

中邮核心成长混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮核心成长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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（简称：中国农业银行）根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、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，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正。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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.....	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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	21
§7 投资组合报告.....	45
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	54
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
§8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	57
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63

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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录.....	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮核心成长混合型证券投资基金
基金简称	中邮核心成长混合
基金主代码	590002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2007 年 8 月 17 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,090,047,008.36 份

2.2 基金产品说明

投资目标	以追求长期资本增值为目的，通过投资于具有核心竞争力且能保持持续增长的企业，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速增长的成果和实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金在投资策略上充分体现“核心”与“成长”相结合的主线。</p> <p>“核心”体现在通过自上而下的研究，寻找促使宏观经济及产业政策、行业及市场演化的核心驱动因素，把握上述方面未来变化的趋势；从公司治理、公司战略、比较优势等方面来把握公司核心竞争优势。</p> <p>“成长”主要是指通过建立成长性估值模型来分析评价公司的成长价值，并进行横向比较来发现具有持续成长优势的公司，从而达到精选个股的目的。</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金在构建和管理投资组合的过程中，主要采取“自上而下”为主的投资方法，做出资产配置及投资组合的构建，并根据宏观、产业景气、市场变化及时调整资产配置比例。</p> <p>本基金采用战略性资产配置为主、战术性资产配置为辅的配置策略：战略性资产配置首先要确定各类资产的预期回报率和波动率，然后再按照要求对满足风险收益目标的资产进行混合；战术性资产配置增加了对市场短期趋势判断的重视，把握时机进行仓位调整和波段操作，一般用于短期的资产配置。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>（1）行业配置策略</p> <p>本基金行业配置在资产配置的基础上，遵循自上而下方式。具体方法是：</p> <p>基于全球视野下的产业周期的分析和判断</p> <p>基于行业生命周期的分析</p>

	<p>基于行业内产业竞争结构的分析</p> <p>(2) 个股选择策略</p> <p>在选定的行业中，选择那些具有明显竞争优势、持续成长能力强且质量出色的企业。股票的选择和组合构建通过以下几个方面进行：</p> <p>企业在行业中的地位和核心竞争力</p> <p>根据迈克尔·波特的竞争理论，本基金重点投资那些拥有特定垄断资源或不可替代性技术或资源优势，具有较高进入壁垒或者较强定价能力，具有核心竞争力的行业。</p> <p>高成长性</p> <p>对每一个行业，分析其所处的生命周期阶段。本基金将重点投资处于成长期的行业，对这些行业给予相对较高估值。</p> <p>企业的质量</p> <p>本基金认为，只有注重企业成长的质量和综合治理能力才能准确发掘公司的内在价值，降低投资风险。本基金认为，通过上面核心竞争力、成长性和企业质量三个方面的综合评价而选择出的企业将会充分反映本基金“核心成长”的投资理念，同时再辅以科学、全面的风险控制，可以有效保障本基金实现长期稳定增值的投资目标。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 久期管理</p> <p>久期管理是债券组合管理的核心环节，是提高收益、控制风险的有效手段。</p> <p>(2) 期限结构配置</p> <p>本基金将在确定组合久期后，结合收益率曲线变化的预测，进行期限结构的配置。主要的配置方式有：梯形组合、哑铃组合、子弹组合。</p> <p>(3) 确定类属配置</p> <p>类属配置主要体现在对不同类型债券的选择，实现债券组合收益的优化。</p> <p>(4) 个债选择</p> <p>本基金在综合考虑上述配置原则基础上，通过对个体券种的价值分析，重点考察各券种的收益率、流动性、信用等级，选择相应的最优投资对象。</p> <p>4、权证投资策略</p> <p>本基金将因为上市公司进行股权分置改革、或增发、配售等原因被动获得权证，或者在进行套利交易、避险交易等情形下主动投资权证。本基金进行权证投资时，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。</p> <p>本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深 300 指</p>
--	---

	<p>数，债券部分的业绩比较基准为中国债券总指数。</p> <p>本基金的整体业绩比较基准采用： $\text{沪深 300 指数} \times 80\% + \text{中国债券总指数} \times 20\%$</p> <p>沪深 300 指数是沪深证券交易所第一次联合发布的反映 A 股市场整体走势的指数，由中证指数公司编制和维护，是在上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的，指数样本覆盖了沪深市场六成左右的市值，具有良好的市场代表性。沪深 300 指数引进国际指数编制和管理的经验，编制方法清晰透明，具有独立性和良好的市场流动性；与市场整体表现具有较高的相关性，且指数历史表现强于市场平均收益水平。因此，本基金认为，该指数能够满足本基金的投资管理需要。</p>
业绩比较基准	$\text{沪深 300 指数} \times 80\% + \text{中国债券总指数} \times 20\%$
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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	秦一楠
	联系电话	010-82295160—157	010-66060069
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-58511618	95599
传真		010-82295155	010-68121816
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100013	100031
法定代表人		毕劲松	谷澍

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.postfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人和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(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-609,250,933.88
本期利润	-515,865,500.87
加权平均基金份额本期利润	-0.1007
本期加权平均净值利润率	-12.04%
本期基金份额净值增长率	-10.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-614,953,816.88
期末可供分配基金份额利润	-0.1208
期末基金资产净值	4,475,093,191.48
期末基金份额净值	0.8792
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-12.08%

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，不是当期发生额）。

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	10.05%	1.16%	7.64%	0.86%	2.41%	0.30%
过去三个月	5.50%	1.27%	5.24%	1.14%	0.26%	0.13%
过去六个月	-10.17%	1.53%	-6.98%	1.16%	-3.19%	0.37%
过去一年	-11.17%	1.39%	-10.33%	1.00%	-0.84%	0.39%
过去三年	53.68%	1.36%	17.68%	1.01%	36.00%	0.35%

自基金合同生效起至今	-12.08%	1.74%	18.03%	1.32%	-30.11%	0.42%
------------	---------	-------	--------	-------	---------	-------

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。

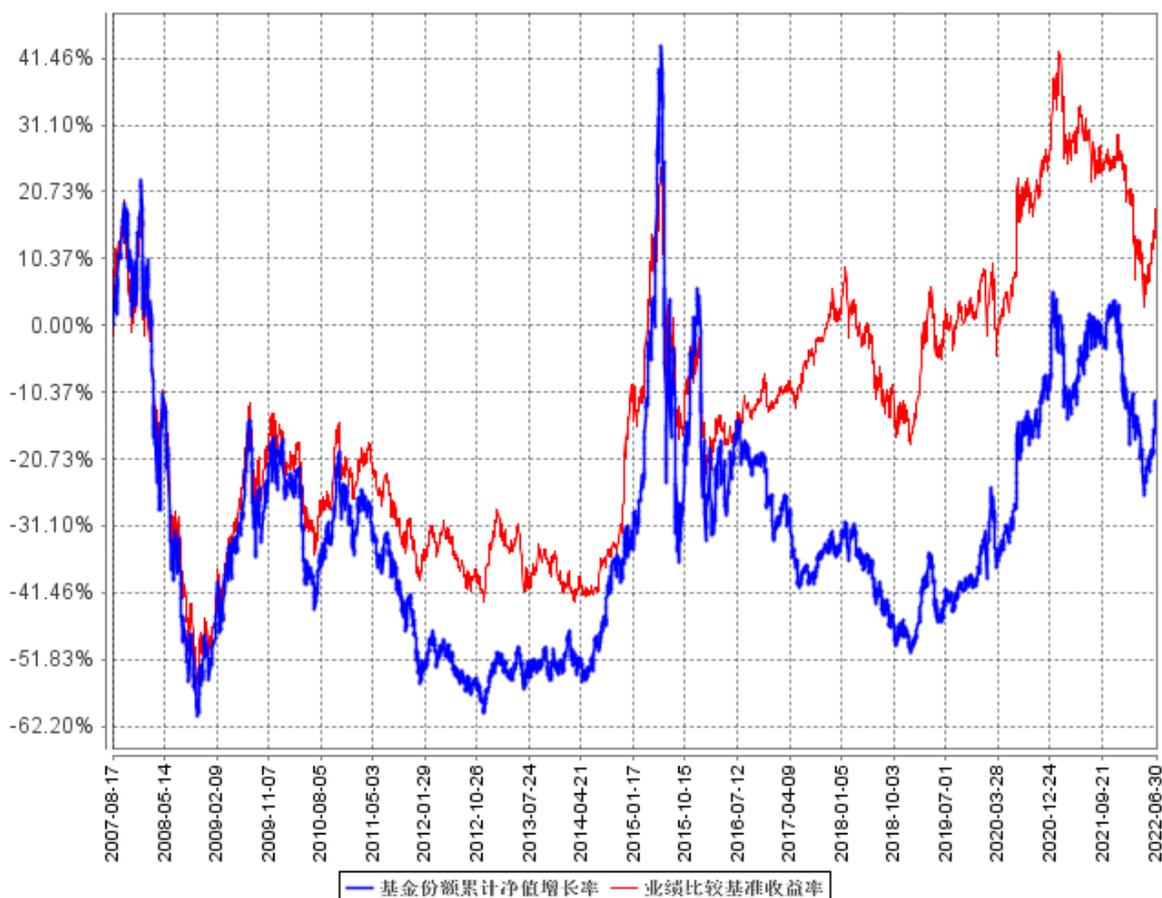
本基金业绩衡量基准=沪深 300 收益率×80%+中国债券总指数收益率×20%

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 指数和中国债券总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

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：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起 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约定。

§ 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 2022 年 6 月 30 日，本公司共管理 57 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 500 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、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮未来成长混合型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金、中邮兴荣价值一年持有期混合型证券投资基金、

中邮能源革新混合型发起式证券投资基金、中邮睿泽一年持有期债券型证券投资基金、中邮尊佑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		
王曼	基金经理	2021年8月20日	-	9年	经济学硕士，曾任中邮创业基金管理股份有限公司中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理兼行业研究员、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来成长混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理。
白鹏	基金经理	2021年8月23日	-	7年	工学博士，曾任中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理；现任中邮核心成长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、中邮能源革新混合型发起式证券投资基金基金经理。
陈梁	基金经理	2021年11月22日	-	13年	曾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、中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、中邮乐享收益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、中邮多策略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、中邮军民融合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权益投资部副总经理、中邮核心主题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、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、中邮睿丰增强债券型证券投资基金基金经理。
金振振	基金经理助理	2021 年 6 月 11 日	-	6 年	理学硕士，曾任首都开发股份有限公司财务部财务管理岗、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员。现任中邮创业基金管理股份有限公司基金经理助理。

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

开年市场延续了从 21 年 12 月中旬以来的调整行情，市场普跌，相对而言成长方向下跌幅度更大，而价值方向的表现相对坚挺。

随着美联储的关注重心从就业转向通胀，美债利率，特别是短期利率开始快速上行。持续上行的美债利率对全球流动性形成了明显影响，国内出现了成长方向的持续性调整，去年表现抢眼的新能源、军工、半导体等方向都出现了大幅调整。

一季度海外事件和冲击频发。俄乌冲突的全面爆发引致俄罗斯招致全面制裁，能源价格、资源品价格遭遇 corner risk，油价近月飙升至近 130 美金，镍价 5 个交易日从 2.5 万美金最高飙升至 10 万美金。俄罗斯遭遇制裁使得全球脆弱的供应链雪上加霜，通胀预期大幅上行，全球能源紧张，煤、油、气全面上涨。3 月美联储开启加息周期，加息 25BP，口径极其鹰，更快、更大幅度行动。过程中香港科技股出现了崩溃式下跌和“V”型反转，在 3 月 14 日那周恒生科技指数周一、二两天下跌达 20%，周三、四两天上涨 30%。金稳委表态，中美元首通话，各种大事频出，市场高度波动……

在基金经理的理解中，海外风险和事件的系统性爆发是一季度市场较弱的主要因素。一季度上证综指下跌 10.65%，创业板综指下跌 18.25%。价值方向的红利指数是宽基指数中最强的，上涨 7.53%，而成长方向的科创 50 下跌 21.97%、创成长下跌 19.27%。

从国内政策来看，从去年 12 月份开始，时隔多年再一次看到稳增长被放到如此重要的位置。但疫情的反复，对国内的经济运行和市场交易者信心都出现的波动和起伏。3 月底开始的上海封城，同时部分地区的管控频出，对物流和制造业的供应链系统都造成了很大的冲击的，权益市场

对经济的预期明显转向悲观，4 月市场快速调整，部分带止损线的资金一度出现了恐慌性抛盘。

随着 4 月底政治局会议明确“加大宏观政策调节力度，扎实稳住经济，努力实现全年经济社会发展预期目标”，市场开始强势反弹，同时 A 股市场开始和海外市场表现明显脱敏，随着复工复产的进行，生产链条相关的产业快速反弹，随着 5 月底稳住经济大盘电视电话的召开，政策继续发力，汽车成为了政策最大的着力点，6 月汽车链条从 5 月的反弹形成反转。

上半年的行情对基金经理提出了更高的挑战。本产品在年初对行情是有误判的，中央经济工作会议时隔多年再度提出“稳字当头”、“稳中求进”。基于过往经验，基金经理认为政策将具有强置信度，随着政策发力，之前紧缩的信用将重回扩张，以“风电”、“光伏”、电力系统为代表的新能源投资方向将成为市场较强的共振点。同时随着 21 年交易的结束，22 年市场的资金将更多得立足于中长期维度进行布局，“泛电力链条”在未来将逐步替代“房地产链条”+“基建链条”成为主产业链条，随着增量资金的进入，存量博弈的状态将改变，对市场的春季躁动有较高期待。基金经理保持了较高的权益仓位，并且在新能源方向保持了较高的配置。

从行情的演绎来看，仅仅立足于国内货币信用政策的框架，呈现出了明显的不足。市场在 12 月下旬和 1 月市场率先演绎了美联储加息缩表对国内估值的牵制，成长的主要交易方向，消费、医药、新能源、半导体、军工都出现了大幅调整。从 2 月份开始基金经理开始对组合进行较大幅度调整，部分减仓了组合中的成长方向。大幅降低了组合仓位，同时将组合中成长的方向调整为低估值未来受益于疫后线下修复的出行和服务链条和目前依然处于显著价值区的养殖，阶段性回避了 3/4 月份市场的大幅下跌，但在 5 月份开始的“V”型反转的行情表现时，组合的加仓相对偏慢，部分加仓了电新和尚未有较强演绎的医药，但在强表现的新能源方向配置不足，影响了组合的表现。

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 0.8792 元，累计净值为 0.8792 元；本报告期基金份额净值增长率为-10.17%，业绩比较基准收益率为-6.98%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从市场展望看，随着权益市场对海外流动性情况的脱敏，我们市场的运行更依赖于我们自身的要素。在经历 1 到 4 月份的下跌和 5-6 月份的强劲反弹，步入 7 月，市场的波动明显提升。7 月 19 日李克强总理在世界经济论坛全球企业家视频特别对话会中表示：“宏观政策既精准有力又合理适度，不会为了过高增长目标而出台超大规模刺激措施、超发货币、预支未来”。国内的政策表现了更强的战略定力。在政策依旧友善的大背景下，我们看好市场中长期看好权益市场的结构性机会。由于整体经济的强度相对有限，下半年来看，在整体需求偏弱的大背景下，成长方向仍

占优。

本产品立足实现“平稳可控状态下的较好回报”，今年虽然整体的消费偏弱，但经过 5/6 月份的强演绎后，这样方向的交易拥挤度相对较低。消费和医药标的更多体现实在“质地”和“商业模式”的优势，随着负债端冲击的缓释，这样方向的持有有望在 Q4 获取估值切换下的回报，同时在强景气的“泛电力”链条和政策刺激的汽车链条上，组合有所持仓，力争获取相应的景气回报。考虑到市场的波动加大，我们会逆向交易，降低不当交易摩擦所造成的损失。

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，本基金未能满足利润分配条件，故未进行利润分配。

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

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何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

本托管人认为，中邮创业基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中邮创业基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 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：中邮核心成长混合型证券投资基金

报告截止日：2022年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	864,001,896.33	358,961,333.22
结算备付金		775,183.81	43,283,241.69
存出保证金		1,391,782.09	2,592,094.20
交易性金融资产	6.4.7.2	3,654,514,176.28	4,722,540,000.83
其中：股票投资		3,497,083,894.34	4,677,396,000.83
基金投资		-	-
债券投资		157,430,281.94	45,144,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		22,030,555.45	-
应收股利		-	-
应收申购款		247,674.34	196,006.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	300,209.79
资产总计		4,542,961,268.30	5,127,872,885.89

负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		39,314,405.85	42,935,239.66
应付赎回款		759,656.74	1,849,520.52
应付管理人报酬		5,171,966.54	6,613,530.03
应付托管费		861,994.39	1,102,255.03
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		15,571,219.82	15,571,200.00
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	6,188,833.48	11,782,376.17
负债合计		67,868,076.82	79,854,121.41
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	5,090,047,008.36	5,157,808,452.01
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-614,953,816.88	-109,789,687.53
净资产合计		4,475,093,191.48	5,048,018,764.48
负债和净资产总计		4,542,961,268.30	5,127,872,885.89

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8792 元，基金份额总额 5,090,047,008.36 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮核心成长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-478,478,499.55	228,969,360.33
1.利息收入		8,710,883.39	7,059,000.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,710,883.39	7,056,682.88
债券利息收入		-	2,317.12
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）		-580,590,605.64	542,389,370.02
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-597,247,198.72	517,532,460.63
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,462,984.98	4,127,016.66
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	15,193,608.10	20,729,892.73
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	93,385,433.01	-320,544,468.87
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	15,789.69	65,459.18
减：二、营业总支出		37,387,001.32	70,110,769.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	31,908,898.37	42,663,764.07
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,318,149.70	7,110,627.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		13.14	8.34
8. 其他费用	6.4.7.23	159,940.11	20,336,370.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-515,865,500.87	158,858,590.45
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-515,865,500.87	158,858,590.45
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-515,865,500.87	158,858,590.45

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中邮核心成长混合型证券投资基金

本报告期：2022年1月1日至2022年6月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	5,157,808,452.01	-	-109,789,687.53	5,048,018,764.48
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	5,157,808,452.01	-	-109,789,687.53	5,048,018,764.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-67,761,443.65	-	-505,164,129.35	-572,925,573.00
(一)、综合收益总额	-	-	-515,865,500.87	-515,865,500.87
(二)、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)	-67,761,443.65	-	10,701,371.52	-57,060,072.13
其中：1.基金申购款	37,137,467.36	-	-5,378,453.32	31,759,014.04
2.基金赎回款	-104,898,911.01	-	16,079,824.84	-88,819,086.17
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,090,047,008.36	-	-614,953,816.88	4,475,093,191.48
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	6,594,289,970.46	-	-227,509,718.86	6,366,780,251.60
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	6,594,289,970.46	-	-227,509,718.86	6,366,780,251.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-741,991,124.62	-	167,995,978.32	-573,995,146.30

(一)、综合收益总额	-	-	158,858,590.45	158,858,590.45
(二)、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)	-741,991,124.62	-	9,137,387.87	-732,853,736.75
其中: 1.基金申购款	67,071,879.62	-	-2,128,373.74	64,943,505.88
2.基金赎回款	-809,063,004.24	-	11,265,761.61	-797,797,242.63
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	5,852,298,845.84	-	-59,513,740.54	5,792,785,105.30

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:

 张志名 唐亚明 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

中邮核心成长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”)证监基金字[2007]219号《关于同意中邮核心成长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《中邮核心成长股票型证券投资基金基金合同》发起,并于2007年8月17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14,956,625,039.16元,业经北京京都会计师事务所有限责任公司北京京都验字(2007)第045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,基金托管人为中国农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》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《中邮核心成长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、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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:股票资产占基金资产的比例为60%-95%,债券、权证、短期金融工具以及证监会允许投资的其他金融工具

占基金资产的比例为 0%-40%。(其中,权证的投资比例为基金资产净值的 0%-3%,本基金管理人管理的全部基金持有同一权证的比例不超过该权证的 10%),并保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

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“中邮核心成长股票型证券投资基金”,更名后基金全称为“中邮核心成长混合型证券投资基金”。

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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本公司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估计与最近一期年度报告一致。

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

①新金融工具准则

财政部于 2017 年颁布了《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量(修订)》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移(修订)》、《企业会计准则第 24 号——套期会计(修订)》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报(修订)》(统称“新金融工具准则”),本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,对会计政策相关内容进行了调整。

新金融工具准则要求根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,将金融资产划分为以下三类:(1)以摊余成本计量的金融资产;(2)以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产;(3)以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。混合合同包含的主合同属于金融资产的,不应从该混合合同中分拆嵌入衍生工具,而应当将该混合合同作为一个整体适用金融资产分类的相关规定。

采用新金融工具准则对本基金金融负债的会计政策并无重大影响。

本基金按照新金融工具准则的规定，对金融工具的分类和计量进行追溯调整，金融工具原账面价值和金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）的新账面价值之间的差额仅涉及重分类，不影响 2022 年年初未分配利润。同时，本基金未对比较财务报表数据进行调整。

②财务报表格式的调整

财政部于 2018 年 12 月 27 日发布了《关于修订印发 2018 年度金融企业财务报表格式的通知》（财会〔2018〕36 号），对已执行新金融工具准则的金融企业的财务报表格式进行了规范。根据该通知及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金对财务报表格式进行了以下修订：

资产负债表，增加根据新金融工具准则新增的报表项目：债权投资、其他债权投资、其他权益工具投资；基于实际利率法计提的金融工具的利息应包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关资产负债表项目中，而不应单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目；“应付交易费用”并入“其他负债”。

财务报表格式的修订对本基金的资产总额、负债总额、净利润、所有者权益等无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，执行新金融工具准则时金融工具分类和账面价值调节如下：

应收利息调整前账面金额为 300,209.79 元，全部调整至相关金融资产的账面价值中，其中 168,607.09 元重分类至银行存款，19,477.40 元重分类至结算备付金，1,166.40 元重分类至存出保证金，110,958.90 元重分类至交易性金融资产-债券投资，应收利息调整后账面金额为 0 元。

银行存款调整前账面金额为 358,961,333.22 元，调整后账面金额为 359,129,940.31；结算备付金调整前账面金额为 43,283,241.69 元，调整后账面金额为 43,302,719.09 元；存出保证金调整前账面金额为 2,592,094.20 元，调整后账面金额为 2,593,260.60 元；交易性金融资产调整前账面金额为 4,722,540,000.83 元，调整后账面金额为 4,722,650,959.73 元。

应付交易费用调整前账面金额为 10,239,115.10 元，全部重分类至其他负债，调整后账面金额为 0 元。其他负债调整前账面金额为 1,543,261.07 元，调整后账面金额为 11,782,376.17 元。

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 2022年6月30日
活期存款	864,001,896.33
等于：本金	863,697,306.34
加：应计利息	304,589.99
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	864,001,896.33

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	3,280,509,098.50	-	3,497,083,894.34	216,574,795.84	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,655,000.00	3,611.77	6,421,925.77	1,763,314.00
	银行间市场	151,077,056.15	1,938,356.17	151,008,356.17	-2,007,056.15
	合计	155,732,056.15	1,941,967.94	157,430,281.94	-243,742.15
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	

其他	-	-	-	-
合计	3,436,241,154.65	1,941,967.94	3,654,514,176.28	216,331,053.69

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	228.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	4,526,603.31
其中：交易所市场	4,524,815.81
银行间市场	1,787.50
应付利息	-
预提费用	559,014.74
其他	1,102,986.63
合计	6,188,833.48

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	5,157,808,452.01	5,157,808,452.01
本期申购	37,137,467.36	37,137,467.36
本期赎回(以“-”号填列)	-104,898,911.01	-104,898,911.01
- 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	5,090,047,008.36	5,090,047,008.36

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 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
本期期初	1,304,141,562.58	-1,413,931,250.11	-109,789,687.53
本期利润	-609,250,933.88	93,385,433.01	-515,865,500.87
本期基金份额交易产生的变动数	-12,086,420.18	22,787,791.70	10,701,371.52
其中：基金申购款	7,532,058.65	-12,910,511.97	-5,378,453.32
基金赎回款	-19,618,478.83	35,698,303.67	16,079,824.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	682,804,208.52	-1,297,758,025.40	-614,953,816.88

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	8,631,378.20
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	62,399.92
其他	17,105.27
合计	8,710,883.39

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	5,808,516,069.14
减：卖出股票成本总额	6,388,826,771.11
减：交易费用	16,936,496.75
买卖股票差价收入	-597,247,198.72

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	980,817.54
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	482,167.44
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,462,984.98

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	97,741,285.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	96,433,284.93
减：应计利息总额	824,044.01
减：交易费用	1,789.24
买卖债券差价收入	482,167.44

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金未投资贵金属。

6.4.7.18 衍生工具收益

本报告期本基金无衍生工具投资。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	15,193,608.10
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	15,193,608.10

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	93,385,433.01
——股票投资	93,772,065.57
——债券投资	-386,632.56
——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	93,385,433.01

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	15,789.69
合计	15,789.69

注：本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.50% 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% 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。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券帐户维护费	9,000.00
银行费用	22,325.37
上清所债券账户维护费	9,600.00
合计	159,940.11

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

截止 2022 年 08 月 22 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
中国农业银行股份有限公司	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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
首创证券股份有限公司	2,057,485,644.18	18.87%	-	-

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
首创证券股份有 限公司	1,916,128.96	18.87%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总 量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述交易佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取，并由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	31,908,898.37	42,663,764.07
其中：支付销售机构的客户维护费	9,515,851.65	12,238,718.89

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人报酬按前一日基金资产净值的 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

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
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,318,149.70	7,110,627.31

注：支付基金托管人中国农业银行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。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期内未向关联方支付销售服务费。

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

本报告期内及上年度可比期间本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券交易（含回购）。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

本报告期及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.4.2 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

本报告期及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2007 年 8 月 17 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	3,261,217.57	3,261,217.57
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	3,261,217.57	3,261,217.57
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.06%	0.06%

6.4.10.5.2 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		2021 年 1 月 1 日至 2021 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
中国农业银行股份有限公司	864,001,896.33	8,631,378.20	854,994,544.26	6,955,006.14

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 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。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2022 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	受限期	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
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688279	峰岬科技	2022 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	82.00	67.34	5,505	451,410.00	370,706.70	-
688238	和元生物	2022 年 3 月 15 日	6 个月	新股流通受限	13.23	25.32	12,836	169,820.28	325,007.52	-
688290	景业智能	2022 年 4 月 21 日	6 个月	新股流通受限	33.89	46.87	3,040	103,025.60	142,484.80	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.52	19.74	7,172	75,449.44	141,575.28	-
688175	高凌信息	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通受限	51.68	32.23	2,851	147,339.68	91,887.73	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	-
301219	腾远钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	-
301216	万凯	2022 年	6 个月	新股	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-

	新材	3月21日	月	流通受限						
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	34.81	16.14	1,839	42,677.06	29,681.46	-
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股流通受限	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股流通	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-

		日		受限						
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022年1月4日	6个月	新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022年3月2日	6个月	新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301163	宏德股份	2022年4月11日	6个月	新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301181	标榜股份	2022年2月11日	6个月	新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期内本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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之内。

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。

6.4.13.2.1 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	59,249,460.02	45,144,000.00
AAA 以下	98,180,821.92	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	157,430,281.94	45,144,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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 2022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	864,001,896.33	-	-	-	864,001,896.33
结算备付金	775,183.81	-	-	-	775,183.81
存出保证金	1,391,782.09	-	-	-	1,391,782.09
交易性金融资产	-	-	155,488,314.00	3,499,025,862.28	3,654,514,176.28
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
发放贷款和垫款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-

其他债 权投资 (债权 投资)					
应收清 算款				22,030,555.45	22,030,555.45
应收利 息					
应收股 利					
应收申 购款				247,674.34	247,674.34
其他资 产					
资产总 计	866,168,862.23	-155,488,314.00	3,521,304,092.07	4,542,961,268.30	
负债					
应付清 算款				39,314,405.85	39,314,405.85
应付赎 回款				759,656.74	759,656.74
应付管 理人报 酬				5,171,966.54	5,171,966.54
应付托 管费				861,994.39	861,994.39
应付销 售服务 费					
应付投 资顾问 费					
应交税 费				15,571,219.82	15,571,219.82
应付利 息					
应付利 润					
其他负 债				6,188,833.48	6,188,833.48
负债总 计				67,868,076.82	67,868,076.82
利率敏 感度缺	866,168,862.23	-155,488,314.00	3,453,436,015.25	4,475,093,191.48	

口					
上年度末 2021 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	358,961,333.22	-	-	-	358,961,333.22
结算备付金	43,283,241.69	-	-	-	43,283,241.69
存出保证金	2,592,094.20	-	-	-	2,592,094.20
交易性金融资产	-	-	45,144,000.00	4,677,396,000.83	4,722,540,000.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	196,006.16	196,006.16
其他资产	-	-	-	300,209.79	300,209.79
资产总计	404,836,669.11	-	45,144,000.00	4,677,892,216.78	5,127,872,885.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	42,935,239.66	42,935,239.66
应付赎回款	-	-	-	1,849,520.52	1,849,520.52
应付管理人报酬	-	-	-	6,613,530.03	6,613,530.03
应付托管费	-	-	-	1,102,255.03	1,102,255.03
应交税	-	-	-	15,571,200.00	15,571,200.00

费					
应付利息					
应付利润					
其他负债				11,782,376.17	11,782,376.17
负债总计				79,854,121.41	79,854,121.41
利率敏感度缺口	404,836,669.11		45,144,000.00	4,598,038,095.37	5,048,018,764.48

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变		
	市场利率下降 25 个基点且其他市场变量保持不变		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	-2,195,183.45	-855,701.70
	2. 基金净资产变动	2,276,353.38	898,142.70

6.4.13.4.2 外汇风险

-

6.4.13.4.3 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、债券及法

律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资组合范围为：股票资产占基金资产的比例为 60%~95%，债券、权证、短期金融工具以及证监会允许投资的其他金融工具占基金资产的比例为 0%~40%。本基金投资于权证、资产支持证券的比例遵从法律法规及监管机构的规定。

本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，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。对于中国证监会允许投资创新类金融产品（包括未来将推出的股指期货等衍生金融产品），将依据有关法律法规进行投资管理。如法律法规或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。本基金股票资产中 80% 以上投资于具有“核心”及“成长”这两条主线的股票。基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合上述约定。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	3,497,083,894.34	78.15	4,677,396,000.83	92.66
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	157,430,281.94	3.52	45,254,958.90	0.90
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	3,654,514,176.28	81.66	4,722,650,959.73	93.55

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	33,568,908.93	52,625,875.54
	2. 基金净资产变动	-33,568,908.93	-52,625,875.54

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，利用 2022 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 0.92。

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	3,500,409,992.81	4,670,078,368.92
第二层次	151,008,356.17	45,524,229.35
第三层次	3,095,827.30	6,937,402.56
合计	3,654,514,176.28	4,722,540,000.83

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的金融工具的公允价值未发生所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括：银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他各类应收应付款项等。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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	3,497,083,894.34	76.98
	其中：股票	3,497,083,894.34	76.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	157,430,281.94	3.47
	其中：债券	157,430,281.94	3.47
	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	864,777,080.14	19.04
8	其他各项资产	23,670,011.88	0.52
9	合计	4,542,961,268.30	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。

7.2 报告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	136,480,000.00	3.05
B	采矿业	1,977,846.11	0.04
C	制造业	2,161,062,560.91	48.29
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,320,473.34	1.84
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	36,436,153.26	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	10,268,500.00	0.23
H	住宿和餐饮业	344,852,748.06	7.71
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,289,717.32	0.83
J	金融业	-	-
K	房地产业	15,785,000.00	0.35
L	租赁和商务服务业	123,976,560.51	2.77
M	科学研究和技术服务业	524,122,263.54	11.71
N	水利、环境和公共设施管理业	22,314,723.39	0.50

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	192,036.36	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,311.54	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,497,083,894.34	78.15

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。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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	603259	药明康德	1,800,028	187,184,911.72	4.18
2	300759	康龙化成	1,500,038	142,833,618.36	3.19
3	300999	金龙鱼	2,500,000	135,050,000.00	3.02
4	300122	智飞生物	1,200,000	133,212,000.00	2.98
5	600754	锦江酒店	2,000,000	125,800,000.00	2.81
6	301073	君亭酒店	1,800,009	124,812,624.06	2.79
7	600138	中青旅	9,600,000	123,744,000.00	2.77
8	601012	隆基绿能	1,819,752	121,250,075.76	2.71
9	300841	康华生物	899,975	103,893,114.00	2.32
10	600258	首旅酒店	3,800,005	94,240,124.00	2.11
11	002202	金风科技	6,000,000	88,800,000.00	1.98
12	600438	通威股份	1,399,987	83,803,221.82	1.87
13	601985	中国核电	12,000,069	82,320,473.34	1.84
14	002129	TCL 中环	1,249,948	73,609,437.72	1.64
15	688202	美迪西	209,975	71,309,609.75	1.59
16	600975	新五丰	8,000,000	69,280,000.00	1.55
17	002124	天邦食品	10,000,000	67,200,000.00	1.50
18	603806	福斯特	979,922	64,204,489.44	1.43
19	600884	杉杉股份	1,800,000	53,496,000.00	1.20
20	002487	大金重工	1,173,189	48,957,176.97	1.09
21	603606	东方电缆	600,000	45,960,000.00	1.03
22	603127	昭衍新药	400,075	45,528,535.00	1.02
23	688356	键凯科技	186,489	45,094,905.09	1.01
24	600582	天地科技	9,000,000	43,020,000.00	0.96

25	002837	英维克	1,624,935	40,200,891.90	0.90
26	300750	宁德时代	70,000	37,380,000.00	0.84
27	688223	晶科能源	2,467,157	36,834,654.01	0.82
28	002594	比亚迪	100,000	33,349,000.00	0.75
29	688516	奥特维	122,000	32,567,900.00	0.73
30	601689	拓普集团	450,300	30,814,029.00	0.69
31	603596	伯特利	360,000	28,864,800.00	0.65
32	300347	泰格医药	250,000	28,612,500.00	0.64
33	603035	常熟汽饰	1,699,907	28,082,463.64	0.63
34	002245	蔚蓝锂芯	1,200,000	27,852,000.00	0.62
35	601567	三星医疗	2,086,500	27,708,720.00	0.62
36	300850	新强联	299,957	26,705,171.71	0.60
37	301097	天益医疗	500,317	26,416,737.60	0.59
38	300095	华伍股份	2,000,000	26,240,000.00	0.59
39	002791	坚朗五金	200,000	25,944,000.00	0.58
40	002466	天齐锂业	200,000	24,960,000.00	0.56
41	000963	华东医药	550,000	24,838,000.00	0.56
42	688621	阳光诺和	220,000	24,068,000.00	0.54
43	300896	爱美客	39,980	23,988,399.80	0.54
44	002567	唐人神	2,800,000	23,828,000.00	0.53
45	002459	晶澳科技	300,000	23,670,000.00	0.53
46	603676	卫信康	2,299,500	23,178,960.00	0.52
47	002821	凯莱英	80,000	23,120,000.00	0.52
48	600406	国电南瑞	851,904	23,001,408.00	0.51
49	300760	迈瑞医疗	70,000	21,924,000.00	0.49
50	688599	天合光能	330,000	21,532,500.00	0.48
51	300627	华测导航	600,000	20,634,000.00	0.46
52	603568	伟明环保	600,000	20,022,000.00	0.45
53	002196	方正电机	2,000,000	19,520,000.00	0.44
54	688658	悦康药业	1,000,000	18,820,000.00	0.42
55	300919	中伟股份	149,956	18,579,548.40	0.42
56	300861	美畅股份	199,938	18,532,253.22	0.41
57	002851	麦格米特	701,950	18,433,207.00	0.41
58	600309	万华化学	185,000	17,943,150.00	0.40
59	002475	立讯精密	509,919	17,230,163.01	0.39
60	002318	久立特材	1,000,000	15,990,000.00	0.36
61	000002	万科 A	770,000	15,785,000.00	0.35
62	601238	广汽集团	1,000,000	15,240,000.00	0.34
63	688677	海泰新光	161,977	14,900,264.23	0.33

64	002372	伟星新材	600,000	14,424,000.00	0.32
65	688300	联瑞新材	180,000	13,977,000.00	0.31
66	688105	诺唯赞	157,972	13,411,822.80	0.30
67	603260	合盛硅业	109,914	12,965,455.44	0.29
68	300772	运达股份	480,000	12,211,200.00	0.27
69	603309	维力医疗	700,000	11,088,000.00	0.25
70	002091	江苏国泰	1,000,000	10,750,000.00	0.24
71	002415	海康威视	270,000	9,774,000.00	0.22
72	002595	豪迈科技	410,000	9,159,400.00	0.20
73	000895	双汇发展	300,000	8,790,000.00	0.20
74	603277	银都股份	410,000	8,655,100.00	0.19
75	600481	双良节能	499,972	8,424,528.20	0.19
76	300012	华测检测	360,000	8,355,600.00	0.19
77	002690	美亚光电	379,990	8,238,183.20	0.18
78	601816	京沪高铁	1,600,000	8,032,000.00	0.18
79	603667	五洲新春	494,868	7,853,555.16	0.18
80	600519	贵州茅台	3,800	7,771,000.00	0.17
81	300450	先导智能	114,000	7,202,520.00	0.16
82	002852	道道全	550,000	7,095,000.00	0.16
83	688033	天宜上佳	330,000	7,009,200.00	0.16
84	002557	洽洽食品	119,936	6,827,956.48	0.15
85	603583	捷昌驱动	200,000	6,678,000.00	0.15
86	002483	润邦股份	1,000,000	6,460,000.00	0.14
87	000568	泸州老窖	26,000	6,410,040.00	0.14
88	000301	东方盛虹	360,000	6,087,600.00	0.14
89	000858	五粮液	30,000	6,057,900.00	0.14
90	002833	弘亚数控	350,000	5,838,000.00	0.13
91	002975	博杰股份	145,500	5,565,375.00	0.12
92	603501	韦尔股份	30,000	5,190,900.00	0.12
93	002286	保龄宝	450,000	5,152,500.00	0.12
94	688121	卓然股份	200,000	4,862,000.00	0.11
95	600600	青岛啤酒	45,000	4,676,400.00	0.10
96	600779	水井坊	50,000	4,627,000.00	0.10
97	600745	闻泰科技	50,000	4,255,500.00	0.10
98	002612	朗姿股份	149,922	4,239,794.16	0.09
99	600741	华域汽车	179,947	4,138,781.00	0.09
100	601633	长城汽车	110,000	4,074,400.00	0.09
101	300496	中科创达	30,000	3,914,400.00	0.09
102	688600	皖仪科技	293,664	3,797,075.52	0.08

103	002920	德赛西威	23,000	3,404,000.00	0.08
104	688167	炬光科技	22,014	3,274,582.50	0.07
105	601799	星宇股份	19,000	3,249,000.00	0.07
106	600699	均胜电子	200,000	3,142,000.00	0.07
107	300115	长盈精密	300,000	3,093,000.00	0.07
108	002405	四维图新	200,000	3,014,000.00	0.07
109	603297	永新光学	25,000	2,792,750.00	0.06
110	600989	宝丰能源	180,000	2,637,000.00	0.06
111	002273	水晶光电	200,000	2,422,000.00	0.05
112	600199	金种子酒	80,000	2,268,000.00	0.05
113	600004	白云机场	150,000	2,236,500.00	0.05
114	300088	长信科技	299,936	2,225,525.12	0.05
115	688032	禾迈股份	2,534	2,207,114.00	0.05
116	688187	时代电气	33,865	2,200,886.35	0.05
117	300552	万集科技	70,000	2,151,800.00	0.05
118	002036	联创电子	140,000	2,150,400.00	0.05
119	603348	文灿股份	38,000	2,036,800.00	0.05
120	600938	中国海油	120,005	1,960,520.89	0.04
121	002549	凯美特气	100,000	1,810,000.00	0.04
122	300752	隆利科技	70,000	1,712,200.00	0.04
123	002373	千方科技	150,000	1,668,000.00	0.04
124	601965	中国汽研	97,950	1,587,769.50	0.04
125	603995	甬金股份	46,110	1,552,062.60	0.03
126	688326	经纬恒润	10,000	1,470,600.00	0.03
127	601728	中国电信	394,011	1,469,661.03	0.03
128	002906	华阳集团	29,200	1,323,052.00	0.03
129	603786	科博达	20,000	1,231,400.00	0.03
130	603290	斯达半导	3,000	1,157,700.00	0.03
131	688127	蓝特光学	50,000	1,123,000.00	0.03
132	300223	北京君正	10,000	1,062,500.00	0.02
133	688779	长远锂科	43,086	861,720.00	0.02
134	688220	翱捷科技	12,371	860,403.05	0.02
135	688072	拓荆科技	5,300	822,030.00	0.02
136	002463	沪电股份	50,000	738,000.00	0.02
137	301236	软通动力	20,746	680,321.38	0.02
138	603889	新澳股份	105,000	663,600.00	0.01
139	603556	海兴电力	39,990	608,647.80	0.01
140	301177	迪阿股份	7,920	587,664.00	0.01
141	301219	腾远钴业	5,762	530,176.28	0.01

142	688295	中复神鹰	13,998	524,785.02	0.01
143	301200	大族数控	8,566	460,781.44	0.01
144	301206	三元生物	9,438	446,000.04	0.01
145	688153	唯捷创芯	7,674	391,374.00	0.01
146	688207	格灵深瞳	13,391	380,304.40	0.01
147	688279	峰昭科技	5,505	370,706.70	0.01
148	301150	中一科技	4,026	365,898.42	0.01
149	688046	药康生物	12,070	353,651.00	0.01
150	301216	万凯新材	11,195	351,287.05	0.01
151	301207	华兰疫苗	5,687	336,163.36	0.01
152	002532	天山铝业	50,000	326,500.00	0.01
153	301215	中汽股份	47,421	326,493.09	0.01
154	688238	和元生物	12,836	325,007.52	0.01
155	301109	军信股份	18,377	312,977.40	0.01
156	688320	禾川科技	6,048	312,076.80	0.01
157	688306	均普智能	47,094	260,429.82	0.01
158	688325	赛微微电	4,039	247,186.80	0.01
159	301263	泰恩康	6,813	234,514.72	0.01
160	301187	欧圣电气	8,759	228,329.22	0.01
161	301102	兆讯传媒	6,414	211,821.06	0.00
162	688209	英集芯	6,822	208,753.20	0.00
163	301256	华融化学	18,308	196,408.08	0.00
164	688206	概伦电子	6,000	182,400.00	0.00
165	301103	何氏眼科	5,065	171,479.62	0.00
166	301160	翔楼新材	3,918	166,768.58	0.00
167	301151	冠龙节能	7,025	161,883.22	0.00
168	301212	联盛化学	4,158	155,441.76	0.00
169	301248	杰创智能	4,716	153,047.20	0.00
170	688290	景业智能	3,040	142,484.80	0.00
171	301136	招标股份	7,172	141,575.28	0.00
172	301148	嘉戎技术	5,153	133,358.10	0.00
173	301258	富士莱	2,942	132,548.81	0.00
174	688150	莱特光电	5,626	125,122.24	0.00
175	301237	和顺科技	2,610	116,160.66	0.00
176	688267	中触媒	3,390	113,327.70	0.00
177	301137	哈焊华通	6,431	111,743.67	0.00
178	301288	清研环境	4,516	107,867.44	0.00
179	301163	宏德股份	2,764	101,994.08	0.00
180	301222	浙江恒威	3,315	101,431.46	0.00

181	301130	西点药业	2,370	94,254.90	0.00
182	688175	高凌信息	2,851	91,887.73	0.00
183	688163	赛伦生物	3,607	89,814.30	0.00
184	688193	仁度生物	1,635	88,453.50	0.00
185	688115	思林杰	2,153	86,636.72	0.00
186	301181	标榜股份	2,564	81,939.40	0.00
187	688102	斯瑞新材	6,030	77,847.30	0.00
188	301279	金道科技	2,956	73,863.56	0.00
189	001270	铖昌科技	568	57,481.60	0.00
190	301087	可孚医疗	1,102	46,989.28	0.00
191	301050	雷电微力	420	42,655.20	0.00
192	301090	华润材料	2,764	30,155.24	0.00
193	301089	拓新药业	220	27,636.40	0.00
194	603191	望变电气	1,149	26,197.20	0.00
195	001318	阳光乳业	1,142	25,249.62	0.00
196	301069	凯盛新材	539	24,853.29	0.00
197	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
198	603206	嘉环科技	1,210	23,353.00	0.00
199	301096	百诚医药	272	21,488.00	0.00
199	603051	鹿山新材	272	21,488.00	0.00
200	301211	亨迪药业	967	20,964.56	0.00
201	001228	永泰运	383	20,739.45	0.00
202	301060	兰卫医学	587	20,556.74	0.00
203	001308	康冠科技	667	19,456.39	0.00
204	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
205	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
206	301221	光庭信息	291	18,865.53	0.00
207	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
208	603132	金徽股份	1,342	17,325.22	0.00
209	603070	万控智造	775	16,197.50	0.00
210	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
211	001319	铭科精技	536	15,474.32	0.00
212	301166	优宁维	253	14,891.58	0.00
213	301189	奥尼电子	435	14,489.85	0.00
214	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
215	301093	华兰股份	409	13,861.01	0.00
216	301190	善水科技	575	13,644.75	0.00
217	603097	江苏华辰	577	13,617.20	0.00
218	301118	恒光股份	315	13,554.45	0.00

219	301100	风光股份	599	12,926.42	0.00
220	001266	宏英智能	247	12,298.13	0.00
221	603215	比依股份	575	12,115.25	0.00
222	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
223	301078	孩子王	756	11,082.96	0.00
224	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
225	301092	争光股份	323	10,161.58	0.00
226	603272	联翔股份	443	9,723.85	0.00
227	301048	金鹰重工	843	9,281.43	0.00
228	300774	倍杰特	444	8,951.04	0.00
229	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
230	301045	天禄科技	335	7,728.45	0.00
231	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
232	603150	万朗磁塑	250	7,442.50	0.00
233	301040	中环海陆	241	7,357.73	0.00
234	301038	深水规院	346	7,193.34	0.00
235	301182	凯旺科技	294	6,985.44	0.00
236	301027	华蓝集团	286	6,944.08	0.00
237	301066	万事利	482	6,873.32	0.00
238	301055	张小泉	355	6,311.90	0.00
239	301081	严牌股份	403	6,077.24	0.00
240	300814	中富电路	328	6,002.40	0.00
241	301083	百胜智能	416	5,807.36	0.00
242	301072	中捷精工	181	5,797.43	0.00
243	301030	仕净科技	242	5,643.44	0.00
244	301025	读客文化	403	5,311.54	0.00
245	301057	汇隆新材	218	5,308.30	0.00
246	301056	森赫股份	572	4,953.52	0.00
247	301032	新柴股份	513	4,770.90	0.00
248	301049	超越科技	196	4,647.16	0.00
249	301036	双乐股份	205	4,608.40	0.00
250	301033	迈普医学	108	4,547.88	0.00
251	301059	金三江	259	4,351.20	0.00
252	301063	海锅股份	153	4,262.58	0.00
253	301041	金百泽	215	4,237.65	0.00
254	301037	保立佳	193	4,215.12	0.00
255	300854	中兰环保	203	4,035.64	0.00
256	301068	大地海洋	144	3,477.60	0.00
257	301079	邵阳液压	140	3,472.00	0.00

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	603259	药明康德	176,702,272.60	3.50
2	002714	牧原股份	150,511,857.40	2.98
3	600975	新五丰	146,204,601.07	2.90
4	300122	智飞生物	141,892,161.50	2.81
5	600522	中天科技	136,186,358.24	2.70
6	300498	温氏股份	135,614,953.74	2.69
7	300999	金龙鱼	134,276,739.24	2.66
8	300759	康龙化成	132,455,221.29	2.62
9	688599	天合光能	131,760,543.51	2.61
10	002124	天邦食品	127,730,373.46	2.53
11	603606	东方电缆	118,770,070.70	2.35
12	300750	宁德时代	115,051,913.97	2.28
13	600754	锦江酒店	114,437,119.20	2.27
14	600138	中青旅	110,781,219.18	2.19
15	002459	晶澳科技	105,712,784.94	2.09
16	601012	隆基绿能	104,801,754.20	2.08
17	300841	康华生物	96,548,649.06	1.91
18	002531	天顺风能	90,937,385.28	1.80
19	600258	首旅酒店	88,597,947.29	1.76
20	601985	中国核电	83,644,929.94	1.66

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填写，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	688599	天合光能	310,487,465.20	6.15
2	601012	隆基绿能	282,204,010.66	5.59
3	300750	宁德时代	280,625,706.68	5.56
4	002459	晶澳科技	265,407,775.78	5.26

5	002531	天顺风能	201,347,954.88	3.99
6	600406	国电南瑞	165,463,096.66	3.28
7	002714	牧原股份	153,262,175.07	3.04
8	002487	大金重工	148,354,084.92	2.94
9	603806	福斯特	146,752,088.72	2.91
10	002594	比亚迪	142,675,038.13	2.83
11	300498	温氏股份	139,880,771.14	2.77
12	603606	东方电缆	135,171,010.49	2.68
13	300274	阳光电源	121,259,670.27	2.40
14	600522	中天科技	113,025,843.79	2.24
15	600875	东方电气	101,102,393.18	2.00
16	000400	许继电气	75,829,764.69	1.50
17	002603	以岭药业	75,079,199.40	1.49
18	603985	恒润股份	74,458,320.62	1.48
19	600975	新五丰	65,411,520.39	1.30
20	300569	天能重工	65,075,463.52	1.29

注：卖出金额按卖出成交金额（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	5,114,742,599.05
卖出股票收入（成交）总额	5,808,516,069.14

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	151,008,356.17	3.37
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,421,925.77	0.14
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	157,430,281.94	3.52

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	2220052	22 河北银行 永续债	1,000,000	98,180,821.92	2.19
2	2120064	21 恒丰银行 永续债	500,000	52,827,534.25	1.18
3	113053	隆 22 转债	46,550	6,421,925.77	0.14

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

本基金本报告期末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

本报告期本基金未进行的贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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。

7.12 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	1,391,782.09
2	应收清算款	22,030,555.45
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	247,674.34
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,670,011.88

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末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
406,979	12,506.90	19,106,676.01	0.38%	5,070,940,332.35	99.62%

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	183.01	0.00%

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2007年8月17日）基金份额总额	14,956,625,039.16
本报告期期初基金份额总额	5,157,808,452.01
本报告期基金总申购份额	37,137,467.36
减：本报告期基金总赎回份额	104,898,911.01
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	5,090,047,008.36

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

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

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

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

本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	股票交易	应支付该券商的佣金

	交易单元 数量	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	备注
长江证券	3	2,616,226,233.80	23.99%	2,436,499.38	23.99%	-
东吴证券	1	2,492,038,881.02	22.85%	2,320,839.47	22.85%	-
首创证券	2	2,057,485,644.18	18.87%	1,916,128.96	18.87%	-
东方证券	1	1,321,124,009.05	12.11%	1,230,363.28	12.11%	-
申万宏源	1	1,007,735,501.34	9.24%	938,490.11	9.24%	-
信达证券	1	1,007,491,758.39	9.24%	938,279.69	9.24%	-
海通证券	1	294,947,259.81	2.70%	274,682.69	2.70%	-
兴业证券	2	108,905,503.44	1.00%	101,423.49	1.00%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
联合证券	1	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
日信证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	3	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
高华证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
诚浩证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	3	-	-	-	-	-
中金财富证 券	2	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

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、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金退租国信证券的交易单元，退租交易单元数量为 1

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	1,786,785.00	100.00%	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
宏信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
联合证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
高华证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
诚浩证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证 券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

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	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 1 月 11 日
2	中邮核心成长混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定媒介	2022 年 1 月 24 日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加国融证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 1 月 25 日
4	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海长量基金销售有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 2 月 22 日
5	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京中植基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2022 年 3 月 4 日
6	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 3 月 8 日
7	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银国际	规定媒介	2022 年 3 月 9 日

	证券股份有限公司申购费率优惠活动的公		
8	中邮核心成长混合型证券投资基金 2021 年年度报告	规定媒介	2022 年 3 月 11 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 4 月 15 日
10	中邮核心成长混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定媒介	2022 年 4 月 22 日
11	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在西部证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 4 月 25 日
12	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在广发证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 4 月 26 日
13	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在北京微动利基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 5 月 25 日
14	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 5 月 26 日
15	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源西部证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 5 月 27 日
16	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在万家财富基金销售有限公司开通定投业务并调整其申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 5 月 31 日
17	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在和讯信息科技有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 6 月 20 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

无。

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核心成长混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮核心成长混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮核心成长混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮核心成长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规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

2022 年 8 月 31 日