

# 中邮沪港深精选混合型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务资料未经审计。

本报告期自 2023 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>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.....                                | 11        |
| <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.....              | 14        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 14        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....             | 15        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 15        |
| 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.....                 | 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的真实、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>40</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 40        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                  | 40        |
| 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.....     | 41        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 41        |
| 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 本基金投资股指期货的投资政策.....                   | 43        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 43        |
| 7.12 投资组合报告附注.....                         | 43        |
| <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>50</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..... | 错误！未定义书签。 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 错误！未定义书签。 |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                  | <b>51</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 51        |
| 12.2 存放地点.....                          | 51        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 51        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                  |
|------------|------------------|
| 基金名称       | 中邮沪港深精选混合型证券投资基金 |
| 基金简称       | 中邮沪港深精选混合        |
| 基金主代码      | 006477           |
| 基金运作方式     | 契约型开放式           |
| 基金合同生效日    | 2019 年 3 月 28 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 | 36,633,694.14 份  |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金在深入研究的基础上，精选沪港深市场中优质的标的进行投资，力争实现基金资产的长期稳定增值。   |
| 投资策略 | <p>本基金通过定量分析与定性分析相结合的策略，自上而下的配置大类资产，科学配置 A 股与港股的投资比例；自下而上的精选个股，重点投资于在估值、企业成长性、投资稀缺性等方面具备明显优势的上市公司。</p> <p>（一）大类资产配置</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，本基金将根据 A 股与港股之间折溢价情况的变化、资金流向、投资者结构的变化等因素，调整 A 股与港股的配置比例。</p> <p>（二）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>对于国家宏观经济运行过程中产生的阶段性焦点行业，本基金通过对经济运行周期、行业竞争态势以及国家产业政策调整等影响行业短期运行情况的因素进行分析和研究，筛选具有短期重点发展趋势的行业资产进行配置，并依据上述因素的短期变化对行业配置权重进行动态调整。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金将采用定量和定性相结合的分析方法甄选优质</p> |

|  |   |
|--|---|
|  | <p>的个股构建投资组合</p> <p>(四) 港股投资策略</p> <p>(五) 债券投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"><li>1、平均久期配置</li><li>2、期限结构配置</li><li>3、类属配置</li><li>4、回购套利</li></ol> <p>(六) 中小企业私募债投资策略</p> <p>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。</p> <p>目前市场上正在或即将发行的中小企业私募债的期限通常都在三年以下，久期风险较低；其风险点主要集中在信用和流通性。由于发行规模都比较小，这在一定程度上决定了其二级市场的流通性有限，换手率不高，所以本基金在涉及中小企业私募债投资时，会将重点放在一级市场，在有效规避信用风险的同时获取信用利差大的个券，并持有到期。</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金会加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析；会倾向于大券商承销的有上市诉求的企业。鉴于其信用风险大，流通性弱，本基金会严格防范风险。所有中小企业私募债在投资前都必须实地调研，研究报告由研究员双人会签，并对投资比例有严格控制。重大投资决策需上报投资委员会。</p> <p>(七) 资产支持证券投资策略</p> <p>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，以降低流动性风险。</p> <p>(八) 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</p> |
|--|---|

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>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>（九）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×10% +恒生指数收益率×80% +中证全债指数收益率×10%  |
| 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高等风险品种。  |

### 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                   | 张姗                          |
|         | 联系电话 | 010-82295160—157      | 0755-83077987               |
|         | 电子邮箱 | houyc@postfund.com.cn | zhangshan_1027@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      | 中国证券报               |
| 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(2023年1月1日 - 2023年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 2,070,706.04                |
| 本期利润          | -429,902.94                 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0090                     |
| 本期加权平均净值利润率   | -1.04%                      |
| 本期基金份额净值增长率   | -3.15%                      |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | -5,332,143.71               |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1456                     |
| 期末基金资产净值      | 31,301,550.43               |
| 期末基金份额净值      | 0.8544                      |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2023年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | -14.56%                     |

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。

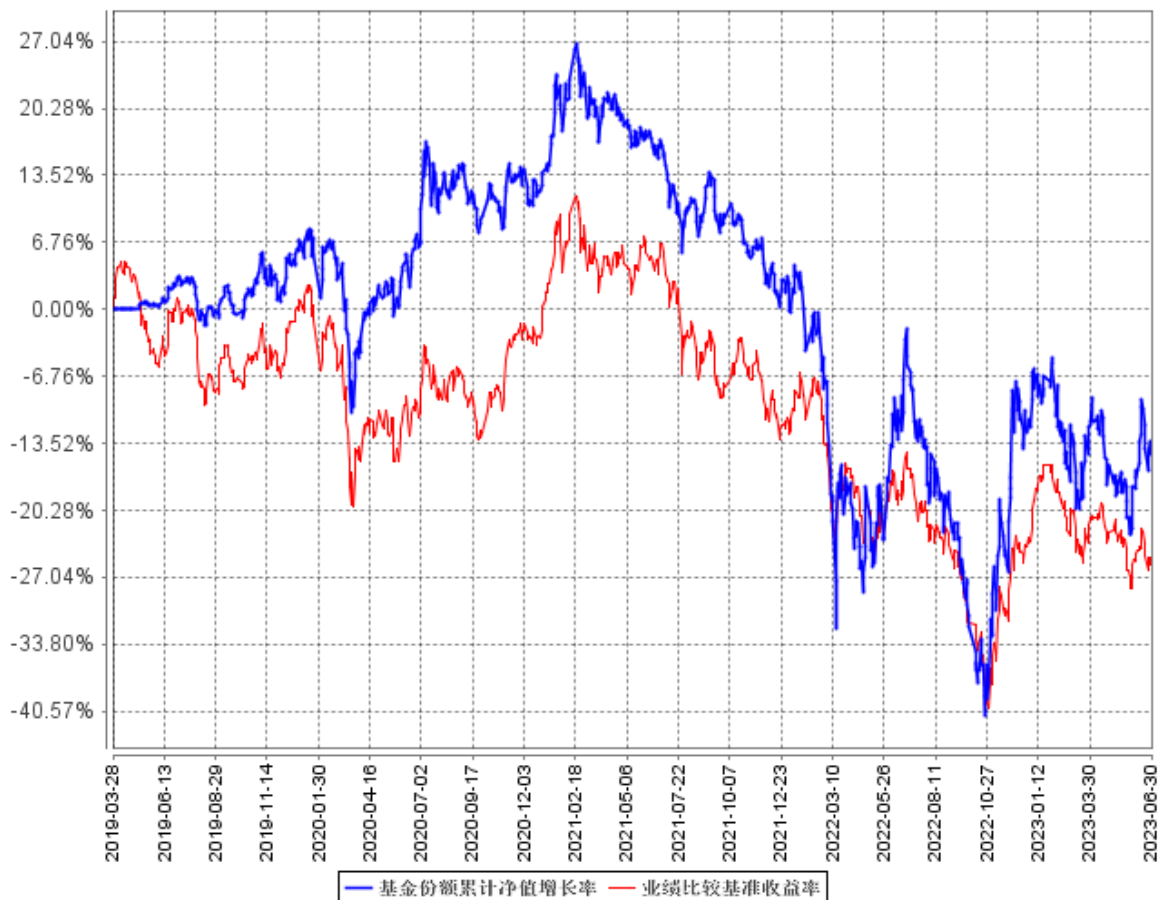
#### 3.2 基金净值表现

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

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③    | ②—④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月      | 10.33%   | 2.00%       | 3.18%      | 1.23%         | 7.15%  | 0.77% |
| 过去三个月      | -3.65%   | 1.76%       | -6.12%     | 1.03%         | 2.47%  | 0.73% |
| 过去六个月      | -3.15%   | 1.99%       | -3.17%     | 1.15%         | 0.02%  | 0.84% |
| 过去一年       | -9.40%   | 2.40%       | -11.53%    | 1.42%         | 2.13%  | 0.98% |
| 过去三年       | -20.00%  | 1.94%       | -17.20%    | 1.32%         | -2.80% | 0.62% |
| 自基金合同生效起至今 | -14.56%  | 1.69%       | -25.76%    | 1.28%         | 11.20% | 0.41% |

### 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，本基金应当自合同生效日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关规定。

### 3.3 其他指标

## § 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 2023 年 6 月 30 日，本公司共管理 56 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、中邮专精特新一年持有期混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名  | 职务   | 任本基金的基金经理（助理）期限 |      | 证券从业年限 | 说明  |
|-----|------|-----------------|------|--------|---|
|     |      | 任职日期            | 离任日期 |        |   |
| 陈鸿平 | 基金经理 | 2019年3月28日      | -    | 13年    | 算学学士，FRM 金融风险管理师。曾任招商资产管理（香港）有限公司交易员、三井住友信托（香港）有限公司交易员、IDG 资本旗下 Exabyte Capital 对冲基金量化交易研究员及投资经理助理、中邮创业基金管理股份有限公司港股投资经理、中邮创业国际资产管理有限公司投资部总监。现担任中邮沪港深精选混合型证券投资基金基金经理。  |
| 武志骁 | 基金经理 | 2020年12月3日      | -    | 9年     | 曾任中国华新投资有限公司中央交易员、投资分析员、中邮创业基金管理股份有限公司投资经理、中邮沪港深精选混合型证券投资基金基金经理助理、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮增力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、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮淳享66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任中邮现金驿站货币市场基金、中邮货币市场基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基 |

|  |  |  |  |  |   |
|--|--|--|--|--|---|
|  |  |  |  |  | 金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金、中邮沪港深精选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。

期后事项：2023 年 7 月 28 日，武志骁卸任中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，我国经济增长动能边际放缓，市场主体和消费者信心恢复慢于预期，地产销售数据转弱，外需及出口略强于预期但周期性下行趋势未改。货币政策果断采取降息操作，立场相对更为积极。财政政策着力扩大国内需求，化解地方债务问题，有效提振市场信心。

美国劳动力市场指标在短暂走弱后再度走强，通胀回落基本符合市场预期，银行业风险事件未对信用创造产生实质不利影响，美联储基本完成其货币政策紧缩进程。总体而言，美国经济韧性较强，通胀下行趋势未改，预计美联储维持适度限制性的货币政策，海外流动性环境有利于港股市场。

展望未来，境内境外的宏观经济和经济政策走势均对港股市场较为有利，当前港股估值水平再度位于历史低位，极具配置价值。本基金根据市场走势适时调整仓位，继续聚焦科技成长主题，持续关注新格局下具有竞争优势的平台经济主体，并适时增配受益于经济常态化的可选消费领域投资机会，持续为持有人创造回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.8544 元，累计净值为 0.8544 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.15%，业绩比较基准收益率为-3.17%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年来，我国财政支出相对谨慎，出口韧性较强，居民消费总体稳健，制造业及基础设施固定资产投资保持平稳，地产部门固定资产投资持续拖累经济增长。经过了两年快速下行，地产部门的结构调整初见成效，我国经济增长对地产的依赖已经显著降低，居民部门资产负债表整体健康，出口部门的国际竞争力仍然较强。在此基础上，科技创新不仅是我国参与国际分工、提升全球竞争力的必然要求，更是未来经济增长的主要驱动力，将成为高质量发展的关键，具有极好的长期投资价值。

当前，我国经济动能持续恢复，结构变革和科技创新稳步推进，市场信心逐步改善，美国通胀初步得到控制，美联储货币政策紧缩接近尾声，海外金融市场流动性预计有所改善，国内外因素均有利于港股市场，尤其利好科技成长风格。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理公司于本报告期内成立估值小组，成员由总经理、督察长、基金清算部经理、基金经理及基金会计组成。估值小组负责确定基金估值程序及标准以及对突发事件的处理，在采用估值政策和程序时，充分考虑参与估值流程各方及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过估

值委员会、参考行业协会估值意见、参考独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未能满足利润分配条件，故未进行利润分配。

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

本基金本报告期内，有连续六十个工作日基金净值规模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

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：中邮沪港深精选混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产            | 附注号        | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日         |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>    |            |                                |                                  |
| 银行存款          | 6.4.7.1    | 2,039,184.14                   | 5,859,499.09                     |
| 结算备付金         |            | 142,886.46                     | 511.18                           |
| 存出保证金         |            | 1,967.70                       | 0.45                             |
| 交易性金融资产       | 6.4.7.2    | 29,549,655.11                  | 63,454,694.10                    |
| 其中：股票投资       |            | 29,549,655.11                  | 63,454,694.10                    |
| 基金投资          |            | -                              | -                                |
| 债券投资          |            | -                              | -                                |
| 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         |            | -                              | 2,533,479.48                     |
| 应收股利          |            | 11,016.04                      | 984.04                           |
| 应收申购款         |            | 63,146.03                      | 1,777,616.04                     |
| 递延所得税资产       |            | -                              | -                                |
| 其他资产          | 6.4.7.8    | -                              | -                                |
| 资产总计          |            | 31,807,855.48                  | 73,626,784.38                    |
| <b>负债和净资产</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2023 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2022 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         |            | 236,934.87                     | -                                |

|             |          |               |               |
|-------------|----------|---------------|---------------|
| 应付赎回款       |          | 130,522.66    | 6,151,057.61  |
| 应付管理人报酬     |          | 39,323.84     | 64,237.50     |
| 应付托管费       |          | 6,553.96      | 10,706.21     |
| 应付销售服务费     |          | -             | -             |
| 应付投资顾问费     |          | -             | -             |
| 应交税费        |          | -             | -             |
| 应付利润        |          | -             | -             |
| 递延所得税负债     |          | -             | -             |
| 其他负债        | 6.4.7.9  | 92,969.72     | 64,844.57     |
| 负债合计        |          | 506,305.05    | 6,290,845.89  |
| <b>净资产：</b> |          |               |               |
| 实收基金        | 6.4.7.10 | 36,633,694.14 | 76,329,478.33 |
| 其他综合收益      | 6.4.7.11 | -             | -             |
| 未分配利润       | 6.4.7.12 | -5,332,143.71 | -8,993,539.84 |
| 净资产合计       |          | 31,301,550.43 | 67,335,938.49 |
| 负债和净资产总计    |          | 31,807,855.48 | 73,626,784.38 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8544 元，基金份额总额 36,633,694.14 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮沪港深精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目               | 附注号      | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至<br>2023 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2022 年 1 月 1 日至<br>2022 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| <b>一、营业总收入</b>   |          | 7,186.38                                 | -155,909.02                                   |
| 1.利息收入           |          | 10,797.01                                | 2,063.87                                      |
| 其中：存款利息收入        | 6.4.7.13 | 10,797.01                                | 2,063.87                                      |
| 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） |          | 2,095,322.70                             | -8.61   |
| 其中：股票投资收益        | 6.4.7.14 | 2,066,488.72                             | -13,058.17                                    |
| 基金投资收益           |          | -  | -   |
| 债券投资收益           | 6.4.7.15 | -  | -   |
| 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 | 28,833.98                                | 13,049.56                                     |
| 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   | -2,500,608.98 | -173,578.86 |
| 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   | 401,675.65    | 15,614.58   |
| <b>减：二、营业总支出</b>           |            | 437,089.32    | 51,388.21   |
| 1. 管理人报酬                   | 6.4.10.2.1 | 312,295.97    | 39,333.06   |
| 2. 托管费                     | 6.4.10.2.2 | 52,049.32     | 6,555.53    |
| 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                   |            | -             | -           |
| 8. 其他费用                    | 6.4.7.23   | 72,744.03     | 5,499.62    |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | -429,902.94   | -207,297.23 |
| 减：所得税费用                    |            | -             | -           |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | -429,902.94   | -207,297.23 |
| <b>五、其他综合收益的税后净额</b>       |            | -             | -           |
| <b>六、综合收益总额</b>            |            | -429,902.94   | -207,297.23 |

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中邮沪港深精选混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目              | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 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） | 76,329,478.33                         | -      | -8,993,539.84 | 67,335,938.49 |
| 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） | 76,329,478.33                         | -      | -8,993,539.84 | 67,335,938.49 |

|  |  |        |               |                |
|--|--|--------|---------------|----------------|
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | -39,695,784.19                             | -      | 3,661,396.13  | -36,034,388.06 |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | -429,902.94   | -429,902.94    |
| (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)  | -39,695,784.19                             | -      | 4,091,299.07  | -35,604,485.12 |
| 其中：1.基金申购款                               | 53,154,136.57                              | -      | -6,228,251.21 | 46,925,885.36  |
| 2.基金赎回款                                  | -92,849,920.76                             | -      | 10,319,550.28 | -82,530,370.48 |
| (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<br>(基金净值)                      | 36,633,694.14                              | -      | -5,332,143.71 | 31,301,550.43  |
| 项目                                       | 上年度可比期间<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<br>(基金净值)                      | 5,260,460.20                               | -      | 175,066.52    | 5,435,526.72   |
| 加：会计政策变更                                 | -  | -      | -             | -              |
| 前期差错更正                                   | -  | -      | -             | -              |
| 其他                                       | -  | -      | -             | -              |
| 二、本期期初净资产<br>(基金净值)                      | 5,260,460.20                               | -      | 175,066.52    | 5,435,526.72   |
| 三、本期增减变动额<br>(减少以“-”号填列)                 | 2,497,570.09                               | -      | -617,099.52   | 1,880,470.57   |
| (一)、综合收益总额                               | -  | -      | -207,297.23   | -207,297.23    |
| (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)      | 2,497,570.09                               | -      | -409,802.29   | 2,087,767.80   |
| 其中：1.基金申购款                               | 5,174,213.62                               | -      | -827,538.55   | 4,346,675.07   |

|  |               |   |             |               |
|--|---------------|---|-------------|---------------|
| 2.基金赎回款                                  | -2,676,643.53 | - | 417,736.26  | -2,258,907.27 |
| (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）                          | 7,758,030.29  | - | -442,033.00 | 7,315,997.29  |

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  珊            
 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

中邮沪港深精选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[2018]1455号《关于准予中邮沪港深精选混合型证券投资基金注册的批复》核准募集，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮沪港深精选混合型证券投资基金基金合同》发起，并于2019年3月28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257,244,734.29元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2019)第110ZC0043号验资报告予以验证。《中邮沪港深精选混合型证券投资基金基金合同》于2019年3月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为257,244,734.29份基金份额。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《中邮沪港深精选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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换

债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、同业存单及其他银行存款)、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(但需符合中国证监会的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的比例为 60%~95%,投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%,权证投资比例不超过基金资产净值的 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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求,真实完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年年度报告一致。

#### 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 差错更正的说明

无。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《财政部国家税务总局证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《财政部国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试

点有关税收政策的通知》、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。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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额；（2）转让股票、债券、基金、非货物期货，按照实际买入价计算销售额。

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

2、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。

3、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

4. 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。



## 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>2023 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 2,039,184.14           |
| 等于：本金          | 2,038,939.34           |
| 加：应计利息         | 244.80                 |
| 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：            | 2,039,184.14           |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |      |               |               |
|---------------|------------------------|------|---------------|---------------|
|               | 成本                     | 应计利息 | 公允价值          | 公允价值变动        |
| 股票            | 32,143,714.43          | -    | 29,549,655.11 | -2,594,059.32 |
| 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            | 32,143,714.43          | -    | 29,549,655.11 | -2,594,059.32 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本期末未持有黄金衍生品。

### 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

本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2023年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                 |
| 应付赎回费       | 119.12            |
| 应付证券出借违约金   | -                 |

|          |           |
|----------|-----------|
| 应付交易费用   | 13,426.24 |
| 其中：交易所市场 | 13,426.24 |
| 银行间市场    | -         |
| -        | -         |
| 应付利息     | -         |
| 预提费用     | 79,424.36 |
| 合计       | 92,969.72 |

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |                |
|---------------|----------------------------|----------------|
|               | 基金份额（份）                    | 账面金额           |
| 上年度末          | 76,329,478.33              | 76,329,478.33  |
| 本期申购          | 53,154,136.57              | 53,154,136.57  |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -92,849,920.76             | -92,849,920.76 |
| - 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           | 36,633,694.14              | 36,633,694.14  |

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|---------------|---------------|
| 本期期初           | -1,998,196.78 | -6,995,343.06 | -8,993,539.84 |
| 本期利润           | 2,070,706.04  | -2,500,608.98 | -429,902.94   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 485,263.46    | 3,606,035.61  | 4,091,299.07  |
| 其中：基金申购款       | -638,916.11   | -5,589,335.10 | -6,228,251.21 |
| 基金赎回款          | 1,124,179.57  | 9,195,370.71  | 10,319,550.28 |
| 本期已分配利润        | -             | -             | -             |
| 本期末            | 557,772.72    | -5,889,916.43 | -5,332,143.71 |

**6.4.7.13 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 5,725.26                              |
| 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 | 5,056.42                              |
| 其他        | 15.33                                 |
| 合计        | 10,797.01                             |

**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>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 41,972,586.07                         |
| 减：卖出股票成本总额 | 39,791,657.09                         |
| 减：交易费用     | 114,440.26                            |
| 买卖股票差价收入   | 2,066,488.72                          |

**6.4.7.15 债券投资收益**

本期本基金无债券投资。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

本期本基金无资产支持证券投资。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

本期本基金无贵金属投资。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

本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>2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|               |           |
|---------------|-----------|
| 股票投资产生的股利收益   | 28,833.98 |
| 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            | 28,833.98 |

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -2,500,608.98              |
| ——股票投资                     | -2,500,608.98              |
| ——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<br>增值税 | -                          |
| 合计                         | -2,500,608.98              |

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 401,675.65                 |
| 合计      | 401,675.65                 |

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。赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。对持续持有期小于30日（不含30日）的，赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日（含30日）但少于93日的，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于93日（含93日）但少于186日的，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于186日（含186日）的，将不低于赎回费总额的25%归基金财产。其余用于注册登记费和其他必要的手续费。其余用于注册登记费和其他必要的手续费。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 审计费用      | 29,752.78                  |
| 信息披露费     | 39,671.58                  |
| 证券出借违约金   | -                          |
| 银行费用      | 1,712.46                   |
| 证券组合费-深港通 | 1,607.21                   |
| 债券账户维护费   | -                          |
| 合计        | 72,744.03                  |

#### 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

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止 2023 年 08 月 22 日，本基金无须作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       |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，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>2023年1月1日至2023年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 312,295.97                     | 39,333.06                       |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 132,629.08                     | 17,188.98                       |

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，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

日基金管理费 = 前一日的基金资产净值 × 1.50% / 当年天数

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 52,049.32                  | 6,555.53                        |

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

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

### 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

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

### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 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<br>2023年1月1日至2023年6月30日 |          | 上年度可比期间<br>2022年1月1日至2022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 | 2,039,184.14               | 5,725.26 | 725,424.82                      | 1,759.27 |

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

本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期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

本期本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023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

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 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>2023年6月30<br>日 | 1年以内         | 1-5年 | 5年以上 | 不计息           | 合计            |
|-----------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产                    |              |      |      |               |               |
| 银行存款                  | 2,038,939.34 | -    | -    | 244.80        | 2,039,184.14  |
| 结算备付金                 | 142,663.28   | -    | -    | 223.18        | 142,886.46    |
| 存出保证金                 | 1,966.21     | -    | -    | 1.49          | 1,967.70      |
| 交易性金融资产               | -            | -    | -    | 29,549,655.11 | 29,549,655.11 |
| 应收股利                  | -            | -    | -    | 11,016.04     | 11,016.04     |
| 应收申购款                 | -            | -    | -    | 63,146.03     | 63,146.03     |
| 资产总计                  | 2,183,568.83 | -    | -    | 29,624,286.65 | 31,807,855.48 |
| 负债                    |              |      |      |               |               |
| 应付清算款                 | -            | -    | -    | 236,934.87    | 236,934.87    |

|                     |              |      |      |                |               |
|---------------------|--------------|------|------|----------------|---------------|
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 130,522.66     | 130,522.66    |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 39,323.84      | 39,323.84     |
| 应付托管费               | -            | -    | -    | 6,553.96       | 6,553.96      |
| 其他负债                | -            | -    | -    | 92,969.72      | 92,969.72     |
| 负债总计                | -            | -    | -    | 506,305.05     | 506,305.05    |
| 利率敏感度缺口             | 2,183,568.83 | -    | -    | -29,117,981.60 | 31,301,550.43 |
| 上年度末<br>2022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                | 5,858,795.64 | -    | -    | 703.45         | 5,859,499.09  |
| 结算备付金               | -            | -    | -    | 511.18         | 511.18        |
| 存出保证金               | -            | -    | -    | 0.45           | 0.45          |
| 交易性金融资产             | -            | -    | -    | 63,454,694.10  | 63,454,694.10 |
| 衍生金融资产              | -            | -    | -    | -              | -             |
| 买入返售金融资产            | -            | -    | -    | -              | -             |
| 应收清算款               | -            | -    | -    | 2,533,479.48   | 2,533,479.48  |
| 应收股利                | -            | -    | -    | 984.04         | 984.04        |
| 应收申购款               | -            | -    | -    | 1,777,616.04   | 1,777,616.04  |
| 其他资产                | -            | -    | -    | -              | -             |
| 资产总计                | 5,858,795.64 | -    | -    | 67,767,988.74  | 73,626,784.38 |
| 负债                  |              |      |      |                |               |
| 卖出回购金融资产款           | -            | -    | -    | -              | -             |
| 应付清算款               | -            | -    | -    | -              | -             |
| 应付赎回款               | -            | -    | -    | 6,151,057.61   | 6,151,057.61  |
| 应付管理人报酬             | -            | -    | -    | 64,237.50      | 64,237.50     |
| 应付托管费               | -            | -    | -    | 10,706.21      | 10,706.21     |
| 应交税费                | -            | -    | -    | -              | -             |
| 应付利润                | -            | -    | -    | -              | -             |
| 其他负债                | -            | -    | -    | 64,844.57      | 64,844.57     |
| 负债总计                | -            | -    | -    | 6,290,845.89   | 6,290,845.89  |
| 利率敏感度缺口             | 5,858,795.64 | -    | -    | -61,477,142.85 | 67,335,938.49 |

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

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 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目            | 本期末              |               |               |               |
|---------------|------------------|---------------|---------------|---------------|
|               | 2023 年 6 月 30 日  |               |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币      | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                  |               |               |               |
| 交易性金融资产       | -                | 29,549,655.11 | -             | 29,549,655.11 |
| 应收股利          | -                | 11,016.04     | -             | 11,016.04     |
| 资产合计          | -                | 29,560,671.15 | -             | 29,560,671.15 |
| 以外币计价的负债      |                  |               |               |               |
| 负债合计          | -                | -             | -             | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                | 29,560,671.15 | -             | 29,560,671.15 |
| 项目            | 上年度末             |               |               |               |
|               | 2022 年 12 月 31 日 |               |               |               |
|               | 美元<br>折合人民币      | 港币<br>折合人民币   | 其他币种<br>折合人民币 | 合计            |
| 以外币计价的资产      |                  |               |               |               |
| 交易性金融资产       | -                | 63,454,694.10 | -             | 63,454,694.10 |
| 应收股利          | -                | 984.04        | -             | 984.04        |
| 资产合计          | -                | 63,455,678.14 | -             | 63,455,678.14 |
| 以外币计价的负债      |                  |               |               |               |
| 负债合计          | -                | -             | -             | -             |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | -                | 63,455,678.14 | -             | 63,455,678.14 |

#### 6.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                         |                                 |                        |
|----|-------------------------|---------------------------------|------------------------|
| 假设 | 固定其它市场变量，当港币兑人民币汇率上涨 1% |                                 |                        |
|    | 固定其它市场变量，当港币兑人民币汇率下跌 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                         | 本期末（2023 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 基金净资产变动                 | 295,606.71                      | 634,556.78             |
|    | 基金净资产变动                 | -295,606.71                     | -634,556.78            |

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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、超短期融资券、公开发行的次级债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款、同业存单及其他银行存款）、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（但需符合中国证监会的相关规定）。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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 60%~95%，投资于港股通标的股票的比例不低于非现金基金资产的 80%，权证投资比例不超过基金资产净值的 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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基

金融资产净值的 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。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2023 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2022 年 12 月 31 日 |                       |
|---------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|-----------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                     | 占基金资<br>产净值比<br>例 (%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 29,549,655.11          | 94.40                    | 63,454,694.10            | 94.24                 |
| 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            | 29,549,655.11          | 94.40                    | 63,454,694.10            | 94.24                 |

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1% |                             |                        |
|----|----------------------|-----------------------------|------------------------|
|    | 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1% |                             |                        |
| 分析 | 相关风险变量的变动            | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                      | 本期末（2023 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2022 年 12 月 31 日） |
|    | 基金净资产变动              | 437,459.12                  | 943,531.18             |
|    | 基金净资产变动              | -437,459.12                 | -943,531.18            |

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果，其中，利用 2023 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 1.48。

### 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<br>2023年6月30日 | 上年度末<br>2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次          | 29,549,655.11     | 63,454,694.10       |
| 第二层次          | -                 | -                   |
| 第三层次          | -                 | -                   |
| 合计            | 29,549,655.11     | 63,454,694.10       |

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 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，其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              | 29,549,655.11 | 92.90         |
|    | 其中：股票             | 29,549,655.11 | 92.90         |
| 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      | 2,182,070.60  | 6.86          |
| 8  | 其他各项资产            | 76,129.77     | 0.24          |
| 9  | 合计                | 31,807,855.48 | 100.00        |

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项金额占基金总资产的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2 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

本报告期末本基金未投资境内股票。

#### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别      | 公允价值（人民币）     | 占基金资产净值比例 (%) |
|-----------|---------------|---------------|
| A 基础材料    | -             | -             |
| B 消费者非必需品 | 12,427,481.11 | 39.70         |
| C 消费者常用品  | -             | -             |
| D 能源      | -             | -             |
| E 金融      | 844,520.00    | 2.70          |
| F 医疗保健    | 3,213,500.00  | 10.27         |
| G 工业      | -             | -             |
| H 信息技术    | 6,650,180.00  | 21.25         |
| I 电信服务    | 6,413,974.00  | 20.49         |
| J 公用事业    | -             | -             |
| K 房地产     | -             | -             |
| 合计        | 29,549,655.11 | 94.40         |

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。



## 7.3 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  | 09868 | 小鹏汽车-W     | 60,000  | 2,766,000.00 | 8.84         |
| 2  | 03690 | 美团-W       | 22,280  | 2,512,292.80 | 8.03         |
| 3  | 02015 | 理想汽车-W     | 20,000  | 2,498,600.00 | 7.98         |
| 4  | 00268 | 金蝶国际       | 250,000 | 2,415,000.00 | 7.72         |
| 5  | 01928 | 金沙中国有限公司   | 98,000  | 2,412,760.00 | 7.71         |
| 6  | 01128 | 永利澳门       | 340,000 | 2,233,800.00 | 7.14         |
| 7  | 01024 | 快手-W       | 43,000  | 2,122,910.00 | 6.78         |
| 8  | 00700 | 腾讯控股       | 6,800   | 2,078,964.00 | 6.64         |
| 9  | 00285 | 比亚迪电子      | 76,000  | 1,660,600.00 | 5.31         |
| 10 | 09626 | 哔哩哔哩-W     | 13,500  | 1,452,600.00 | 4.64         |
| 11 | 00241 | 阿里健康       | 276,000 | 1,197,840.00 | 3.83         |
| 12 | 01833 | 平安好医生      | 58,000  | 1,012,680.00 | 3.24         |
| 13 | 06618 | 京东健康       | 22,000  | 1,002,980.00 | 3.20         |
| 14 | 01347 | 华虹半导体      | 40,000  | 944,000.00   | 3.02         |
| 15 | 03888 | 金山软件       | 32,000  | 910,080.00   | 2.91         |
| 16 | 06060 | 众安在线       | 43,000  | 844,520.00   | 2.70         |
| 17 | 00772 | 阅文集团       | 25,000  | 759,500.00   | 2.43         |
| 18 | 02382 | 舜宇光学科<br>技 | 10,000  | 720,500.00   | 2.30         |
| 19 | 09618 | 京东集团-SW    | 33      | 4,028.31     | 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  | 09626 | 哔哩哔哩-W | 1,888,056.75 | 2.80           |
| 2  | 00981 | 中芯国际   | 1,477,455.84 | 2.19           |
| 3  | 03888 | 金山软件   | 970,370.13   | 1.44           |
| 4  | 01347 | 华虹半导体  | 960,798.29   | 1.43           |
| 5  | 02588 | 中银航空租赁 | 722,803.54   | 1.07           |
| 6  | 00700 | 腾讯控股   | 548,594.30   | 0.81           |

|    |       |       |            |      |
|----|-------|-------|------------|------|
| 7  | 01833 | 平安好医生 | 444,952.94 | 0.66 |
| 8  | 06060 | 众安在线  | 406,225.73 | 0.60 |
| 9  | 06618 | 京东健康  | 238,817.43 | 0.35 |
| 10 | 00241 | 阿里健康  | 229,955.93 | 0.34 |
| 11 | 00268 | 金蝶国际  | 211,890.57 | 0.31 |
| 12 | 00772 | 阅文集团  | 160,248.07 | 0.24 |
| 13 | 03690 | 美团-W  | 127,057.56 | 0.19 |

#### 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  | 01347 | 华虹半导体    | 6,040,283.97 | 8.97            |
| 2  | 00700 | 腾讯控股     | 4,177,880.16 | 6.20            |
| 3  | 03888 | 金山软件     | 3,780,773.55 | 5.61            |
| 4  | 00772 | 阅文集团     | 3,466,300.42 | 5.15            |
| 5  | 00019 | 太古股份公司 A | 3,308,558.66 | 4.91            |
| 6  | 01024 | 快手-W     | 2,174,021.63 | 3.23            |
| 7  | 02015 | 理想汽车-W   | 2,157,480.72 | 3.20            |
| 8  | 00981 | 中芯国际     | 1,956,435.44 | 2.91            |
| 9  | 00268 | 金蝶国际     | 1,914,142.16 | 2.84            |
| 10 | 03690 | 美团-W     | 1,831,276.10 | 2.72            |
| 11 | 00241 | 阿里健康     | 1,377,393.66 | 2.05            |
| 12 | 06060 | 众安在线     | 1,364,337.08 | 2.03            |
| 13 | 00285 | 比亚迪电子    | 1,353,121.09 | 2.01            |
| 14 | 01928 | 金沙中国有限公司 | 1,330,627.06 | 1.98            |
| 15 | 01833 | 平安好医生    | 1,314,383.35 | 1.95            |
| 16 | 02382 | 舜宇光学科技   | 1,115,158.15 | 1.66            |
| 17 | 09868 | 小鹏汽车-W   | 953,435.14   | 1.42            |
| 18 | 06618 | 京东健康     | 899,854.96   | 1.34            |
| 19 | 02588 | 中银航空租赁   | 753,021.25   | 1.12            |
| 20 | 01128 | 永利澳门     | 704,101.52   | 1.05            |

#### 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 | 8,387,227.08 |
|--------------|--------------|

|              |               |
|--------------|---------------|
| 卖出股票收入（成交）总额 | 41,972,586.07 |
|--------------|---------------|

### 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

本基金本期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本期末无股指期货持仓。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额        |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 1,967.70  |
| 2  | 应收清算款 | -         |
| 3  | 应收股利  | 11,016.04 |
| 4  | 应收利息  | -         |
| 5  | 应收申购款 | 63,146.03 |
| 6  | 其他应收款 | -         |
| 7  | 待摊费用  | -         |

|   |    |           |
|---|----|-----------|
| 8 | 其他 | -         |
| 9 | 合计 | 76,129.77 |

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限的情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数<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 |
| 2,895        | 12,654.13     | 0.00  | 0.00%      | 36,633,694.14 | 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 | 10,821.53 | 0.03%    |

### 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（2019年3月28日）基金份额总额 | 257,244,734.29 |
| 本报告期期初基金份额总额              | 76,329,478.33  |
| 本报告期基金总申购份额               | 53,154,136.57  |
| 减：本报告期基金总赎回份额             | 92,849,920.76  |
| 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              | 36,633,694.14  |

## § 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

本报告期内本基金聘请致同会计师事务所(特殊普通合伙)，为本基金的审计机构。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期管理人及其高级管理人员无受到稽查或处罚情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到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 |    |
| 安信证券   | 1      | 50,359,813.15 | 100.00%      | 40,287.88 | 100.00%    | -  |
| 华泰证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中信证券   | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |
| 中金财富证券 | 1      | -             | -            | -         | -          | -  |

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

(1) 券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与中邮创业基金管理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、按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

### 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 |
| 安信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 华泰证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中信证券   | -    | -            | -      | -              | -    | -            |
| 中金财富证券 | -    | -            | -      | -              | -    | -            |

### 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项   | 法定披露方式 | 法定披露日期     |
|----|--|--------|------------|
| 1  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加上海陆金所基金销售有限公司费率优惠活动的公告 | 规定媒介   | 2023年7月31日 |
| 2  | 中邮沪港深精选混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告                | 规定媒介   | 2023年7月21日 |
| 3  | 中邮沪港深精选混合型证券投资基金暂停申购、赎回业务公告                    | 规定媒介   | 2023年7月18日 |



|    |  |      |                 |
|----|--|------|-----------------|
| 4  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告   | 规定媒介 | 2023 年 6 月 30 日 |
| 5  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在江海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 | 2023 年 6 月 14 日 |
| 6  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告 | 规定媒介 | 2023 年 5 月 11 日 |
| 7  | 中邮沪港深精选混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告                          | 规定媒介 | 2023 年 4 月 22 日 |
| 8  | 中邮沪港深精选混合型证券投资基金 2022 年年度报告                              | 规定媒介 | 2023 年 3 月 30 日 |
| 9  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海中欧财富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 | 2023 年 3 月 23 日 |
| 10 | 关于更新中邮沪港深精选混合型证券投资基金 2023 年非港股通交易日暂停申购、赎回等交易类业务的公告       | 规定媒介 | 2023 年 3 月 7 日  |
| 11 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加博时财富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 | 2023 年 2 月 6 日  |
| 12 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益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 | 2023 年 2 月 6 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南京证券股份有限公司申购及定投起点金额的公告          | 规定媒介 | 2023 年 2 月 1 日  |
| 14 | 中邮沪港深精选混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告                          | 规定媒介 | 2023 年 1 月 20 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

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沪港深精选混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮沪港深精选混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮沪港深精选混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮沪港深精选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

2023 年 8 月 31 日