙光	28,947,410.83	3.23
63	000671	阳光城	28,765,601.78	3.21
64	600161	天坛生物	28,464,973.90	3.18
65	300653	正海生物	28,031,446.62	3.13
66	000651	格力电器	27,967,526.33	3.12
67	002271	东方雨虹	27,915,944.74	3.12
68	688202	美迪西	27,478,215.92	3.07
69	300482	万孚生物	27,104,702.64	3.03
70	688008	澜起科技	26,870,585.77	3.00
71	603707	健友股份	26,775,405.60	2.99
72	300357	我武生物	26,230,275.27	2.93
73	002901	大博医疗	25,893,514.46	2.89
74	000860	顺鑫农业	25,633,698.75	2.86
75	300033	同花顺	25,502,232.40	2.85
76	688408	中信博	25,188,047.25	2.81

77	300015	爱尔眼科	25,010,908.94	2.79
78	600763	通策医疗	24,871,325.39	2.78
79	000895	双汇发展	24,711,438.64	2.76
80	300274	阳光电源	24,698,371.40	2.76
81	600276	恒瑞医药	24,470,782.54	2.73
82	603345	安井食品	24,038,917.00	2.69
83	603288	海天味业	23,973,598.52	2.68
84	300782	卓胜微	23,833,513.00	2.66
85	603180	金牌厨柜	23,737,090.03	2.65
86	002853	皮阿诺	23,633,204.50	2.64
87	603883	老百姓	23,568,593.00	2.63
88	002035	华帝股份	23,421,692.08	2.62
89	688036	传音控股	23,257,416.98	2.60
90	688058	宝兰德	22,165,140.74	2.48
91	002624	完美世界	22,043,644.00	2.46
92	688366	昊海生科	21,793,089.43	2.43
93	600438	通威股份	21,551,835.62	2.41
94	300347	泰格医药	21,179,687.95	2.37
95	688169	石头科技	21,142,144.88	2.36
96	300132	青松股份	21,015,336.51	2.35
97	002124	天邦股份	20,121,816.00	2.25
98	002157	正邦科技	20,079,801.00	2.24
99	300740	御家汇	20,001,068.40	2.23
100	002557	洽洽食品	19,918,417.00	2.23
101	603010	万盛股份	19,825,740.96	2.21
102	300450	先导智能	19,326,197.00	2.16
103	600867	通化东宝	19,320,208.72	2.16
104	600305	恒顺醋业	19,287,594.76	2.15
105	002100	天康生物	19,212,148.53	2.15
106	300017	网宿科技	19,059,098.00	2.13
107	600110	诺德股份	18,736,668.46	2.09
108	600660	福耀玻璃	18,544,172.40	2.07
109	002555	三七互娱	18,500,882.00	2.07
110	300595	欧普康视	18,289,787.64	2.04
111	002456	欧菲光	18,027,131.00	2.01
112	300919	中伟股份	17,904,265.80	2.00

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	162,186,672.32	18.12
2	002475	立讯精密	140,354,727.93	15.68
3	000661	长春高新	132,548,985.11	14.81
4	002241	歌尔股份	125,307,125.30	14.00
5	000858	五粮液	122,524,742.06	13.69
6	603369	今世缘	114,771,520.59	12.82
7	002607	中公教育	109,608,836.03	12.24
8	300122	智飞生物	106,254,193.27	11.87
9	300601	康泰生物	105,427,303.06	11.78
10	000568	泸州老窖	97,014,918.60	10.84
11	300750	宁德时代	92,895,924.26	10.38
12	300010	豆神教育	86,531,642.58	9.67
13	000063	中兴通讯	86,211,382.38	9.63
14	603259	药明康德	83,569,580.90	9.34
15	002460	赣锋锂业	83,085,118.60	9.28
16	002600	领益智造	81,956,637.63	9.16
17	300144	宋城演艺	77,361,483.52	8.64
18	300142	沃森生物	76,548,937.30	8.55
19	002821	凯莱英	70,954,635.44	7.93
20	002078	太阳纸业	70,924,081.36	7.92
21	300760	迈瑞医疗	69,637,783.92	7.78
22	300595	欧普康视	68,985,407.93	7.71
23	300347	泰格医药	67,637,965.48	7.56
24	002916	深南电路	66,471,408.85	7.43
25	600882	妙可蓝多	65,874,125.68	7.36
26	688363	华熙生物	63,114,451.93	7.05
27	002007	华兰生物	62,890,654.85	7.03
28	601318	中国平安	59,831,956.45	6.68
29	601888	中国中免	57,491,844.73	6.42
30	688139	海尔生物	53,300,901.99	5.95
31	600276	恒瑞医药	52,364,635.40	5.85
32	300529	健帆生物	50,320,152.79	5.62

33	300832	新产业	49,648,016.42	5.55
34	002371	北方华创	48,943,167.00	5.47
35	603986	兆易创新	47,043,107.67	5.26
36	688111	金山办公	46,512,248.11	5.20
37	603233	大参林	45,170,449.20	5.05
38	002456	欧菲光	43,307,447.46	4.84
39	300006	莱美药业	42,680,397.63	4.77
40	603882	金域医学	42,567,057.95	4.76
41	300573	兴齐眼药	42,210,358.45	4.72
42	000671	阳光城	42,075,447.05	4.70
43	600048	保利地产	39,718,259.00	4.44
44	688018	乐鑫科技	39,465,894.91	4.41
45	603799	华友钴业	37,877,105.36	4.23
46	000333	美的集团	36,402,137.02	4.07
47	600183	生益科技	36,397,424.54	4.07
48	603456	九洲药业	35,536,795.00	3.97
49	300059	东方财富	35,241,473.16	3.94
50	002194	武汉凡谷	34,898,292.54	3.90
51	300782	卓胜微	34,869,480.00	3.90
52	300604	长川科技	33,677,050.57	3.76
53	603707	健友股份	33,505,234.52	3.74
54	300502	新易盛	33,391,973.85	3.73
55	688008	澜起科技	33,213,874.52	3.71
56	002311	海大集团	32,057,016.68	3.58
57	300598	诚迈科技	31,507,703.00	3.52
58	300567	精测电子	30,807,680.36	3.44
59	300253	卫宁健康	30,498,880.36	3.41
60	688202	美迪西	29,875,546.88	3.34
61	300326	凯利泰	29,782,873.63	3.33
62	300653	正海生物	29,718,419.25	3.32
63	601138	工业富联	29,605,444.40	3.31
64	300659	中孚信息	29,308,383.36	3.27
65	300015	爱尔眼科	29,118,036.58	3.25
66	002271	东方雨虹	29,008,355.00	3.24
67	300841	康华生物	28,756,813.00	3.21
68	000961	中南建设	28,627,746.75	3.20
69	002304	洋河股份	28,066,018.00	3.14
70	600763	通策医疗	28,029,400.95	3.13

71	600161	天坛生物	27,444,491.09	3.07
72	002901	大博医疗	27,428,789.50	3.06
73	603019	中科曙光	27,022,981.00	3.02
74	000651	格力电器	26,759,351.28	2.99
75	688266	泽璟制药	26,587,699.33	2.97
76	688016	心脉医疗	26,081,423.82	2.91
77	688158	优刻得	25,995,044.56	2.90
78	300357	我武生物	25,889,576.68	2.89
79	603345	安井食品	25,545,228.20	2.85
80	601012	隆基股份	24,709,490.76	2.76
81	002273	水晶光电	24,681,072.64	2.76
82	300033	同花顺	24,374,785.00	2.72
83	688036	传音控股	24,154,710.50	2.70
84	000002	万科 A	23,409,331.00	2.61
85	603288	海天味业	23,104,999.80	2.58
86	603180	金牌厨柜	22,928,000.38	2.56
87	000895	双汇发展	22,833,228.77	2.55
88	000860	顺鑫农业	22,755,263.34	2.54
89	002035	华帝股份	22,405,095.97	2.50
90	600809	山西汾酒	22,336,962.00	2.50
91	002853	皮阿诺	22,237,851.40	2.48
92	300482	万孚生物	21,546,168.23	2.41
93	600622	光大嘉宝	21,245,794.49	2.37
94	603883	老百姓	20,974,672.00	2.34
95	688366	昊海生科	20,817,904.52	2.33
96	002624	完美世界	20,762,159.88	2.32
97	000799	酒鬼酒	20,555,264.20	2.30
98	600498	烽火通信	20,419,344.80	2.28
99	300017	网宿科技	20,301,178.82	2.27
100	002557	洽洽食品	20,087,190.24	2.24
101	600305	恒顺醋业	19,519,864.06	2.18
102	300132	青松股份	19,424,301.64	2.17
103	002124	天邦股份	19,100,262.67	2.13
104	688169	石头科技	19,055,607.10	2.13
105	002555	三七互娱	19,035,193.00	2.13
106	688058	宝兰德	18,947,525.14	2.12
107	600867	通化东宝	18,389,248.48	2.05
108	300740	御家汇	18,292,247.90	2.04

109	603010	万盛股份	18,091,515.95	2.02
110	000596	古井贡酒	17,914,103.00	2.00

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。

8.4.3 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	5,546,691,668.36
卖出股票收入（成交）总额	6,109,654,318.75

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 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

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与股指期货的投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	655,613.41
2	应收证券清算款	5,923,233.25
3	应收股利	-
4	应收利息	25,539.67
5	应收申购款	258,281.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,862,667.39

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
31,172	9,123.12	170,453.57	0.06%	284,215,554.26	99.94%

9.2 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	867.88	0.0003%

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。

9.3 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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2010 年 5 月 19 日 ）基金份额总额	2,233,879,213.39
本报告期期初基金份额总额	531,092,386.51
本报告期基金总申购份额	74,963,597.71
减:本报告期基金总赎回份额	321,669,976.39
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-
本报告期期末基金份额总额	284,386,007.83

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

11.2 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

2020 年 11 月 30 日，毕劲松同志新任基金管理人董事长。

自 2020 年 8 月 28 日起，刘波先生担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所，报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币拾万元整，目前该会计师事务所已连续为本基金提供审计服务十一个会计年度。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
方正证券	2	6,268,851,871.18	53.95%	5,838,183.95	53.95%	-
国盛证券	2	3,816,116,125.47	32.84%	3,553,942.32	32.84%	-
中信证券	1	766,869,308.30	6.60%	714,184.12	6.60%	-
中投证券	1	313,766,606.85	2.70%	292,210.51	2.70%	-
长城证券	1	200,108,846.85	1.72%	186,358.26	1.72%	-

海通证券	1	146,450,244.09	1.26%	136,389.11	1.26%	-
瑞银证券	1	108,405,298.66	0.93%	100,957.93	0.93%	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
民族证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
华创证券	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、按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

11.7.2 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

方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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参加中国邮政储蓄银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 1 月 2 日
2	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 1 月 2 日
3	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购	指定媒介	2020 年 1 月 2 日

	及定投申购费率优惠活动的公告		
4	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京植信基金销售有限公司基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 1 月 6 日
5	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司基金申购及定投优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 1 月 8 日
6	中邮核心主题混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	指定媒介	2020 年 1 月 18 日
7	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通华安证券股份有限公司基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 2 月 27 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万家财富基金销售（天津）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	指定媒介	2020 年 2 月 28 日
9	关于中邮创业基金管理股份有限公司增加中信期货有限公司为代销机构 并开通中信期货有限公司基金定投业务的公告	指定媒介	2020 年 3 月 3 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中国国际期货股份有限公司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	指定媒介	2020 年 3 月 16 日

11	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	指定媒介	2020 年 3 月 18 日
12	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金 开通申万宏源西部证券有限公司基金定投业务的公告	指定媒介	2020 年 4 月 16 日
13	中邮核心主题混合型证券投资基金 2019 年年度报告	指定媒介	2020 年 4 月 20 日
14	中邮核心主题混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	指定媒介	2020 年 4 月 22 日
15	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中信证券华南股份有限公司为代销机构的公告	指定媒介	2020 年 5 月 28 日
16	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中信证券华南股份有限公司为代销机构的公告	指定媒介	2020 年 5 月 28 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申购及定投起点金额下限的公告	指定媒介	2020 年 6 月 18 日
18	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下基金参加交通银行股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 7 月 1 日
19	中邮核心主题混合型证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	指定媒介	2020 年 7 月 21 日
20	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通海通证券	指定媒介	2020 年 8 月 6 日

	基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告		
21	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加 申万宏源、申万宏源西部基金申购费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 8 月 18 日
22	中邮核心主题混合型证券投资基金基金产品资料概要（更新）	指定媒介	2020 年 8 月 24 日
23	中邮核心主题混合型证券投资基金 2020 年中期报告	指定媒介	2020 年 8 月 29 日
24	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国银行费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 9 月 17 日
25	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 9 月 22 日
26	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加中国人寿为代销机构的公告	指定媒介	2020 年 9 月 22 日
27	中邮核心主题混合型证券投资基金招募说明书（更新）	指定媒介	2020 年 9 月 26 日
28	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 10 月 21 日
29	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加玄元保险为代销机构的公告	指定媒介	2020 年 10 月 21 日
30	中邮核心主题混合型证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	指定媒介	2020 年 10 月 28 日

31	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 11 月 27 日
32	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 12 月 9 日
33	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 12 月 28 日
34	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 12 月 31 日
35	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 12 月 31 日
36	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	指定媒介	2020 年 12 月 31 日

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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

无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮核心主题混合型证券投资基金募集的文件

2.《中邮核心主题混合型证券投资基金基金合同》

3.《中邮核心主题混合型证券投资基金托管协议》

4.《中邮核心主题混合型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

13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

13.3 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

2021 年 3 月 11 日