

# 中邮核心主题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：招商银行股份有限公司

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。本中期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新。

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

|  |           |
|--|-----------|
| <b>§1 重要提示及目录</b> .....                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2         |
| 1.2 目录.....                                  | 3         |
| <b>§2 基金简介</b> .....                         | <b>6</b>  |
| 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.....                              | 8         |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>9</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 9         |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 9         |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>11</b> |
| 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        |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 17        |
| 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..... | 17        |
| 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        |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>18</b> |
| 6.1 资产负债表.....                               | 18        |
| 6.2 利润表.....                                 | 19        |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表.....                        | 20        |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注.....                              | 22        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>41</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 41        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 41        |
| 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.....     | 42        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 43        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 47        |
| 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.....    | 47        |
| 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..... | 47        |
| 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..... | 47        |
| 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.....    | 47        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....                   | 47        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 47        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 47        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>49</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 49        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 49        |
| 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.....     | 49        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>50</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 51        |
| 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.....      | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 51        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 51        |
| 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.....         | 51        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 51        |
| 10.8 其他重大事件.....                           | 53        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>             | <b>55</b> |
| 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.....    | 55        |

|                          |           |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 55        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>   | <b>56</b> |
| 12.1 备查文件目录.....         | 56        |
| 12.2 存放地点.....           | 56        |
| 12.3 查阅方式.....           | 56        |

## § 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 | 246,580,069.41 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 | <p>1. 大类资产配置策略</p> <p>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。</p> <p>2. 股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>(1) 主题挖掘</p> <p>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。</p> <p>(2) 主题配置</p> <p>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。</p> <p>(3) 个股选择</p> <p>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。</p> <p>备选库的构建</p> <p>在确立投资主题及投资主题配置比例之后，本基金将</p> |

|        |   |
|--------|---|
|        | <p>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。</p> <p><b>精选库的构建</b></p> <p>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。</p> <p><b>3. 债券投资策略</b></p> <p><b>(1) 平均久期配置</b></p> <p>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。</p> <p><b>(2) 期限结构配置</b></p> <p>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。</p> <p><b>(3) 类属配置</b></p> <p>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。</p> <p><b>(4) 回购套利</b></p> <p>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。</p> <p><b>4. 权证投资策略</b></p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。</p> |
| 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  |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.postfund.com.cn">http://www.postfund.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人或基金托管人的办公场所。   |

### 2.5 其他相关资料

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



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年1月1日 - 2022年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | -128,678,353.16             |
| 本期利润          | -63,266,641.47              |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.2544                     |
| 本期加权平均净值利润率   | -9.48%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | -8.79%                      |
| 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      | 441,291,697.73              |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.7896                      |
| 期末基金资产净值      | 687,871,767.14              |
| 期末基金份额净值      | 2.790                       |
| 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   | 222.41%                     |

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      | 7.10%    | 1.35%       | 7.69%      | 0.86%         | -0.59%  | 0.49% |
| 过去三个月      | 3.07%    | 1.20%       | 5.27%      | 1.15%         | -2.20%  | 0.05% |
| 过去六个月      | -8.79%   | 1.50%       | -6.88%     | 1.16%         | -1.91%  | 0.34% |
| 过去一年       | -24.27%  | 1.85%       | -10.41%    | 1.00%         | -13.86% | 0.85% |
| 过去三年       | 90.18%   | 1.77%       | 17.45%     | 1.01%         | 72.73%  | 0.76% |
| 自基金合同生效起至今 | 222.41%  | 1.65%       | 68.72%     | 1.14%         | 153.69% | 0.51% |

注：1. 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。

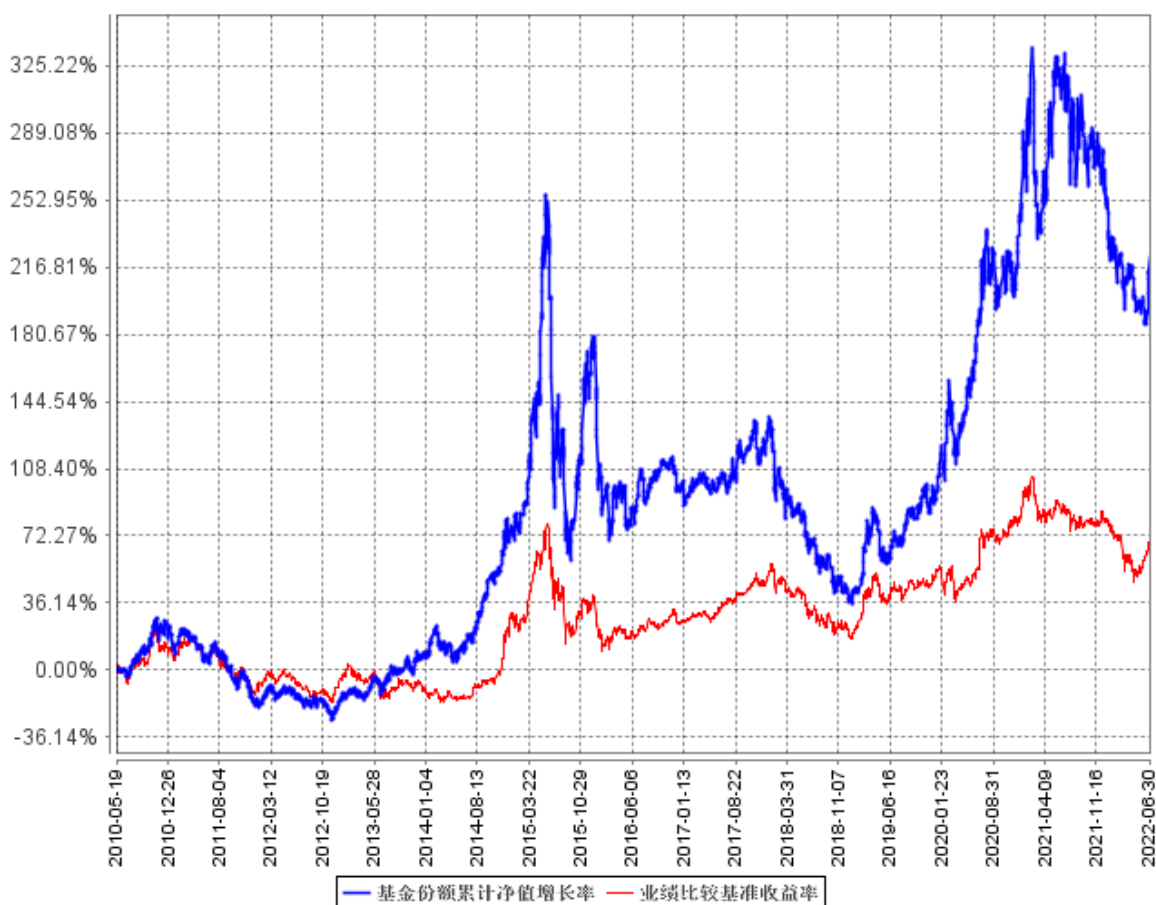
本基金业绩衡量基准=沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%

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

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 |        |   |
| 陈梁  | 基金经理   | 2015年3月13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。 |
| 马姝丽 | 基金经理助理 | 2021年6月11日      | -    | 8年     | 金融硕士，曾任中铁十六局集团有限公司财务部会计、安永会计师事务所咨询师、北京中恒嘉德资产管理有限公司投资部投资助理、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合规守信情况的说明

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

本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合有关法律法规和基金合同的规定和约定；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发生内幕交易的情况；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；基金各种账户类、申购赎回及其他交易类业务、注册登记业务均按规定的程序、规则进行，未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，基金管理人所管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，大幅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，没有及时调整仓位，仅在 6 月上旬开始，大幅加仓了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 2.790 元，累计净值为 2.950 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.79%，业绩比较基准收益率为-6.88%。

#### 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”，重点投资于大消费和大健康赛道。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

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。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中邮核心主题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<br>2022 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 73,281,274.69                  | 39,916,319.25                    |
| 结算备付金         |            | 207,955.22                     | 3,160,176.00                     |
| 存出保证金         |            | 309,707.62                     | 627,470.30                       |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 632,989,984.16                 | 639,759,093.62                   |
| 其中：股票投资       |            | 632,989,984.16                 | 635,709,159.62                   |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | -                              | 4,049,934.00                     |
| 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         |            | -                              | 11,829,456.88                    |
| 应收股利          |            | -                              | -                                |
| 应收申购款         |            | 138,936.17                     | 159,979.49                       |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | 21,361.97                        |
| 资产总计          |            | 706,927,857.86                 | 695,473,857.51                   |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2022 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>    |            |                                |                                  |
| 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         |            | 15,282,148.86                  | -                                |

|             |          |                |                |
|-------------|----------|----------------|----------------|
| 应付赎回款       |          | 78,257.17      | 775,804.38     |
| 应付管理人报酬     |          | 785,563.46     | 960,505.99     |
| 应付托管费       |          | 130,927.24     | 160,084.33     |
| 应付销售服务费     |          | -              | -              |
| 应付投资顾问费     |          | -              | -              |
| 应交税费        |          | -              | 15.27          |
| 应付利润        |          | -              | -              |
| 递延所得税负债     |          | -              | -              |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 2,779,193.99   | 2,046,249.44   |
| 负债合计        |          | 19,056,090.72  | 3,942,659.41   |
| <b>净资产：</b> |          |                |                |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 246,580,069.41 | 226,054,183.57 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -              | -              |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | 441,291,697.73 | 465,477,014.53 |
| 净资产合计       |          | 687,871,767.14 | 691,531,198.10 |
| 负债和净资产总计    |          | 706,927,857.86 | 695,473,857.51 |

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 2.790 元，基金份额总额 246,580,069.41 份。

## 6.2 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：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<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | -57,328,869.14                           | 165,376,789.76                                |
| 1.利息收入           |          | 1,137,490.98                             | 907,672.90                                    |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.13 | 1,137,490.98                             | 907,672.90                                    |
| 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） |          | -123,901,376.40                          | 245,579,786.18                                |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.14 | -125,696,219.11                          | 244,424,189.71                                |
| 基金投资收益           |          | -  | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.15 | 524,356.42                               | -   |
| 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 | 1,270,486.29                             | 1,155,596.47                                  |
| 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   | 65,411,711.69  | -81,279,463.09 |
| 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   | 23,304.59      | 168,793.77     |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 5,937,772.33   | 12,259,680.22  |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 4,980,058.76   | 6,061,575.27   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 830,009.75     | 1,010,262.57   |
| 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                   |            | 4.98           | -              |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 127,698.84     | 5,187,842.38   |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -63,266,641.47 | 153,117,109.54 |
| 减：所得税费用                    |            | -              | -              |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -63,266,641.47 | 153,117,109.54 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -              | -              |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -63,266,641.47 | 153,117,109.54 |

### 6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>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） | 226,054,183.57                        | -      | 465,477,014.53 | 691,531,198.10 |
| 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） | 226,054,183.57                        | -      | 465,477,014.53 | 691,531,198.10 |

|  |                                 |        |                 |                 |
|--|---------------------------------|--------|-----------------|-----------------|
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | 20,525,885.84                   | -      | -24,185,316.80  | -3,659,430.96   |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | -63,266,641.47  | -63,266,641.47  |
| (二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>(净值减少以“-”号填列)  | 20,525,885.84                   | -      | 39,081,324.67   | 59,607,210.51   |
| 其中: 1.基金申购款                              | 39,379,195.57                   | -      | 70,230,427.01   | 109,609,622.58  |
| 2.基金赎回款                                  | -18,853,309.73                  | -      | -31,149,102.34  | -50,002,412.07  |
| (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)                          | 246,580,069.41                  | -      | 441,291,697.73  | 687,871,767.14  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<br>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)                          | 284,386,007.83                  | -      | 592,515,800.73  | 876,901,808.56  |
| 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)                          | 284,386,007.83                  | -      | 592,515,800.73  | 876,901,808.56  |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)                     | -55,817,754.49                  | -      | 20,904,761.02   | -34,912,993.47  |
| (一)、综合收益总额                               | -                               | -      | 153,117,109.54  | 153,117,109.54  |
| (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)      | -55,817,754.49                  | -      | -132,212,348.52 | -188,030,103.01 |
| 其中: 1.基金申购款                              | 41,296,640.81                   | -      | 98,339,456.60   | 139,636,097.41  |
| 2.基金赎回款                                  | -97,114,395.30                  | -      | -230,551,805.12 | -327,666,200.42 |
| (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<br>结转留存收益 | -              | - | -              | -              |
| 四、本期期末净资产(基金净值)      | 228,568,253.34 | - | 613,420,561.75 | 841,988,815.09 |

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  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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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、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比例目标为：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”。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）和中国证券业协会颁布的《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

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

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计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 21,361.97 元，全部调整至相关金融资产的账面价值中，其中 15,923.49 元重分类至银行存款，1,564.31 元重分类至结算备付金，310.64 元重分类至存出保证金，2,118.48 元重分类至交易性金融资产-债券投资，1,445.05 元重分类至应收申购款，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 39,916,319.25 元，调整后账面金额为 39,932,242.74 元；结算备付金调整前账面金额为 3,160,176.00 元，调整后账面金额为 3,161,740.31 元；存出保证金调整前账面金额为 627,470.30 元，调整后账面金额为 627,780.94 元；交易性金融资产调整前账面金额为 639,759,093.62 元，调整后账面金额为 639,761,212.10 元；应收申购款调整前账面金额为 159,979.49 元，调整后账面金额为 161,424.54 元。

应付交易费用调整前账面金额为 1,625,018.63 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 421,230.81 元，调整后账面金额为 2,046,249.44 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

无。



## 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[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。

## 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<br>2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 73,281,274.69          |
| 等于：本金          | 73,251,310.19          |
| 加：应计利息         | 29,964.50              |
| 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：            | 73,281,274.69          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 |      |                |               |
|---------------|------------------------|------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 558,770,880.97         | -    | 632,989,984.16 | 74,219,103.19 |
| 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     | 558,770,880.97 | - | 632,989,984.16 | 74,219,103.19 |   |

#### 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

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

本基金本期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本期末无其他权益工具投资。

#### 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       | 231.59          |
| 应付证券出借违约金   | -               |
| 应付交易费用      | 2,249,866.46    |
| 其中：交易所市场    | 2,249,866.46    |
| 银行间市场       | -               |
| -           | -               |
| 应付利息        | -               |
| 预提费用        | 529,095.94      |
| 合计          | 2,779,193.99    |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 226,054,183.57                        | 226,054,183.57 |
| 本期申购          | 39,379,195.57                         | 39,379,195.57  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -18,853,309.73                        | -18,853,309.73 |
| - 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           | 246,580,069.41                        | 246,580,069.41 |

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本报告期内本基金无其他综合收益。

#### 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           | 567,321,943.11  | -101,844,928.58 | 465,477,014.53 |
| 本期利润           | -128,678,353.16 | 65,411,711.69   | -63,266,641.47 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 53,193,830.15   | -14,112,505.48  | 39,081,324.67  |
| 其中：基金申购款       | 93,410,041.60   | -23,179,614.59  | 70,230,427.01  |
| 基金赎回款          | -40,216,211.45  | 9,067,109.11    | -31,149,102.34 |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -              |

|     |                |                |                |
|-----|----------------|----------------|----------------|
| 本期末 | 491,837,420.10 | -50,545,722.37 | 441,291,697.73 |
|-----|----------------|----------------|----------------|

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 1,102,520.93               |
| 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 | 18,656.29                  |
| 其他        | 16,313.76                  |
| 合计        | 1,137,490.98               |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 2,350,978,678.16           |
| 减：卖出股票成本总额 | 2,469,499,423.60           |
| 减：交易费用     | 7,175,473.67               |
| 买卖股票差价收入   | -125,696,219.11            |

#### 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入                  | 1,363.62                   |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 522,992.80                 |
| 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                            | 524,356.42                 |

## 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<br>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   | 3,018,519.30               |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 2,492,000.00               |
| 减：应计利息总额                | 3,523.62                   |
| 减：交易费用                  | 2.88                       |
| 买卖债券差价收入                | 522,992.80                 |

## 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收益。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

## 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<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,270,486.29               |
| 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            | 1,270,486.29               |

## 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                 | 65,411,711.69                   |
| ——股票投资                     | 67,176,645.69                   |
| ——债券投资                     | -1,764,934.00                   |
| ——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<br>增值税 | -                               |
| 合计                         | 65,411,711.69                   |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 23,304.59                             |
| 合计      | 23,304.59                             |

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。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本报告期本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 49,588.57                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 银行结算费   | 9,002.90                              |

|            |            |
|------------|------------|
| 上清所债券账户维护费 | 9,000.00   |
| 其他         | 600.00     |
| 合计         | 127,698.84 |

#### 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 |
| 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       |

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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。

##### 6.4.10.1 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。

##### 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<br>2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月<br>30 日 | 上年度可比期间<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|--|--|
| 当期发生的基金应支付 | 4,980,058.76                             | 6,061,575.27                               |



|                 |              |              |
|-----------------|--------------|--------------|
| 的管理费            |              |              |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,756,078.95 | 2,442,521.69 |

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：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

#### 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 | 830,009.75           | 1,010,262.57         |

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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 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

本报告期及上年度可比期间无转融通证券出借业务发生重大关联交易事项。

#### 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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

本报告期及上年度可比期间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 |
|       |                      |        |                      |        |

|            |                  |                 |                   |              |
|------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------|
| 招商银行股份有限公司 | 73, 281, 274. 69 | 1, 102, 520. 93 | 248, 733, 285. 81 | 886, 448. 26 |
|------------|------------------|-----------------|-------------------|--------------|

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

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 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

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 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。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定

的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险限度，及时对各种风险进行监督、分析和评估，并制定应对措施，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 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<br>2022年6月30日 | 上年度末<br>2021年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | -                 | -                   |
| AAA 以下 | -                 | 4,049,934.00        |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | -                 | 4,049,934.00        |

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 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<br>2022 年 6 月<br>30 日 | 1 年以内         | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计            |
|---------------------------|---------------|-------|-------|-----|---------------|
| 资产                        |               |       |       |     |               |
| 银行存款                      | 73,281,274.69 | -     | -     | -   | 73,281,274.69 |

|                     |               |      |               |                 |                |
|---------------------|---------------|------|---------------|-----------------|----------------|
| 结算备付金               | 207,955.22    | -    | -             | -               | 207,955.22     |
| 存出保证金               | 309,707.62    | -    | -             | -               | 309,707.62     |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -             | -632,989,984.16 | 632,989,984.16 |
| 应收申购款               | -             | -    | -             | 138,936.17      | 138,936.17     |
| 其他资产                | -             | -    | -             | -               | -              |
| 资产总计                | 73,798,937.53 | -    | -             | -633,128,920.33 | 706,927,857.86 |
| 负债                  |               |      |               |                 |                |
| 应付清算款               | -             | -    | -             | 15,282,148.86   | 15,282,148.86  |
| 应付赎回款               | -             | -    | -             | 78,257.17       | 78,257.17      |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -             | 785,563.46      | 785,563.46     |
| 应付托管费               | -             | -    | -             | 130,927.24      | 130,927.24     |
| 其他负债                | -             | -    | -             | 2,779,193.99    | 2,779,193.99   |
| 负债总计                | -             | -    | -             | 19,056,090.72   | 19,056,090.72  |
| 利率敏感度缺口             | 73,798,937.53 | -    | -             | -614,072,829.61 | 687,871,767.14 |
| 上年度末<br>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                | 39,916,319.25 | -    | -             | -               | 39,916,319.25  |
| 结算备付金               | 3,160,176.00  | -    | -             | -               | 3,160,176.00   |
| 存出保证金               | 627,470.30    | -    | -             | -               | 627,470.30     |
| 交易性金融资产             | -             | -    | -4,049,934.00 | 635,709,159.62  | 639,759,093.62 |
| 应收证券清算款             | -             | -    | -             | 11,829,456.88   | 11,829,456.88  |
| 其他资产                | -             | -    | -             | 21,361.97       | 21,361.97      |
| 应收申购款               | -             | -    | -             | 159,979.49      | 159,979.49     |
| 资产总计                | 43,703,965.55 | -    | -4,049,934.00 | 647,719,957.96  | 695,473,857.51 |
| 负债                  |               |      |               |                 |                |
| 应付赎回款               | -             | -    | -             | 775,804.38      | 775,804.38     |
| 应付管理人报酬             | -             | -    | -             | 960,505.99      | 960,505.99     |
| 应付托管费               | -             | -    | -             | 160,084.33      | 160,084.33     |
| 应交税费                | -             | -    | -             | 15.27           | 15.27          |
| 其他负债                | -             | -    | -             | 2,046,249.44    | 2,046,249.44   |
| 负债总计                | -             | -    | -             | 3,942,659.41    | 3,942,659.41   |
| 利率敏感度缺口             | 43,703,965.55 | -    | -4,049,934.00 | 643,777,298.55  | 691,531,198.10 |

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 | 1. 市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变 |                                 |                        |
|    | 2. 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<br>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                  | -                               | -59,139.75             |
|    | 2. 基金净资产变动                  | -                               | 61,264.64              |

#### 6.4.13.4.2 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 2022 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2022 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>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  | 632,989,984.16 | 92.02         | 635,709,159.62 | 91.93         |
| 交易性金融资产-基金投资  | -              | -             | -              | -             |
| 交易性金融资产-债券投资  | -              | -             | 4,049,934.00   | 0.59          |
| 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            | 632,989,984.16 | 92.02         | 639,759,093.62 | 92.51         |

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1% |                             |                   |
|----|-------------------------|-----------------------------|-------------------|
|    | 2. 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1% |                             |                   |
| 分析 | 相关风险变量的变动               | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                   |
|    |                         | 本期末（2022年6月30日）             | 上年度末（2021年12月31日） |
|    | 1. 基金净资产变动              | 5,192,762.87                | 9,185,126.56      |
|    | 2. 基金净资产变动              | -5,192,762.87               | -9,185,126.56     |

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 0.82。

#### 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 | 上年度末 |
|---------------|-----|------|
|---------------|-----|------|

|      | 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 12 月 31 日 |
|------|-----------------|------------------|
| 第一层次 | 632,989,984.16  | 638,275,613.46   |
| 第二层次 | -               | -                |
| 第三层次 | -               | 1,483,480.16     |
| 合计   | 632,989,984.16  | 639,759,093.62   |

#### 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              | 632,989,984.16 | 89.54         |
|    | 其中：股票             | 632,989,984.16 | 89.54         |
| 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      | 73,489,229.91  | 10.40         |
| 8  | 其他各项资产            | 448,643.79     | 0.06          |
| 9  | 合计                | 706,927,857.86 | 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         | -              | -             |
| B  | 采矿业              | -              | -             |
| C  | 制造业              | 320,309,701.58 | 46.57         |
| 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           | -              | -             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 14,236,200.00  | 2.07          |
| H  | 住宿和餐饮业           | 104,304,000.00 | 15.16         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | -              | -             |
| J  | 金融业              | 14,224,000.00  | 2.07          |
| K  | 房地产业             | -              | -             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 34,803,000.00  | 5.06          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 116,027,682.58 | 16.87         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 11,177,400.00  | 1.62          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 17,908,000.00  | 2.60  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | -              | -     |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 632,989,984.16 | 92.02 |

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沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）     | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 301073 | 君亭酒店 | 600,000   | 41,604,000.00 | 6.05         |
| 2  | 600138 | 中青旅  | 2,700,000 | 34,803,000.00 | 5.06         |
| 3  | 300999 | 金龙鱼  | 630,097   | 34,037,839.94 | 4.95         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 16,010    | 32,740,450.00 | 4.76         |
| 5  | 002852 | 道道全  | 2,500,068 | 32,250,877.20 | 4.69         |
| 6  | 300122 | 智飞生物 | 275,000   | 30,527,750.00 | 4.44         |
| 7  | 300759 | 康龙化成 | 320,050   | 30,475,161.00 | 4.43         |
| 8  | 600754 | 锦江酒店 | 480,000   | 30,192,000.00 | 4.39         |
| 9  | 002791 | 坚朗五金 | 225,000   | 29,187,000.00 | 4.24         |
| 10 | 603259 | 药明康德 | 270,000   | 28,077,300.00 | 4.08         |
| 11 | 688202 | 美迪西  | 65,053    | 22,092,649.33 | 3.21         |
| 12 | 600258 | 首旅酒店 | 860,000   | 21,328,000.00 | 3.10         |
| 13 | 688677 | 海泰新光 | 225,079   | 20,705,017.21 | 3.01         |
| 14 | 603392 | 万泰生物 | 120,000   | 18,636,000.00 | 2.71         |
| 15 | 300347 | 泰格医药 | 160,005   | 18,312,572.25 | 2.66         |
| 16 | 300015 | 爱尔眼科 | 400,000   | 17,908,000.00 | 2.60         |
| 17 | 600436 | 片仔癀  | 48,000    | 17,123,040.00 | 2.49         |
| 18 | 603127 | 昭衍新药 | 150,000   | 17,070,000.00 | 2.48         |
| 19 | 300737 | 科顺股份 | 1,200,000 | 15,816,000.00 | 2.30         |
| 20 | 300896 | 爱美客  | 24,000    | 14,400,240.00 | 2.09         |
| 21 | 300059 | 东方财富 | 560,000   | 14,224,000.00 | 2.07         |
| 22 | 300026 | 红日药业 | 1,800,000 | 13,860,000.00 | 2.01         |
| 23 | 002603 | 以岭药业 | 540,000   | 13,122,000.00 | 1.91         |
| 24 | 601007 | 金陵饭店 | 1,000,000 | 11,180,000.00 | 1.63         |

|    |        |      |         |               |      |
|----|--------|------|---------|---------------|------|
| 25 | 603136 | 天目湖  | 390,000 | 11,177,400.00 | 1.62 |
| 26 | 600004 | 白云机场 | 720,000 | 10,735,200.00 | 1.56 |
| 27 | 300573 | 兴齐眼药 | 56,000  | 8,585,920.00  | 1.25 |
| 28 | 300841 | 康华生物 | 69,000  | 7,965,360.00  | 1.16 |
| 29 | 688356 | 键凯科技 | 32,000  | 7,737,920.00  | 1.12 |
| 30 | 300357 | 我武生物 | 130,000 | 6,763,900.00  | 0.98 |
| 31 | 600702 | 舍得酒业 | 32,000  | 6,527,680.00  | 0.95 |
| 32 | 688690 | 纳微科技 | 80,083  | 6,471,507.23  | 0.94 |
| 33 | 601567 | 三星医疗 | 290,000 | 3,851,200.00  | 0.56 |
| 34 | 601021 | 春秋航空 | 60,000  | 3,501,000.00  | 0.51 |

## 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  | 601939 | 建设银行 | 65,978,413.00 | 9.54            |
| 2  | 601398 | 工商银行 | 64,965,921.00 | 9.39            |
| 3  | 603259 | 药明康德 | 61,730,039.10 | 8.93            |
| 4  | 300498 | 温氏股份 | 59,804,668.52 | 8.65            |
| 5  | 601012 | 隆基绿能 | 54,870,470.65 | 7.93            |
| 6  | 600522 | 中天科技 | 47,912,346.23 | 6.93            |
| 7  | 002603 | 以岭药业 | 47,765,427.93 | 6.91            |
| 8  | 601877 | 正泰电器 | 46,228,229.82 | 6.68            |
| 9  | 688223 | 晶科能源 | 45,100,968.69 | 6.52            |
| 10 | 603606 | 东方电缆 | 44,181,150.78 | 6.39            |
| 11 | 002714 | 牧原股份 | 42,757,629.65 | 6.18            |
| 12 | 601985 | 中国核电 | 40,180,958.11 | 5.81            |
| 13 | 600138 | 中青旅  | 38,600,652.77 | 5.58            |
| 14 | 002124 | 天邦食品 | 37,171,399.60 | 5.38            |
| 15 | 600975 | 新五丰  | 34,173,205.10 | 4.94            |
| 16 | 002459 | 晶澳科技 | 33,015,842.14 | 4.77            |
| 17 | 300999 | 金龙鱼  | 32,949,518.71 | 4.76            |
| 18 | 601888 | 中国中免 | 32,884,013.89 | 4.76            |
| 19 | 600900 | 长江电力 | 32,033,631.18 | 4.63            |
| 20 | 688599 | 天合光能 | 31,596,286.06 | 4.57            |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 21 | 603363 | 傲农生物 | 30,942,394.30 | 4.47 |
| 22 | 600519 | 贵州茅台 | 30,883,384.00 | 4.47 |
| 23 | 300750 | 宁德时代 | 30,744,286.00 | 4.45 |
| 24 | 600129 | 太极集团 | 30,714,478.25 | 4.44 |
| 25 | 002487 | 大金重工 | 30,660,316.00 | 4.43 |
| 26 | 301073 | 君亭酒店 | 30,161,489.56 | 4.36 |
| 27 | 300841 | 康华生物 | 30,108,894.06 | 4.35 |
| 28 | 600754 | 锦江酒店 | 28,952,444.27 | 4.19 |
| 29 | 002852 | 道道全  | 28,881,594.38 | 4.18 |
| 30 | 300759 | 康龙化成 | 27,746,390.69 | 4.01 |
| 31 | 300122 | 智飞生物 | 27,363,193.64 | 3.96 |
| 32 | 002791 | 坚朗五金 | 25,830,798.05 | 3.74 |
| 33 | 601288 | 农业银行 | 25,200,000.00 | 3.64 |
| 34 | 603063 | 禾望电气 | 23,691,763.00 | 3.43 |
| 35 | 600258 | 首旅酒店 | 21,865,709.26 | 3.16 |
| 36 | 002873 | 新天药业 | 21,691,206.75 | 3.14 |
| 37 | 002594 | 比亚迪  | 20,804,724.00 | 3.01 |
| 38 | 600973 | 宝胜股份 | 20,425,939.08 | 2.95 |
| 39 | 603806 | 福斯特  | 20,400,321.20 | 2.95 |
| 40 | 603657 | 春光科技 | 20,400,214.20 | 2.95 |
| 41 | 601816 | 京沪高铁 | 20,280,151.31 | 2.93 |
| 42 | 000895 | 双汇发展 | 20,260,323.42 | 2.93 |
| 43 | 688677 | 海泰新光 | 20,093,895.53 | 2.91 |
| 44 | 601689 | 拓普集团 | 20,092,904.30 | 2.91 |
| 45 | 600976 | 健民集团 | 19,948,974.00 | 2.88 |
| 46 | 300569 | 天能重工 | 18,324,841.92 | 2.65 |
| 47 | 300181 | 佐力药业 | 18,033,104.00 | 2.61 |
| 48 | 603136 | 天目湖  | 17,940,771.78 | 2.59 |
| 49 | 688202 | 美迪西  | 17,866,741.40 | 2.58 |
| 50 | 603392 | 万泰生物 | 17,814,905.00 | 2.58 |
| 51 | 001205 | 盛航股份 | 17,696,528.00 | 2.56 |
| 52 | 603127 | 昭衍新药 | 17,180,045.50 | 2.48 |
| 53 | 601166 | 兴业银行 | 17,086,787.70 | 2.47 |
| 54 | 000001 | 平安银行 | 17,030,275.00 | 2.46 |
| 55 | 300015 | 爱尔眼科 | 16,870,996.14 | 2.44 |
| 56 | 002812 | 恩捷股份 | 16,833,767.00 | 2.43 |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 57 | 300059 | 东方财富 | 16,582,916.11 | 2.40 |
| 58 | 600436 | 片仔癀  | 16,336,278.04 | 2.36 |
| 59 | 300737 | 科顺股份 | 15,712,373.80 | 2.27 |
| 60 | 002567 | 唐人神  | 15,587,439.00 | 2.25 |
| 61 | 300347 | 泰格医药 | 15,193,492.05 | 2.20 |
| 62 | 300363 | 博腾股份 | 14,066,029.00 | 2.03 |
| 63 | 600582 | 天地科技 | 14,016,077.08 | 2.03 |
| 64 | 603456 | 九洲药业 | 13,972,318.28 | 2.02 |
| 65 | 601717 | 郑煤机  | 13,874,659.00 | 2.01 |

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 601939 | 建设银行 | 65,394,085.00 | 9.46           |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 65,164,083.00 | 9.42           |
| 3  | 601398 | 工商银行 | 64,968,136.00 | 9.39           |
| 4  | 688599 | 天合光能 | 63,574,947.80 | 9.19           |
| 5  | 002714 | 牧原股份 | 62,579,102.18 | 9.05           |
| 6  | 002487 | 大金重工 | 59,964,478.00 | 8.67           |
| 7  | 002459 | 晶澳科技 | 57,924,900.46 | 8.38           |
| 8  | 300498 | 温氏股份 | 57,021,898.11 | 8.25           |
| 9  | 002594 | 比亚迪  | 52,310,861.73 | 7.56           |
| 10 | 603606 | 东方电缆 | 51,111,508.88 | 7.39           |
| 11 | 601012 | 隆基绿能 | 50,935,517.43 | 7.37           |
| 12 | 601689 | 拓普集团 | 47,851,153.40 | 6.92           |
| 13 | 688223 | 晶科能源 | 46,713,542.88 | 6.76           |
| 14 | 600522 | 中天科技 | 43,261,769.25 | 6.26           |
| 15 | 601877 | 正泰电器 | 41,024,930.21 | 5.93           |
| 16 | 002603 | 以岭药业 | 40,170,877.80 | 5.81           |
| 17 | 002124 | 天邦食品 | 39,792,097.37 | 5.75           |
| 18 | 600975 | 新五丰  | 38,379,917.03 | 5.55           |
| 19 | 601985 | 中国核电 | 38,331,375.00 | 5.54           |
| 20 | 603259 | 药明康德 | 35,706,622.33 | 5.16           |
| 21 | 603363 | 傲农生物 | 34,404,158.76 | 4.98           |
| 22 | 600129 | 太极集团 | 33,253,887.00 | 4.81           |
| 23 | 600406 | 国电南瑞 | 33,241,715.40 | 4.81           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 24 | 002531 | 天顺风能 | 33,193,080.00 | 4.80 |
| 25 | 600900 | 长江电力 | 33,084,324.34 | 4.78 |
| 26 | 601888 | 中国中免 | 32,222,444.44 | 4.66 |
| 27 | 600188 | 兖矿能源 | 30,457,432.24 | 4.40 |
| 28 | 000998 | 隆平高科 | 29,750,597.70 | 4.30 |
| 29 | 002385 | 大北农  | 29,024,439.56 | 4.20 |
| 30 | 300274 | 阳光电源 | 29,016,700.78 | 4.20 |
| 31 | 600875 | 东方电气 | 25,649,248.00 | 3.71 |
| 32 | 605117 | 德业股份 | 25,539,401.55 | 3.69 |
| 33 | 601288 | 农业银行 | 25,368,000.00 | 3.67 |
| 34 | 603063 | 禾望电气 | 24,566,813.00 | 3.55 |
| 35 | 002873 | 新天药业 | 23,266,855.61 | 3.36 |
| 36 | 603596 | 伯特利  | 23,234,412.00 | 3.36 |
| 37 | 300841 | 康华生物 | 21,593,963.50 | 3.12 |
| 38 | 001215 | 千味央厨 | 20,840,444.48 | 3.01 |
| 39 | 001205 | 盛航股份 | 20,274,408.92 | 2.93 |
| 40 | 301073 | 君亭酒店 | 20,019,596.19 | 2.89 |
| 41 | 600973 | 宝胜股份 | 19,553,947.00 | 2.83 |
| 42 | 300443 | 金雷股份 | 19,439,777.00 | 2.81 |
| 43 | 603806 | 福斯特  | 19,284,754.96 | 2.79 |
| 44 | 601816 | 京沪高铁 | 19,183,476.56 | 2.77 |
| 45 | 000400 | 许继电气 | 18,970,543.00 | 2.74 |
| 46 | 000895 | 双汇发展 | 17,886,759.55 | 2.59 |
| 47 | 603035 | 常熟汽饰 | 17,700,698.00 | 2.56 |
| 48 | 603985 | 恒润股份 | 17,405,568.00 | 2.52 |
| 49 | 300181 | 佐力药业 | 17,341,693.00 | 2.51 |
| 50 | 300569 | 天能重工 | 17,191,639.49 | 2.49 |
| 51 | 603657 | 春光科技 | 17,042,326.00 | 2.46 |
| 52 | 600976 | 健民集团 | 16,894,220.00 | 2.44 |
| 53 | 002812 | 恩捷股份 | 16,791,297.20 | 2.43 |
| 54 | 002567 | 唐人神  | 15,854,652.00 | 2.29 |
| 55 | 601166 | 兴业银行 | 14,875,258.34 | 2.15 |
| 56 | 603456 | 九洲药业 | 14,606,950.00 | 2.11 |
| 57 | 300363 | 博腾股份 | 14,540,809.00 | 2.10 |
| 58 | 000001 | 平安银行 | 14,400,975.00 | 2.08 |

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                  |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 2,399,603,602.45 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 2,350,978,678.16 |

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 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

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内收到公开谴责、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股库之内股票。

### 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 | 309,707.62 |
| 2  | 应收清算款 | -          |
| 3  | 应收股利  | -          |
| 4  | 应收利息  | -          |
| 5  | 应收申购款 | 138,936.17 |
| 6  | 其他应收款 | -          |
| 7  | 待摊费用  | -          |
| 8  | 其他    | -          |
| 9  | 合计    | 448,643.79 |

### 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<br>(户) | 户均持有的<br>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<br>额比例 | 持有份额           | 占总份<br>额比例 |
| 29,058       | 8,485.79      | 41,442,502.62 | 16.81%     | 205,137,566.79 | 83.19%     |

### 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 | 1,072.62  | 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（ 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                     | 226,054,183.57   |
| 本报告期基金总申购份额                      | 39,379,195.57    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                    | 18,853,309.73    |
| 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                     | 246,580,069.41   |

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

本基金管理人、托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

### 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 | 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 | 4      | 1,903,960,325.68 | 40.08%       | 1,773,162.62 | 40.08%     | -  |
| 国盛证券 | 2      | 1,526,675,136.14 | 32.14%       | 1,421,778.45 | 32.14%     | -  |
| 申万宏源 | 1      | 1,319,946,818.79 | 27.78%       | 1,229,263.91 | 27.78%     | -  |
| 华创证券 | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 东莞证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 长城证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 湘财证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 安信证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 中信证券 | 1      | -                | -            | -            | -          | -  |

|            |   |   |   |   |   |   |
|------------|---|---|---|---|---|---|
| 瑞银证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券       | 1 | - | - | - | - | - |
| 中金财富证<br>券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 首创证券       | 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       | 246,015.40   | 8.15%        | -      | -              | -    | -            |
| 申万宏源       | 2,772,503.90 | 91.85%       | -      | -              | -    | -            |
| 华创证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 东莞证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 长城证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 湘财证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 安信证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 瑞银证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 海通证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中金财富证<br>券 | -            | -            | -      | -              | -    | -            |
| 首创证券       | -            | -            | -      | -              | -    | -            |

注：1、选择专用交易单元的标准和程序：

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

(2) 券商经纪人具有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据中邮创业基金管理股份有限公司所管理基金的特定要求，提供研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

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

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

2、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金不存在交易单元退租情况。

## 10.8 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  | 中邮核心主题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证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告        | 规定媒介   | 2022年3月9日  |
| 8  | 中邮核心主题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 | 中邮核心主题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 |
| 18 | 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首创证券股份有限公司申购及定投起点金额的公告           | 规定媒介 | 2022 年 6 月 22 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