

# 中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

中邮健康文娱混合型证券投资基金-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。

基金托管人交通银行股份有限公司（简称：交通银行）根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 28 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 2020 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.....	9
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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的真实、准确和完整发表意见.....	16
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>17</b>
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44
7.12 市场中性策略执行情况.....	错误！未定义书签。
7.13 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	45
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.....	45
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>47</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	47
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.8 其他重大事件.....	48

---

<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>51</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 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮健康文娱灵活配置混合
基金主代码	004890
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 13 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	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	33,922,064.14 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将精选受益于健康文娱主题的相关证券，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>（一）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。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>（二）股票资产配置策略</p> <p>1、健康文娱主题的界定</p> <p>随着我国人口结构的变化、城镇化进程的推进以及国民收入水平的不断提升，国民对于健康水平和生活品质的要求日益增强。本基金的健康文娱主题包含健康和娱乐两个层面的内容，是由与国民身心健康水平提升直接或间接相关的行业及公司组成。未来随着国民需求的变化和行业发展趋势的变化，如果基金管理人认为对“健康文娱”主题有更适当的界定方法，基金管理人有权对该界定方法进行变更，并适时调整“健康文娱”主题所覆盖的投资范围。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，从行业对上述因素变化的敏感程度和受益程度入手，筛选处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。</p> <p>3、个股投资策略</p> <p>本基金管理人通过定量及定性分析，筛选出健康文娱</p>

领域的优质上市公司进行投资。

### （三）债券投资策略

#### 1、平均久期配置

本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。当预期市场利率上升时，本基金将缩短债券投资组合久期，以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时，本基金将拉长债券投资组合久期，以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。

#### 2、期限结构配置

结合对宏观经济形势和政策的判断，运用统计和数量分析技术，本基金对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析，预测收益率曲线的变化趋势，制定组合的期限结构配置策略。在预期收益率曲线趋向平坦化时，本基金将采取哑铃型策略，重点配置收益率曲线的两端。当预期收益率曲线趋向陡峭化时，采取子弹型策略，重点配置收益率曲线的中部。当预期收益率曲线不变或平行移动时，则采取梯形策略，债券投资资产在各期限间平均配置。

#### 3、类属配置

本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。根据中国债券市场存在市场分割的特点，本基金将考察相同债券在交易所市场和银行间市场的利差情况，结合流动性等因素的分析，选择具有更高投资价值的市场进行配置。

#### 4、回购套利

本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内，适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率，比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险的套利操作。

#### 5、中小企业私募债投资策略

中小企业私募债是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。与传统的信用债相比，中小企业私募债具有高风险和高收益的显著特点。

#### 6、资产支持证券投资策略

本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动

	<p>性风险。</p> <p>(四) 权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。</p> <p>(五) 股指期货投资策略</p> <p>本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。</p>
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准构成为：沪深 300 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	陆志俊
	联系电话	010-82295160—157	95559
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		010—58511618	95559
传真		010-82295155	021-62701216
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		100013	200336
法定代表人		曹均	任德奇

### 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	www.postfund.com.cn
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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	-2,393,066.75
本期利润	5,677,215.26
加权平均基金份额本期利润	0.1623
本期加权平均净值利润率	11.17%
本期基金份额净值增长率	40.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	14,064,089.25
期末可供分配基金份额利润	0.4146
期末基金资产净值	57,583,078.69
期末基金份额净值	1.6975
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	69.75%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当前发生额）。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

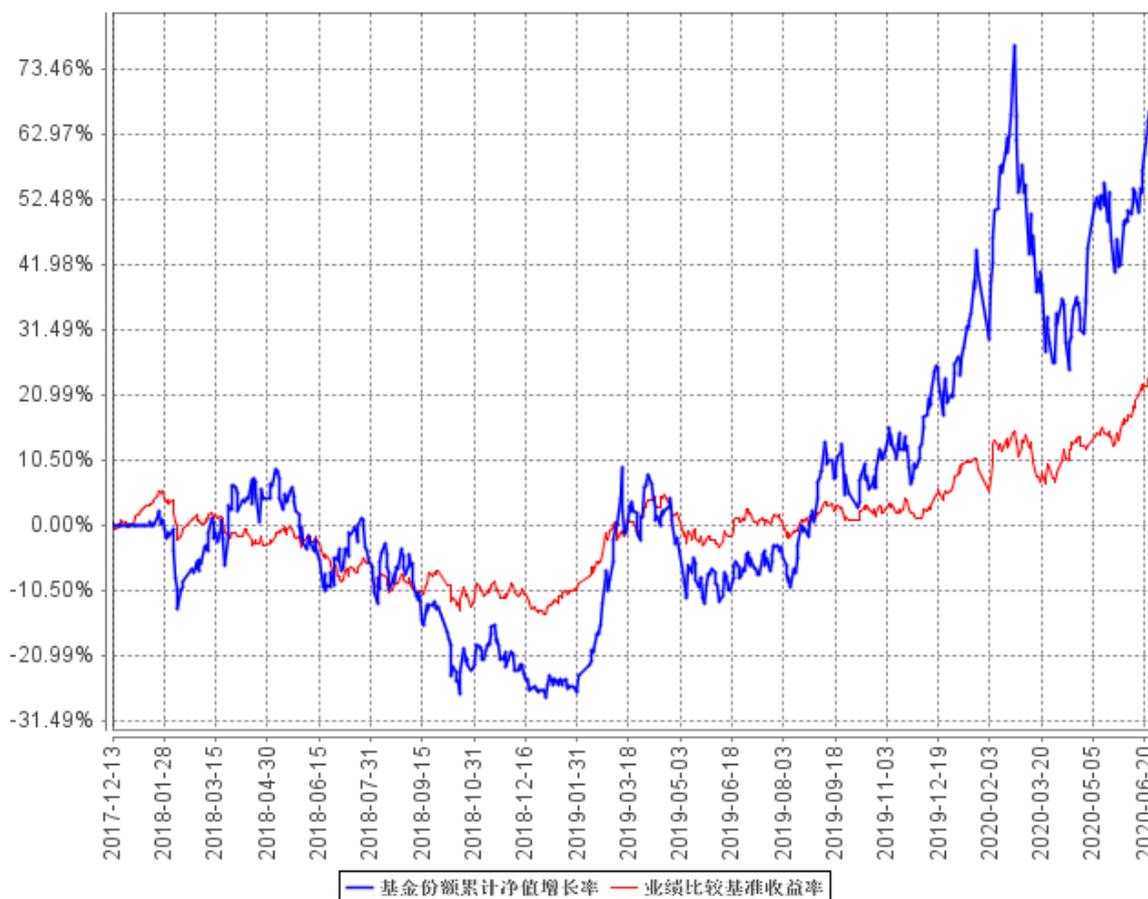
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	19.59%	1.74%	8.89%	0.66%	10.70%	1.08%
过去三个月	34.48%	2.33%	16.71%	0.77%	17.77%	1.56%
过去六个月	40.60%	2.73%	18.36%	1.01%	22.24%	1.72%
过去一年	83.18%	2.26%	24.37%	0.82%	58.81%	1.44%
自基金合同生效起至今	69.75%	2.08%	25.57%	0.83%	44.18%	1.25%

注：1、本基金基金合同生效日为：2017年12月13日。

2、关于业绩比较基准的说明：沪深300指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



按相关法规规定，本基金合同生效日起 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规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司成立于 2006 年 5 月 8 日，截至 2020 年 6 月 30 日，本公司共管理 45 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、中邮增力债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮睿利增强债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、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。

#### 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		
许忠海	基金经理	2017 年 12 月 13 日	-	10 年	曾任职于 Brady 中国区研发中心、方正证券股份有

					限公司，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兼行业研究员、中邮创业基金管理股份有限公司中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现担任中邮健康文娱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基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的《关于基金经理注册通知》、《关于基金经理变更通知》、《关于基金经理注销通知》日期。

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

在利益输送情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

一季度在信用利差和无风险利率的双重下行背景下，叠加美元加息压力放缓以及北上资金的持续流入，因此，本基金在一季度基本保持高仓位。重点配置了消费电子、5G、广电娱乐、猪、创新药及医疗养老信息化、人工智能、大数据和券商。后续因受疫情影响冲击，市场先扬后抑；实体经济压力较大，货币财政政策保持灵活宽松，有利于逐步稳定市场预期，后续需要跟踪国内流动性边际变化和海外风险变化。整体而言，走出疫情之后市场会重新回到震荡向上的趋势，全年维度看科技股占优。

经过这次疫情，大家对医疗健康的重视程度也会提升，提倡健康的生活方式，另外在线办公在线教育等线上生活工作方式得以加速走进大众，类似于 sars 时期电商的发展。习主席也提出在努力复工的同时，要着力培育这些新经济及相关产业链等，这也恰是我们重点投资的方向。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.6975 元，累计净值为 1.6975 元；本报告期基金份额净值增长率为 40.60%，业绩比较基准收益率为 18.36%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

1、宏观逻辑：经济温和复苏，中期看流动性宽松的局面大概率保持。产业逻辑：疫情冲击下，龙头竞争优势凸显，产业集中度进一步提升。资金逻辑：中长期资金依旧持续流入 A 股。投资者审美：趋向成熟、机构化。监管态度：打造成熟的资本市场，注册制超预期加快，高度进一步提升。

2、投资策略：对于半导体产业、短期涨幅较大，修复一下估值，但半导体领域的自主可控目前也是基本国策，随着中芯国际等龙头半导体登陆科创板，半导体板块应该是较长期的机会；半导体设计以及制造存在较大压力，但设备和材料更多受益于国内长存、长鑫、紫光等战略扩产的拉动；消费电子领域，苹果产业链以及 TWS 耳机产业链因 iPhone 新机开始取消有线耳机的需求拉动，会是后续重点投资方向；5G 建设基于华为存货应该今年的基站建设不会受到冲击，至少上半年是加速的，三季度完成全年建设目标后，四季度招标可能需要评估华为事件的解决进程；云计算基础设施、新能源汽车产业链：短期、中期都是比较重视的投资方向。

新能源汽车在二季度全面复苏的基础上，下半年进入景气上行周期；军工导弹和北斗相关产业链基于订单逻辑，会关注一些。经济温和复苏相关联的顺周期成长龙头也是关注范围。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、督察长、基金清算部经理、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理，在采用估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过估值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未进行利润分配。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内，有连续二十个工作日基金净值低于五千万元的情形。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020 年上半年度，基金托管人在中邮健康文娱混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2020 年上半年度，中邮创业基金管理股份有限公司在中邮健康文娱混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

2020 年上半年度，由中邮创业基金管理股份有限公司编制并经托管人复核审查的有关中邮健康文娱混合型证券投资基金的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## § 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：中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,407,786.96	681,601.71
结算备付金		216,282.39	47,082.92
存出保证金		49,436.87	14,576.10
交易性金融资产	6.4.7.2	52,120,340.20	8,100,347.48
其中：股票投资		52,120,340.20	8,100,347.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		697,065.94	82,612.24
应收利息	6.4.7.5	798.27	213.21
应收股利		-	-
应收申购款		2,279,100.96	57,618.28
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		59,770,811.59	8,984,051.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,727,643.98	78,401.62
应付管理人报酬		74,953.70	10,208.71
应付托管费		12,492.26	1,701.46
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	164,401.24	33,683.05
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	208,241.72	240,089.22
负债合计		2,187,732.90	364,084.06
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	33,922,064.14	7,140,021.65
未分配利润	6.4.7.10	23,661,014.55	1,479,946.23
所有者权益合计		57,583,078.69	8,619,967.88
负债和所有者权益总计		59,770,811.59	8,984,051.94

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.6975 元，基金份额总额 33,922,064.14 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		6,702,982.50	21,403,677.46
1.利息收入		18,388.36	25,483.63
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,388.36	25,483.63
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）		-2,012,360.87	20,310,515.90
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-2,144,746.76	20,279,178.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	132,385.89	31,337.75
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	8,070,282.01	919,308.48
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	626,673.00	148,369.45
<b>减：二、费用</b>		1,025,767.24	1,505,453.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	367,577.28	279,058.69
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,262.83	46,509.79

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	586,473.48	1,155,966.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	10,453.65	23,918.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,677,215.26	19,898,224.32
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,677,215.26	19,898,224.32

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	7,140,021.65	1,479,946.23	8,619,967.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,677,215.26	5,677,215.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	26,782,042.49	16,503,853.06	43,285,895.55
其中：1.基金申购款	96,306,748.60	51,208,052.58	147,514,801.18
2.基金赎回款	-69,524,706.11	-34,704,199.52	-104,228,905.63
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	33,922,064.14	23,661,014.55	57,583,078.69
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	64,915,662.84	-17,232,596.17	47,683,066.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,898,224.32	19,898,224.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-51,602,768.73	-3,641,105.73	-55,243,874.46
其中：1.基金申购款	23,906,547.52	-209,207.33	23,697,340.19
2.基金赎回款	-75,509,316.25	-3,431,898.40	-78,941,214.65
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	13,312,894.11	-975,477.58	12,337,416.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

\_\_\_\_\_ 孔军

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 孔军

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 佟姗

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中邮健康文娱灵活配置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[2017]1022号《关于准予中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准，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《中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于2017年12月13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316,713,640.86元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字（2017）第110ZC0443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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、银行存款、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%~95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0%~3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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；本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%；本基金投资于健康文娱主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

#### **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监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和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**

本报告期本基金所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本报告期内本基金无会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本报告期内本基金无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,407,786.96
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	4,407,786.96

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	43,030,326.50	52,120,340.20	9,090,013.70
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	43,030,326.50	52,120,340.20	9,090,013.70

##### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	690.54
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	87.65
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.01
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	20.07
合计	798.27

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	164,401.24
银行间市场应付交易费用	-
合计	164,401.24

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	3,269.48
应付证券出借违约金	-
预提费用	204,972.24
合计	208,241.72

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,140,021.65	7,140,021.65
本期申购	96,306,748.60	96,306,748.60
本期赎回(以“-”号填列)	-69,524,706.11	-69,524,706.11
- 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	33,922,064.14	33,922,064.14

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,717,164.96	-1,237,218.73	1,479,946.23
本期利润	-2,393,066.75	8,070,282.01	5,677,215.26
本期基金份额交易产生的变动数	13,739,991.04	2,763,862.02	16,503,853.06
其中：基金申购款	41,418,520.62	9,789,531.96	51,208,052.58
基金赎回款	-27,678,529.58	-7,025,669.94	-34,704,199.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	14,064,089.25	9,596,925.30	23,661,014.55

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	2,469.95
其他	257.69

合计	18,388.36
----	-----------

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	180,323,399.64
减：卖出股票成本总额	182,468,146.40
买卖股票差价收入	-2,144,746.76

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	132,385.89
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	132,385.89

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	8,070,282.01
——股票投资	8,070,282.01
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-

——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	8,070,282.01

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	626,673.00
合计	626,673.00

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	586,473.48
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	586,473.48

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	4,972.24
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	5,481.41
合计	10,453.65

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

本报告期内，本基金不存在或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2020 年 8 月 21 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
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券有限责任公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国邮政集团有限公司	基金管理人的股东
三井住友银行股份有限公司	基金管理人的股东

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.1 关联方报酬

##### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	367,577.28	279,058.69
其中：支付销售机构的客户维护费	158,572.83	37,599.60

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。管理费率的计算方法如下：

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

**6.4.10.1.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	61,262.83		46,509.79	

注：支付基金托管人交通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：

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

**6.4.10.2 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。

**6.4.10.3 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****6.4.10.3.1 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固定期限费率的证券出借业务。

**6.4.10.3.2 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。

**6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

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。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020年1月1日至2020年6月30日		2019年1月1日至2019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
交通银行股	4,407,786.96	15,660.72	1,219,233.09	17,604.73

份有限公司				
-------	--	--	--	--

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,066	6,332.04	6,332.04	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

##### 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

本基金管理人根据中国证监会的要求，建立了科学合理层次分明的内控组织架构、控制程序、控制措施和控制职责。

本基金管理人已建立了一套较为完整的决策流程和业务操作流程，每个员工各司其责，监察稽核部定期对各部门、各业务流程进行监察稽核，充分保证了各项管理制度和业务流程的有效执行。

##### 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

本基金未持有按短期信用评级列示的债券投资。

###### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

###### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

### 6.4.13.4 市场风险

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

### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	4,407,786.96	-	-	-	4,407,786.96
结算备付金	216,282.39	-	-	-	216,282.39
存出保证金	49,436.87	-	-	-	49,436.87
交易性金融资产	-	-	-	52,120,340.20	52,120,340.20
应收证券清算款	-	-	-	697,065.94	697,065.94
应收利息	-	-	-	798.27	798.27
应收申购款	-	-	-	2,279,100.96	2,279,100.96
资产总计	4,673,506.22	-	-	55,097,305.37	59,770,811.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,727,643.98	1,727,643.98
应付管理人报酬	-	-	-	74,953.70	74,953.70
应付托管费	-	-	-	12,492.26	12,492.26
应付交易费用	-	-	-	164,401.24	164,401.24
其他负债	-	-	-	208,241.72	208,241.72
负债总计	-	-	-	2,187,732.90	2,187,732.90
利率敏感度缺口	4,673,506.22	-	-	-52,909,572.47	57,583,078.69
上年度末 2019年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	681,601.71	-	-	-	681,601.71
结算备付金	47,082.92	-	-	-	47,082.92
存出保证金	14,576.10	-	-	-	14,576.10
交易性金融资产	-	-	-	8,100,347.48	8,100,347.48
应收证券清算款	-	-	-	82,612.24	82,612.24
应收利息	-	-	-	213.21	213.21
应收申购款	-	-	-	57,618.28	57,618.28

其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	743,260.73	-	-	8,240,791.21	8,984,051.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	78,401.62	78,401.62
应付管理人报酬	-	-	-	10,208.71	10,208.71
应付托管费	-	-	-	1,701.46	1,701.46
应付交易费用	-	-	-	33,683.05	33,683.05
其他负债	-	-	-	240,089.22	240,089.22
负债总计	-	-	-	364,084.06	364,084.06
利率敏感度缺口	743,260.73	-	-	7,876,707.15	8,619,967.88

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

##### 市场价格风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、资产支持证券、银行存款、债券回购、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：

本基金股票资产占基金资产的比例为 0% - 95%；权证投资占基金资产净值的比例为 0% - 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产

净值的 10%；本基金投资于健康文娱主题的证券不低于非现金基金资产的 80%。

于 2020 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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	52,120,340.20	90.51	8,100,347.48	93.97
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	52,120,340.20	90.51	8,100,347.48	93.97

#### 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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	976,350.50	89,174.41
2. 基金净资产变动	-976,350.50	-89,174.41	

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果，利用 2020 年 1 月 1 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 1.87。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	52,120,340.20	87.20
	其中：股票	52,120,340.20	87.20
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	4,624,069.35	7.74
8	其他各项资产	3,026,402.04	5.06
9	合计	59,770,811.59	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 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	49,180,209.67	85.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,192.96	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	813,937.57	1.41
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,117,000.00	3.68
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,120,340.20	90.51

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未投资港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300433	蓝思科技	129,500	3,631,180.00	6.31
2	002475	立讯精密	70,010	3,595,013.50	6.24
3	002241	歌尔股份	120,000	3,523,200.00	6.12
4	002371	北方华创	18,000	3,076,380.00	5.34
5	603986	兆易创新	12,000	2,830,920.00	4.92
6	600745	闻泰科技	22,000	2,770,900.00	4.81
7	000977	浪潮信息	67,060	2,627,410.80	4.56
8	300782	卓胜微	6,040	2,450,850.80	4.26
9	300136	信维通信	40,000	2,120,800.00	3.68
10	002127	南极电商	100,000	2,117,000.00	3.68
11	300750	宁德时代	12,000	2,092,320.00	3.63
12	300014	亿纬锂能	40,040	1,915,914.00	3.33
13	002456	欧菲光	100,000	1,839,000.00	3.19
14	300054	鼎龙股份	110,000	1,826,000.00	3.17
15	002409	雅克科技	35,000	1,825,950.00	3.17
16	603501	韦尔股份	9,000	1,817,550.00	3.16
17	300548	博创科技	30,000	1,794,000.00	3.12
18	002460	赣锋锂业	31,000	1,660,670.00	2.88
19	603019	中科曙光	37,000	1,420,800.00	2.47
20	002273	水晶光电	80,000	1,371,200.00	2.38
21	300618	寒锐钴业	21,000	1,302,420.00	2.26
22	600584	长电科技	41,000	1,282,070.00	2.23
23	603799	华友钴业	30,000	1,165,800.00	2.02
24	688018	乐鑫科技	3,900	801,840.00	1.39

25	002916	深南电路	4,000	670,080.00	1.16
26	688008	澜起科技	5,000	508,400.00	0.88
27	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.03
28	603087	甘李药业	172	17,251.60	0.03
29	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.02
30	600956	新天绿能	1,824	9,192.96	0.02
31	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
32	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
33	300840	酷特智能	1,066	6,332.04	0.01
34	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

## 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	600745	闻泰科技	7,073,085.00	82.05
2	002409	雅克科技	6,452,911.77	74.86
3	002241	歌尔股份	6,241,089.00	72.40
4	300136	信维通信	5,733,124.00	66.51
5	002475	立讯精密	5,407,988.96	62.74
6	002384	东山精密	5,060,148.00	58.70
7	300782	卓胜微	4,899,632.00	56.84
8	300014	亿纬锂能	4,815,080.80	55.86
9	688058	宝兰德	4,736,287.19	54.95
10	300630	普利制药	4,435,123.00	51.45
11	688018	乐鑫科技	4,416,190.35	51.23
12	300750	宁德时代	4,271,412.00	49.55
13	002127	南极电商	4,230,173.99	49.07
14	603690	至纯科技	4,220,625.00	48.96
15	002156	通富微电	3,954,570.00	45.88
16	002185	华天科技	3,895,905.16	45.20
17	603501	韦尔股份	3,879,971.24	45.01
18	300433	蓝思科技	3,830,059.00	44.43
19	002371	北方华创	3,751,157.00	43.52
20	603005	晶方科技	3,746,532.00	43.46
21	603986	兆易创新	3,645,400.00	42.29

22	000002	万科 A	3,469,731.63	40.25
23	002456	欧菲光	3,381,033.00	39.22
24	300548	博创科技	3,322,422.00	38.54
25	000063	中兴通讯	3,319,141.00	38.51
26	002273	水晶光电	3,239,301.89	37.58
27	300725	药石科技	3,207,150.40	37.21
28	688008	澜起科技	3,140,336.38	36.43
29	603019	中科曙光	3,111,855.00	36.10
30	600536	中国软件	3,098,422.00	35.94
31	002460	赣锋锂业	3,083,112.00	35.77
32	600867	通化东宝	3,037,101.00	35.23
33	000977	浪潮信息	2,910,642.20	33.77
34	002212	南洋股份	2,852,102.00	33.09
35	600570	恒生电子	2,801,514.80	32.50
36	300379	东方通	2,687,427.00	31.18
37	600703	三安光电	2,591,759.00	30.07
38	000796	凯撒旅业	2,491,515.00	28.90
39	002916	深南电路	2,316,283.00	26.87
40	688012	中微公司	2,256,700.61	26.18
41	300451	创业慧康	2,243,480.09	26.03
42	600763	通策医疗	2,163,232.00	25.10
43	002605	姚记科技	2,160,294.00	25.06
44	002555	三七互娱	2,135,740.00	24.78
45	688088	虹软科技	2,122,817.18	24.63
46	603538	美诺华	2,040,168.35	23.67
47	300655	晶瑞股份	2,012,428.00	23.35
48	300122	智飞生物	1,983,637.00	23.01
49	600845	宝信软件	1,909,262.00	22.15
50	688158	优刻得	1,881,159.19	21.82
51	600584	长电科技	1,817,182.00	21.08
52	688126	沪硅产业	1,797,895.46	20.86
53	688037	芯源微	1,782,163.31	20.67
54	300618	寒锐钴业	1,682,732.00	19.52
55	600556	天下秀	1,670,861.00	19.38
56	688258	卓易信息	1,635,555.20	18.97
57	300316	晶盛机电	1,578,069.00	18.31

58	300259	新天科技	1,553,280.80	18.02
59	000661	长春高新	1,529,078.00	17.74
60	688168	安博通	1,525,985.63	17.70
61	603799	华友钴业	1,524,865.00	17.69
62	002065	东华软件	1,456,172.00	16.89
63	300331	苏大维格	1,424,470.00	16.53
64	002368	太极股份	1,409,963.00	16.36
65	300059	东方财富	1,396,426.00	16.20
66	300236	上海新阳	1,356,420.00	15.74
67	300054	鼎龙股份	1,321,236.00	15.33
68	688200	华峰测控	1,286,589.50	14.93
69	688111	金山办公	1,268,551.56	14.72
70	300450	先导智能	1,201,550.00	13.94
71	601888	中国中免	1,185,947.00	13.76
72	002594	比亚迪	1,107,739.00	12.85
73	000725	京东方 A	1,044,000.00	12.11
74	002853	皮阿诺	998,879.00	11.59
75	600809	山西汾酒	959,142.00	11.13
76	300087	荃银高科	903,232.00	10.48
77	002385	大北农	887,621.00	10.30
78	600258	首旅酒店	875,082.00	10.15
79	002600	领益智造	661,950.00	7.68
80	000681	视觉中国	615,661.55	7.14
81	300666	江丰电子	567,544.00	6.58
82	002624	完美世界	294,005.00	3.41
83	603233	大参林	243,878.00	2.83
84	002635	安洁科技	214,826.68	2.49
85	002174	游族网络	181,050.00	2.10

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	002409	雅克科技	4,909,776.72	56.96
2	002384	东山精密	4,814,183.00	55.85

3	600745	闻泰科技	4,444,400.00	51.56
4	300630	普利制药	4,418,581.00	51.26
5	002185	华天科技	4,246,008.87	49.26
6	002156	通富微电	4,118,881.65	47.78
7	603690	至纯科技	4,089,345.73	47.44
8	688058	宝兰德	4,010,830.32	46.53
9	002241	歌尔股份	3,839,714.00	44.54
10	300014	亿纬锂能	3,788,705.00	43.95
11	300136	信维通信	3,756,407.00	43.58
12	603005	晶方科技	3,523,725.80	40.88
13	002475	立讯精密	3,494,655.00	40.54
14	300782	卓胜微	3,480,909.00	40.38
15	000002	万科 A	3,434,747.00	39.85
16	000063	中兴通讯	3,419,738.00	39.67
17	688018	乐鑫科技	3,336,689.60	38.71
18	600867	通化东宝	3,129,599.18	36.31
19	300725	药石科技	2,973,328.00	34.49
20	300750	宁德时代	2,922,369.00	33.90
21	600536	中国软件	2,882,479.00	33.44
22	002212	南洋股份	2,858,016.00	33.16
23	300451	创业慧康	2,750,800.02	31.91
24	688126	沪硅产业	2,743,975.23	31.83
25	688008	澜起科技	2,645,718.82	30.69
26	600570	恒生电子	2,606,005.00	30.23
27	002605	姚记科技	2,465,151.00	28.60
28	603501	韦尔股份	2,465,111.00	28.60
29	000796	凯撒旅业	2,454,982.00	28.48
30	002127	南极电商	2,352,457.00	27.29
31	600703	三安光电	2,328,336.00	27.01
32	002555	三七互娱	2,286,526.00	26.53
33	300379	东方通	2,270,184.00	26.34
34	600845	宝信软件	2,226,452.00	25.83
35	688012	中微公司	2,179,618.90	25.29
36	688088	虹软科技	2,147,577.28	24.91
37	600763	通策医疗	2,092,838.50	24.28
38	300433	蓝思科技	2,009,751.00	23.32
39	603019	中科曙光	1,999,777.20	23.20
40	688037	芯源微	1,999,001.09	23.19

41	603538	美诺华	1,932,065.00	22.41
42	002916	深南电路	1,926,176.00	22.35
43	002273	水晶光电	1,875,046.00	21.75
44	300122	智飞生物	1,796,400.00	20.84
45	002460	赣锋锂业	1,786,748.50	20.73
46	300059	东方财富	1,770,622.00	20.54
47	002371	北方华创	1,764,729.85	20.47
48	600556	天下秀	1,734,642.00	20.12
49	300655	晶瑞股份	1,708,283.00	19.82
50	603986	兆易创新	1,636,805.00	18.99
51	002456	欧菲光	1,619,742.00	18.79
52	300450	先导智能	1,577,686.00	18.30
53	000661	长春高新	1,548,073.14	17.96
54	300259	新天科技	1,474,785.00	17.11
55	688111	金山办公	1,447,559.74	16.79
56	688258	卓易信息	1,420,654.96	16.48
57	300316	晶盛机电	1,413,600.00	16.40
58	688158	优刻得	1,380,752.97	16.02
59	300236	上海新阳	1,377,306.00	15.98
60	300331	苏大维格	1,344,889.00	15.60
61	002065	东华软件	1,340,391.00	15.55
62	000725	京东方 A	1,277,100.00	14.82
63	688168	安博通	1,272,292.00	14.76
64	002368	太极股份	1,191,234.00	13.82
65	002594	比亚迪	1,170,200.00	13.58
66	601888	中国中免	1,166,003.00	13.53
67	300548	博创科技	1,106,683.80	12.84
68	600258	首旅酒店	1,050,628.44	12.19
69	688200	华峰测控	1,023,622.78	11.88
70	002385	大北农	1,009,171.00	11.71
71	002853	皮阿诺	982,370.00	11.40
72	600809	山西汾酒	968,410.00	11.23
73	300087	荃银高科	930,743.00	10.80
74	600584	长电科技	870,894.00	10.10
75	603799	华友钴业	668,533.00	7.76
76	000977	浪潮信息	651,879.00	7.56
77	000681	视觉中国	638,151.14	7.40
78	002600	领益智造	621,000.00	7.20

79	300666	江丰电子	570,154.00	6.61
80	300618	寒锐钴业	546,660.00	6.34
81	002624	完美世界	536,951.00	6.23
82	002174	游族网络	486,254.00	5.64
83	002635	安洁科技	301,235.00	3.49
84	601688	华泰证券	281,100.00	3.26
85	603707	健友股份	235,986.00	2.74
86	603233	大参林	224,925.00	2.61
87	600918	中泰证券	200,210.34	2.32

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	218,417,857.11
卖出股票收入（成交）总额	180,323,399.64

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进行贵金属的投资。

### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未投资股指期货。

#### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采

用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

#### 7.11.1 本期国债期货投资评价

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	49,436.87
2	应收证券清算款	697,065.94
3	应收股利	-
4	应收利息	798.27
5	应收申购款	2,279,100.96
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,026,402.04

#### 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债。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
10,233	3,314.97	0.00	0.00%	33,922,064.14	100.00%

### 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	177,889.80	0.5244%

### 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（2017年12月13日）基金份额总额	316,713,640.86
本报告期期初基金份额总额	7,140,021.65
本报告期基金总申购份额	96,306,748.60
减：本报告期基金总赎回份额	69,524,706.11
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	33,922,064.14

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	398,181,416.31	100.00%	370,826.06	100.00%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

以及其他综合服务能力。

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

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

2、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金不存在交易单元退租情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2020年1月2日
2	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2020年1月2日
3	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通北京植信基金销售有限公司基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	规定媒介	2020年1月6日
4	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金2019年第4季度报告	规定媒介	2020年1月18日
5	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通基金定投业务并参加基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2020年2月10日
6	中邮创业基金管理股份有限公司关于修改旗下中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合	规定媒介	2020年2月13日

	同 等法律文件的公告		
7	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金托管协议	规定媒介	2020 年 2 月 13 日
8	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同	规定媒介	2020 年 2 月 13 日
9	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定媒介	2020 年 2 月 13 日
10	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金招募说明书更新（摘要）	规定媒介	2020 年 2 月 13 日
11	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通华安证券股份有限公司基金定投业务并参加定投费率优惠活动的公告	规定媒介	2020 年 2 月 27 日
12	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通万家财富基金销售（天津）有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	规定媒介	2020 年 2 月 28 日
13	关于中邮创业基金管理股份有限公司增加中信期货有限公司为代销机构 并开通中信期货有限公司基金定投业务的公告	规定媒介	2020 年 3 月 3 日
14	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通中国国际期货股份有限公司基金定投业务并参加基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2020 年 3 月 16 日
15	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通基金定投业务并参加基金申购及定投申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2020 年 3 月 18 日
16	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金 开通申万宏源西部证券有限公司基金定投业务的公告	规定媒介	2020 年 4 月 16 日
17	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金 2019 年年度报告	规定媒介	2020 年 4 月 20 日
18	中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	规定媒介	2020 年 4 月 22 日
19	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通基金定投业务并参加基金申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2020 年 5 月 28 日

20	中邮创业基金管理股份有限公司 关于增加中信证券华南股份有限 公司为代销机构的公告	规定媒介	2020 年 5 月 28 日
21	中邮创业基金管理股份有限公司 关于代销机构调整基金申购及定 投起点金额下限的公告	规定媒介	2020 年 6 月 18 日

注：规定媒介指中国证监会规定的用以进行信息披露的全国性报刊及规定互联网网站等媒介。

## § 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

注：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健康文娱灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮健康文娱灵活配置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

2020 年 8 月 29 日