

中邮核心优势灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（简称：中国农业银行）根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更正。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	41
7.1 期末基金资产组合情况.....	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47
7.12 投资组合报告附注.....	47
§8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
§9 开放式基金份额变动.....	50
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
10.8 其他重大事件.....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55

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。
§12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮核心优势灵活配置混合
基金主代码	590003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 10 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	573,374,672.28 份

2.2 基金产品说明

投资目标	通过合理的动态资产配置，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，充分挖掘和利用中国经济结构调整过程中的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	通过对宏观经济形势以及市场状况的深入分析，采用灵活的大类资产配置策略，应用系统化的风险管理工具准确跟踪和全程监控投资组合风险，力求在较低的风险水平上，为投资者提供超越业绩比较基准的收益。本基金重点投资核心优势企业，因为这类企业能够获得持续稳定的发展以及超过行业平均水平的超额利润，投资这类公司能够增强基金对证券市场系统性风险的抵御能力，充分分享中国经济结构调整过程中的投资机会，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金股票投资部分的业绩比较基准是沪深 300 指数，债券部分的业绩比较基准为上证国债指数。 整体业绩比较基准=沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	秦一楠
	联系电话	010-82295160-157	010-66060069
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-58511618	95599

传真	010-82295155	010-68121816
注册地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100013	100031
法定代表人	毕劲松	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	-196,277,861.01
本期利润	-60,323,459.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0826
本期加权平均净值利润率	-2.56%
本期基金份额净值增长率	1.06%
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	864,045,020.39
期末可供分配基金份额利润	1.5069
期末基金资产净值	1,753,784,293.38
期末基金份额净值	3.059
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	260.32%

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	3.59%	1.24%	0.88%	0.52%	2.71%	0.72%
过去三个月	-7.22%	1.15%	-2.53%	0.49%	-4.69%	0.66%
过去六个月	1.06%	1.09%	0.50%	0.51%	0.56%	0.58%
过去一年	-8.19%	1.48%	-7.25%	0.59%	-0.94%	0.89%
过去三年	93.00%	1.84%	0.67%	0.72%	92.33%	1.12%
自基金合同生效起至今	260.32%	1.60%	44.98%	0.84%	215.34%	0.76%

注：1. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2. 关于业绩基准的说明

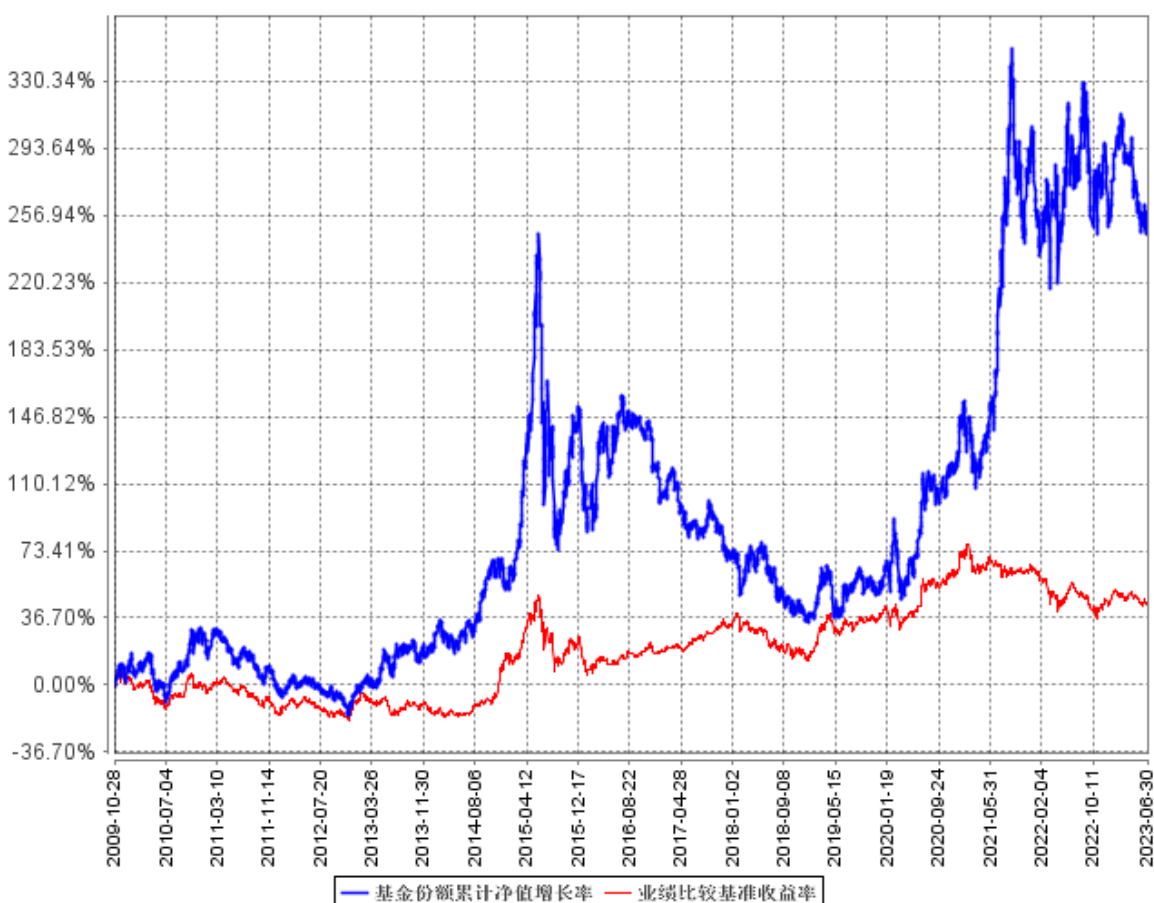
本基金业绩衡量基准=沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%

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

由于基金资产配置比例处于动态变化的过程中，需要通过再平衡来使资产的配置比例符合基金合同要求，基准指数中沪深 300 指数和上海国债指数每日分别计算收益率，然后按 60%、40%的比例采取再平衡，再用循环计算的方式得到基准指数的时间序列。

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按相关法规规定，本基金自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期。报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关约定。

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		
张腾	基金经理	2015年3月18日	-	12年	工学硕士，曾任申银万国证券研究所研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼行业研究员、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
江刘玮	基金经理	2023年6月28日	-	7年	曾任中国出口信用保险公司资产管理事业部研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员、固定收益部研究员、中邮货币市场基金基金经理助理、中邮核心优选混合型证券投资基金基金经理助理、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理助理、中邮睿信增强债券型证券投资基金基金经理。现任中邮景泰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、中邮核心竞争力灵活配置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 11 日，张腾卸任中邮核心优势灵活配置混合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

整体回顾 23 年上半年，我们认为市场整体存在三条交易线索：1) 去年底至今年初，国内宏观经济复苏预期强烈，但经过三四月份传统工业品旺季的经验，以及二季度基数效应等原因，实际的复苏力度较为平滑；2) 5 月份美联储议息会议之前，市场对于美联储货币政策转向预期强烈，但实际仍维持鹰派；3) 以人工智能为代表的新科技领域迎来了产业趋势的快速上行期。

综合上述三条线索回看 23 年上半年市场运行的节奏也较为清晰：

1) 年初至 2 月份，国内复苏预期强烈、美联储货币政策转向预期强烈、人工智能产业趋势初

显。在此阶段，以钼、锑等小金属为代表的工业品，以黄金为代表的贵金属，以及计算机、传媒等人工智能核心方向均出现了上涨。我们基于中长期资源品价值重估逻辑以及自身能力范围，在此阶段重点配置了小金属和贵金属方向，以及氢能等方向的长久期资产。

2) 3 月份至 5 月份，国内宏观经济复苏预期逐步走弱，而美联储货币政策转向预期依旧维持，我们逐步减仓了部分小金属标的，并加仓了贵金属板块。

3) 5 月份至 6 月底，我们认为市场对于国内宏观经济预期已过度悲观，而下半年工业品库存周期拐点有望开始出现，我们逐步开始布局了铜等核心工业品以及部分估值合理的小金属标的。另外，在新科技周期趋势上行、同时工业品库存周期仍处于左侧阶段的情况下，我们择机配置了部分新技术、新材料标的。

整体来看，我们在过去“碳中和”框架的基础上，进一步将其和经典周期框架相结合，并进一步扩大自身的能力圈范围，在保持长期战略稳定的情况下，通过选择短期性价比和胜率更好的具体细分方向，争取进一步提升组合收益曲线的稳定性和弹性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.059 元，累计净值为 3.239 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.06%，业绩比较基准收益率为 0.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来半年到一年维度，我们认为国内和海外宏观环境均有望出现新的拐点。国内来看，根据历史经验以及我们的高频数据跟踪，认为国内工业品库存周期拐点有望在今年下半年到明年初出现；海外来看，美联储有望在年内结束加息周期，边际上有望转鸽。

根据历史上类似阶段的 A 股和其他大类资产表现，我们认为以铜铝和小金属为代表的供需格局较好的资源品有望逐步进入上行周期；而以黄金为代表的贵金属板块、特别是部分具备估值和成长性优势的差异化个股仍有上行空间。

另外，我们认为国内传统制造业正在经历由大变强的阶段，我们长期看好部分具备核心竞争力和长期成长性的新能源、新材料标的，因此精选了部分基本面优质且估值合理的相关标的进行配置。后续，我们也会持续对该方向进行跟踪和动态评估，并根据个股基本面和估值情况进行动态调整。

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，未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、基金托管协议的约定，对本基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，中邮创业基金管理股份有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中邮核心优势灵活配置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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	80,681,824.71	25,079,950.01
结算备付金		3,525,568.03	4,115,072.30
存出保证金		716,632.73	679,596.71
交易性金融资产	6.4.7.2	1,845,639,924.27	1,984,779,533.55
其中：股票投资		1,315,486,077.37	1,518,030,460.55
基金投资		-	-
债券投资		530,153,846.90	466,749,073.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		708,854.06	1,019,104.80
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,931,272,803.80	2,015,673,257.37
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		150,041,664.88	98,043,883.26
应付清算款		10,508,171.93	-

应付赎回款		1,262,790.95	1,396,389.65
应付管理人报酬		2,338,721.53	2,516,222.35
应付托管费		389,786.95	419,370.42
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,923,249.69	9,922,458.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,024,124.49	1,975,210.60
负债合计		177,488,510.42	114,273,534.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	573,374,672.28	628,214,008.31
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,180,409,621.10	1,273,185,714.57
净资产合计		1,753,784,293.38	1,901,399,722.88
负债和净资产总计		1,931,272,803.80	2,015,673,257.37

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.059 元，基金份额总额 573,374,672.28 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮核心优势灵活配置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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-37,996,310.85	55,796,294.76
1.利息收入		567,724.09	729,120.57
其中：存款利息收入	6.4.7.13	567,724.09	729,120.57
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）		-176,087,302.57	-2,186,332.64
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-188,472,747.62	-4,578,634.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-26,399,030.78	-17,689,265.56
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	38,784,475.83	20,081,567.23
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	135,954,401.95	56,228,824.15
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	1,568,865.68	1,024,682.68
减：二、营业总支出		22,327,148.21	10,881,520.77
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	17,445,026.58	8,927,710.77
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,907,504.43	1,487,951.78
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,821,738.86	319,088.58
其中：卖出回购金融资产支出		1,821,738.86	319,088.58
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		4,212.80	1,313.20
8. 其他费用	6.4.7.23	148,665.54	145,456.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-60,323,459.06	44,914,773.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-60,323,459.06	44,914,773.99
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-60,323,459.06	44,914,773.99

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中邮核心优势灵活配置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 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）	628,214,008.31	-	1,273,185,714.57	1,901,399,722.88
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）	628,214,008.31	-	1,273,185,714.57	1,901,399,722.88

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-54,839,336.03	-	-92,776,093.47	-147,615,429.50
(一)、综合收益总额	-	-	-60,323,459.06	-60,323,459.06
(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)	-54,839,336.03	-	-32,452,634.41	-87,291,970.44
其中: 1.基金申购款	400,226,256.92	-	932,507,302.58	1,332,733,559.50
2.基金赎回款	-455,065,592.95	-	-964,959,936.99	-1,420,025,529.94
(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)	573,374,672.28	-	1,180,409,621.10	1,753,784,293.38
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	337,692,404.09	-	739,580,387.80	1,077,272,791.89
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)	337,692,404.09	-	739,580,387.80	1,077,272,791.89
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	215,175,293.18	-	549,621,790.83	764,797,084.01
(一)、综合收益总额	-	-	44,914,773.99	44,914,773.99
(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)	215,175,293.18	-	504,707,016.84	719,882,310.02
其中: 1.基金申购款	397,339,299.05	-	879,785,285.39	1,277,124,584.44

2.基金赎回款	-182,164,005.87	-	-375,078,268.55	-557,242,274.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	552,867,697.27	-	1,289,202,178.63	1,842,069,875.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 张志名 唐亚明 佟 姗
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮核心优势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[2009]811号《关于核准中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于2009年10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3,942,346,068.45元，业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字(2009)第079号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮核心优势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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券及法律、法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的30%~80%，债券资产占基金资产的15%~65%，权证占基金资产净值的0%~3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于核心优势企业的股票比例不低于基金股票资产的80%。

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》、财政部发布的《资产管理产品相关会计处理规定》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》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净资产变动情况等有关信息。

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 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[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。

本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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。

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。

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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	80,681,824.71
等于：本金	80,668,342.35
加：应计利息	13,482.36
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：	80,681,824.71

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,344,441,122.80	-	1,315,486,077.37	-28,955,045.43	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	559,125,155.02	2,360,057.98	530,153,846.90	-31,331,366.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	559,125,155.02	2,360,057.98	530,153,846.90	-31,331,366.10
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	1,903,566,277.82	2,360,057.98	1,845,639,924.27	-60,286,411.53	

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返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

6.4.7.5 债权投资

本基金本期末未有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本期末未有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本期末未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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,538.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	2,264,909.93
其中：交易所市场	2,264,909.93
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	659,014.74
其他	96,661.47
合计	3,024,124.49

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	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	628,214,008.31	628,214,008.31
本期申购	400,226,256.92	400,226,256.92
本期赎回(以“-”号填列)	-455,065,592.95	-455,065,592.95
- 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	573,374,672.28	573,374,672.28

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	1,144,163,884.81	129,021,829.76	1,273,185,714.57
本期利润	-196,277,861.01	135,954,401.95	-60,323,459.06
本期基金份额交易产生的变动数	-83,841,003.41	51,388,369.00	-32,452,634.41
其中：基金申购款	717,388,284.18	215,119,018.40	932,507,302.58
基金赎回款	-801,229,287.59	-163,730,649.40	-964,959,936.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	864,045,020.39	316,364,600.71	1,180,409,621.10

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	485,590.92
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	47,530.57
其他	34,602.60
合计	567,724.09

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	3,167,066,722.19
减：卖出股票成本总额	3,347,210,519.28
减：交易费用	8,328,950.53
买卖股票差价收入	-188,472,747.62

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,707,893.92
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-29,106,924.70
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-26,399,030.78

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	451,654,712.77
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	477,079,012.46
减：应计利息总额	3,655,297.51
减：交易费用	27,327.50
买卖债券差价收入	-29,106,924.70

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本报告期间，本基金无资产支持证券投资。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本报告期间，本基金无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

本报告期本基金无衍生工具投资。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	38,784,475.83
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	38,784,475.83

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	135,954,401.95
——股票投资	121,972,973.05
——债券投资	13,981,428.90
——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	135,954,401.95

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,145,492.95
转换费收入	423,372.73
合计	1,568,865.68

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	11,050.80
上清所债券账户维护费	9,600.00
中债债券账户维护费	9,000.00
其他	-
合计	148,665.54

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

本报告期末发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

中邮创业基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
首誉光控资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

6.4.10.1.2 权证交易

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 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	17,445,026.58	8,927,710.77
其中：支付销售机构的客户维护费	3,829,011.73	2,585,436.80

注：支付基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值的1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 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	2,907,504.43	1,487,951.78

注：支付基金托管人中国农业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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
报告期初持有的基金份额	7,504,255.55	2,991,921.01
报告期间申购/买入总份额	-	4,512,334.54
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	7,504,255.55	7,504,255.55
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.31%	1.36%

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

份额单位：份

关联方名	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日

称	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
首创证券股份有限公司	1,807,036.47	0.32%	4,422,270.20	0.70%
首誉光控资产管理有限公司	5,612,518.87	0.98%	5,612,518.87	0.89%

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 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
中国农业银行股份有限公司	80,681,824.71	485,590.92	36,359,201.41	673,955.08

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

本报告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/增发证券而持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场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

截至本报告期末 2023 年 06 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 150,041,664.88 元,于 2023 年 07 月 10 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的金额。

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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	146,676,635.76	101,448,901.61
合计	146,676,635.76	101,448,901.61

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	53,767,399.88	1,156,360.73
AAA 以下	329,687,075.67	364,121,997.00
未评级	22,735.59	21,813.66
合计	383,477,211.14	365,300,171.39

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

如果遇到极端市场情形或发生巨额赎回情形，公司将采取本基金合同约定的巨额赎回申请处理方式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 2023 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	80,668,342.35	-	-	13,482.36	80,681,824.71
结算备付金	3,524,140.81	-	-	1,427.22	3,525,568.03
存出保证金	716,342.57	-	-	290.16	716,632.73
交易性金融资产	145,116,357.00	339,943,429.42	42,734,002.50	1,317,846,135.35	1,845,639,924.27
应收申购款	-	-	-	708,854.06	708,854.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	230,025,182.73	339,943,429.42	42,734,002.50	1,318,570,189.15	1,931,272,803.80
负债					
卖出回购金融资产款	150,000,000.00	-	-	41,664.88	150,041,664.88
应付清算款	-	-	-	10,508,171.93	10,508,171.93
应付赎回款	-	-	-	1,262,790.95	1,262,790.95
应付管理人报酬	-	-	-	2,338,721.53	2,338,721.53
应付托管费	-	-	-	389,786.95	389,786.95
应交税费	-	-	-	9,923,249.69	9,923,249.69
其他负债	-	-	-	3,024,124.49	3,024,124.49
负债总计	150,000,000.00	-	-	27,488,510.42	177,488,510.42

总计					
利率敏感缺口	80,025,182.73	339,943,429.42	42,734,002.50	1,291,081,678.73	1,753,784,293.38
上年度末 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	25,066,384.88	-	-	13,565.13	25,079,950.01
结算备付金	4,113,221.30	-	-	1,851.00	4,115,072.30
存出保证金	679,291.01	-	-	305.70	679,596.71
交易性金融资产	100,143,712.00	275,788,965.48	88,919,487.14	1,519,927,368.93	1,984,779,533.55
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,019,104.80	1,019,104.80
其他资产	-	-	-	-	-
资产	130,002,609.19	275,788,965.48	88,919,487.14	1,520,962,195.56	2,015,673,257.37

总计					
负债					
卖出回购金融资产款	98,000,000.00	-	-	43,883.26	98,043,883.26
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,396,389.65	1,396,389.65
应付管理人报酬	-	-	-	2,516,222.35	2,516,222.35
应付托管费	-	-	-	419,370.42	419,370.42
应交税费	-	-	-	9,922,458.21	9,922,458.21
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	1,975,210.60	1,975,210.60
负债总计	98,000,000.00	-	-	16,273,534.49	114,273,534.49
利率敏感度缺口	32,002,609.19	275,788,965.48	88,919,487.14	1,504,688,661.07	1,901,399,722.88

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变		
	市场利率下降 25 个基点且其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）

	基金净资产变动	-4,002,429.22	-3,715,354.73
	基金净资产变动	4,110,205.11	3,818,414.33

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、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%~80%，债券资产占基金资产的 15%~65%，权证占基金资产净值的 0%~3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于核心优势企业的股票比例不低于基金股票资产的 80%。

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：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	1,315,486,077.37	75.01	1,518,030,460.55	79.84
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	530,153,846.90	30.23	466,749,073.00	24.55
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	1,845,639,924.27	105.24	1,984,779,533.55	104.39

注：由于四舍五入的原因各项资产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。

6.4.13.4.2.2 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	26,840,965.99	30,737,526.22
	基金净资产变动	-26,840,965.99	-30,737,526.22

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 1.45。

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,723,907,500.87	1,883,308,818.28
第二层次	121,732,423.40	101,470,715.27
第三层次	-	-
合计	1,845,639,924.27	1,984,779,533.55

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	1,315,486,077.37	68.11
	其中：股票	1,315,486,077.37	68.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	530,153,846.90	27.45
	其中：债券	530,153,846.90	27.45
	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	84,207,392.74	4.36
8	其他各项资产	1,425,486.79	0.07
9	合计	1,931,272,803.80	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

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	257,672.80	0.01
B	采矿业	362,672,745.78	20.68
C	制造业	861,813,548.15	49.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,270,260.00	0.24
E	建筑业	16,560.00	0.00
F	批发和零售业	14,470,000.00	0.83
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	26,950,031.44	1.54
J	金融业	6,393.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,239,171.20	0.64
N	水利、环境和公共设施管理业	17,820,000.00	1.02

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	15,969,695.00	0.91
S	综合	-	-
	合计	1,315,486,077.37	75.01

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

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	000960	锡业股份	8,463,885	131,613,411.75	7.50
2	002984	森麒麟	2,929,492	92,161,818.32	5.26
3	603993	洛阳钼业	16,099,943	85,812,696.19	4.89
4	300423	昇辉科技	6,800,000	83,096,000.00	4.74
5	601899	紫金矿业	7,247,385	82,402,767.45	4.70
6	600489	中金黄金	5,300,000	54,749,000.00	3.12
7	601966	玲珑轮胎	2,418,470	53,738,403.40	3.06
8	000807	云铝股份	4,058,000	51,658,340.00	2.95
9	601600	中国铝业	8,000,000	43,920,000.00	2.50
10	000060	中金岭南	8,499,945	40,374,738.75	2.30
11	000426	兴业银锡	4,500,000	39,960,000.00	2.28
12	000589	贵州轮胎	6,741,140	37,750,384.00	2.15
13	300109	新开源	1,514,100	37,655,667.00	2.15
14	002756	永兴材料	559,924	35,056,841.64	2.00
15	600326	西藏天路	5,000,000	33,650,000.00	1.92
16	002182	云海金属	1,500,000	32,985,000.00	1.88
17	600160	巨化股份	2,200,168	30,318,315.04	1.73
18	600547	山东黄金	1,200,000	28,176,000.00	1.61
19	002532	天山铝业	4,334,805	25,965,481.95	1.48
20	002738	中矿资源	499,980	25,468,981.20	1.45
21	600426	华鲁恒升	800,000	24,504,000.00	1.40
22	002155	湖南黄金	1,999,978	24,399,731.60	1.39
23	301398	星源卓镁	647,800	24,292,500.00	1.39
24	601958	金钼股份	1,999,980	22,299,777.00	1.27

25	000917	电广传媒	3,000,000	21,930,000.00	1.25
26	601225	陕西煤业	1,000,000	18,190,000.00	1.04
27	600475	华光环能	1,500,000	17,820,000.00	1.02
28	002601	龙佰集团	1,000,000	16,500,000.00	0.94
29	603721	中广天择	860,900	15,969,695.00	0.91
30	600546	山煤国际	1,000,000	14,470,000.00	0.83
31	600389	江山股份	499,973	11,874,358.75	0.68
32	603776	永安行	780,498	11,239,171.20	0.64
33	600301	华锡有色	600,000	10,770,000.00	0.61
34	000933	神火股份	801,914	10,424,882.00	0.59
35	600731	湖南海利	1,000,000	7,770,000.00	0.44
36	300183	东软载波	300,000	4,953,000.00	0.28
37	600452	涪陵电力	200,000	4,256,000.00	0.24
38	601666	平煤股份	554,001	4,177,167.54	0.24
39	601001	晋控煤业	266,600	2,495,376.00	0.14
40	605296	神农集团	10,000	214,200.00	0.01
41	600406	国电南瑞	2,880	66,528.00	0.00
42	002460	赣锋锂业	940	57,302.40	0.00
43	000400	许继电气	2,000	46,100.00	0.00
44	600089	特变电工	2,000	44,580.00	0.00
45	688063	派能科技	200	39,650.00	0.00
46	000998	隆平高科	2,000	30,700.00	0.00
47	600486	扬农化工	200	17,484.00	0.00
48	601117	中国化学	2,000	16,560.00	0.00
49	688036	传音控股	100	14,700.00	0.00
50	600025	华能水电	2,000	14,260.00	0.00
51	300274	阳光电源	100	11,663.00	0.00
52	601058	赛轮轮胎	836	9,522.04	0.00
53	002714	牧原股份	200	8,430.00	0.00
54	601088	中国神华	200	6,150.00	0.00
55	603868	飞科电器	79	4,984.11	0.00
56	300087	荃银高科	420	4,342.80	0.00
57	601012	隆基绿能	140	4,013.80	0.00
58	300505	川金诺	200	3,554.00	0.00
59	601689	拓普集团	40	3,228.00	0.00
60	601069	西部黄金	200	2,568.00	0.00
61	002142	宁波银行	100	2,530.00	0.00
62	603218	日月股份	100	1,899.00	0.00
63	002497	雅化集团	100	1,778.00	0.00

64	000708	中信特钢	100	1,584.00	0.00
65	601166	兴业银行	100	1,565.00	0.00
66	000968	蓝焰控股	200	1,512.00	0.00
67	000338	潍柴动力	100	1,246.00	0.00
68	600926	杭州银行	100	1,175.00	0.00
69	600499	科达制造	100	1,136.00	0.00
70	000001	平安银行	100	1,123.00	0.00
71	002063	远光软件	58	503.44	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600277	亿利洁能	144,085,707.31	7.58
2	603776	永安行	142,056,205.28	7.47
3	000960	锡业股份	137,383,339.33	7.23
4	600547	山东黄金	137,152,442.80	7.21
5	002182	云海金属	127,400,873.69	6.70
6	600256	广汇能源	126,695,013.99	6.66
7	600489	中金黄金	123,103,368.57	6.47
8	000975	银泰黄金	104,497,112.89	5.50
9	000933	神火股份	103,621,808.47	5.45
10	603993	洛阳钼业	88,853,371.08	4.67
11	601899	紫金矿业	86,325,549.25	4.54
12	002532	天山铝业	82,073,819.55	4.32
13	600348	华阳股份	80,868,923.97	4.25
14	600546	山煤国际	80,298,350.48	4.22
15	601699	潞安环能	76,734,966.56	4.04
16	601225	陕西煤业	74,021,819.20	3.89
17	600475	华光环能	72,255,473.16	3.80
18	600988	赤峰黄金	63,739,154.18	3.35
19	601966	玲珑轮胎	57,740,755.74	3.04
20	000629	钒钛股份	56,858,860.00	2.99
21	301398	星源卓镁	53,818,919.16	2.83
22	000426	兴业银锡	52,567,558.28	2.76

23	002460	赣锋锂业	52,306,574.60	2.75
24	601600	中国铝业	47,226,115.10	2.48
25	000060	中金岭南	41,650,344.26	2.19
26	002466	天齐锂业	40,693,673.00	2.14

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	000933	神火股份	235,823,070.34	12.40
2	601225	陕西煤业	216,973,078.10	11.41
3	600256	广汇能源	209,392,560.59	11.01
4	600546	山煤国际	156,816,102.19	8.25
5	600547	山东黄金	143,685,386.00	7.56
6	000975	银泰黄金	133,626,217.40	7.03
7	600348	华阳股份	125,448,031.83	6.60
8	300174	元力股份	115,098,422.32	6.05
9	002532	天山铝业	112,286,050.00	5.91
10	601699	潞安环能	108,193,394.14	5.69
11	300471	厚普股份	106,064,061.62	5.58
12	600277	亿利洁能	104,292,254.19	5.49
13	603776	永安行	99,475,033.68	5.23
14	002733	雄韬股份	87,439,726.09	4.60
15	000807	云铝股份	86,441,195.53	4.55
16	600860	京城股份	85,445,276.23	4.49
17	600988	赤峰黄金	76,759,294.20	4.04
18	002182	云海金属	73,449,430.00	3.86
19	600489	中金黄金	73,351,218.53	3.86
20	300423	昇辉科技	64,617,775.49	3.40
21	600475	华光环能	55,185,859.87	2.90
22	002460	赣锋锂业	50,463,111.20	2.65
23	000629	钒钛股份	49,333,846.70	2.59
24	601058	赛轮轮胎	40,225,828.80	2.12
25	002466	天齐锂业	39,297,556.00	2.07

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	3,022,693,163.05
卖出股票收入（成交）总额	3,167,066,722.19

注：买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	121,709,813.25	6.94
2	央行票据	-	-
3	金融债券	22,610.15	0.00
	其中：政策性金融债	22,610.15	0.00
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	408,421,423.50	23.29
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	530,153,846.90	30.23

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127043	川恒转债	468,303	59,598,472.24	3.40
2	113615	金诚转债	206,200	58,854,931.59	3.36
3	019688	22 国债 23	563,000	56,930,143.53	3.25
4	113025	明泰转债	250,000	53,852,363.01	3.07
5	113609	永安转债	362,280	43,498,959.60	2.48

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与股指期货的投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、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	716,632.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	708,854.06
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,425,486.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127043	川恒转债	59,598,472.24	3.40
2	113615	金诚转债	58,854,931.59	3.36
3	113025	明泰转债	53,852,363.01	3.07
4	113609	永安转债	43,498,959.60	2.48
5	127063	贵轮转债	40,426,747.26	2.31
6	127050	麒麟转债	36,510,728.67	2.08

7	128017	金禾转债	24,966,947.95	1.42
8	110061	川投转债	23,659,093.60	1.35
9	113641	华友转债	23,227,833.09	1.32
10	113063	赛轮转债	13,716,846.58	0.78
11	113053	隆 22 转债	1,071,551.78	0.06
12	132018	G 三峡 EB1	14,186.10	0.00
13	127061	美锦转债	193.63	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未前十名股票中不存在流通受限股票。

§ 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
71,284	8,043.53	261,035,183.08	45.53%	312,339,489.20	54.47%

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	57,865.48	0.01%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2009 年 10 月 28 日 ）基金份额总额	3,942,346,068.45
本报告期期初基金份额总额	628,214,008.31
本报告期基金总申购份额	400,226,256.92
减：本报告期基金总赎回份额	455,065,592.95
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	573,374,672.28

§ 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

本基金管理人、托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
华西证券	2	2,365,435,313.89	38.22%	1,729,829.04	37.00%	-
华福证券	2	1,297,296,720.00	20.96%	948,713.47	20.29%	-
国盛证券	1	1,176,897,153.93	19.01%	860,649.77	18.41%	-
东方财富证券	2	609,603,236.25	9.85%	445,816.14	9.54%	-
申万宏源	1	531,956,467.88	8.59%	495,414.94	10.60%	-

中信证券	1	208,570,993.29	3.37%	194,241.49	4.16%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-

注：：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

(1) 券商经纪人财务状况良好、经营行为规范、风险管理先进、投资风格与中邮创业基金管理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
华西证券	243,523,623.35	26.41%	588,000,000.00	22.24%	-	-
华福证券	94,292,127.00	10.23%	534,000,000.00	20.20%	-	-
国盛证券	285,630,739.98	30.98%	819,104,000.00	30.98%	-	-
东方财富证券	217,376,033.64	23.58%	245,200,000.00	9.27%	-	-
申万宏源	74,882,987.76	8.12%	289,040,000.00	10.93%	-	-
中信证券	6,250,218.52	0.68%	168,682,000.00	6.38%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中邮核心优势灵活配置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
2	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	规定媒介	2023 年 7 月 12 日
3	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 招募说明书（更新）	规定媒介	2023 年 7 月 12 日
4	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 基金产品资料概要	规定媒介	2023 年 7 月 12 日

	(更新)		
5	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 基金产品资料概要 (更新)	规定媒介	2023 年 6 月 30 日
6	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书 (更新)	规定媒介	2023 年 6 月 30 日
7	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理变更公告	规定媒介	2023 年 6 月 30 日
8	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
9	中邮核心优势灵活配置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
10	中邮创业基金管理股份有限公司关于在直销中心开通基金 转换业务及参加转换补差费率优惠活动的公告	规定媒介	2023 年 4 月 10 日
11	中邮核心优势灵活配置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
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
13	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加深圳前海微众 银行股份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 23 日
14	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
15	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
16	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
17	中邮核心优势灵活配置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核心优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮核心优势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

2023 年 8 月 31 日