

# 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金管理人—中邮创业基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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。

本中期报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 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.....                         | 7          |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 7          |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 7          |
| <b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                | <b>8</b>   |
| 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.....                                | 错误! 未定义书签。 |
| <b>§4 管理人报告</b> .....                        | <b>10</b>  |
| 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.....              | 11         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11         |
| 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.....             | 12         |
| 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.....                 | 13         |
| 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.....       | 13         |
| <b>§5 托管人报告</b> .....                        | <b>14</b>  |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....                  | 14         |
| 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..... | 14         |
| 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.....      | 14         |
| <b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....              | <b>15</b>  |
| 6.1 资产负债表.....                               | 15         |
| 6.2 利润表.....                                 | 16         |

|  |           |
|--|-----------|
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                    | 17        |
| 6.4 报表附注.....                              | 18        |
| <b>§7 投资组合报告.....</b>                      | <b>43</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                        | 43        |
| 7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 43        |
| 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.....     | 44        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                   | 49        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                  | 50        |
| 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.....    | 51        |
| 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..... | 51        |
| 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..... | 51        |
| 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.....    | 51        |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....             | 51        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....             | 52        |
| 7.12 市场中性策略执行情况.....                       | 52        |
| 7.13 投资组合报告附注.....                         | 52        |
| <b>§8 基金份额持有人信息.....</b>                   | <b>54</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                 | 54        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....              | 54        |
| 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.....     | 54        |
| 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....                   | 54        |
| <b>§9 开放式基金份额变动.....</b>                   | <b>55</b> |
| <b>§10 重大事件揭示.....</b>                     | <b>56</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                      | 56        |
| 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.....      | 56        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....           | 56        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                        | 56        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....                 | 56        |
| 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.....         | 56        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....                | 56        |

|   |           |
|---|-----------|
| 10.8 其他重大事件.....                        | 57        |
| <b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>          | <b>59</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..... | 59        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....                | 59        |
| <b>§12 备查文件目录.....</b>                  | <b>60</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                        | 60        |
| 12.2 存放地点.....                          | 60        |
| 12.3 查阅方式.....                          | 60        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                          |
|------------|--------------------------|
| 基金名称       | 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 |
| 基金简称       | 中邮绝对收益策略定期开放混合           |
| 基金主代码      | 002224                   |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                   |
| 基金合同生效日    | 2015 年 12 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      | 兴业银行股份有限公司               |
| 报告期末基金份额总额 | 745,953,639.35 份         |

### 2.2 基金产品说明

|      |   |
|------|---|
| 投资目标 | 本基金将灵活应用各种金融工具和风险对冲策略降低投资组合风险，实现基金资产的长期稳健增值。  |
| 投资策略 | <p>本策略积极依托基金管理人投研平台的研究能力进行积极主动的个股选择策略，通过定量与定性相结合的分析方法考量上市公司的盈利状况、估值水平、市场情绪、股价催化剂等因素，辅以量化投资模型从基金管理人的股票库中精选股票，努力获取超额收益，同时在金融衍生品市场上对冲，剥离系统性风险，力争实现较为稳定的绝对收益。在构建投资组合的过程中，本基金将遵循以下投资策略：</p> <p>1、定性与定量相结合构建股票组合</p> <p>本基金选取具有良好投资价值的股票作为投资对象，以深入的基本面研究为基础，采取自下而上的方法，通过定量和定性相结合的方法精选个股。</p> <p>2、市场中性策略</p> <p>现阶段本基金将利用股指期货对冲多头股票部分的系统性风险。</p> <p>（二）其他绝对收益策略</p> <p>1、固定收益品种投资策略</p> <p>本基金投资债券首先综合考量股票组合及股指期货套期保值对资金的需求，对闲置资金投资债券做出规划，包括债券组合的规模、投资期限、期间的流动性安排等。然后在这些约束条件下，综合运用估值策略、久期管理策略、利率预期策略等多种方法，结合债券的流动性、信用风险分析等多种因素，对个券进行积极的管理。</p> <p>2、衍生品投资策略</p> <p>本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | 用数量方法发掘可能的套利机会。  |
| 业绩比较基准 | 本基金整体业绩比较基准构成为：金融机构人民币一年期定期存款基准利率（税后）+2%   |
| 风险收益特征 | 本基金为特殊的混合型基金，通过采用多种绝对收益策略剥离市场系统性风险，与股票市场表现的相关性较低。相对股票型基金和一般的混合型基金，其预期风险较小。本基金实际的收益和风险主要取决于基金投资策略的有效性，因此收益不一定能超越业绩比较基准。 |

### 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        | 兴业银行股份有限公司            |
| 信息披露负责人 | 姓名   | 侯玉春                   | 龚小武                   |
|         | 联系电话 | 010-82295160-157      | 021-52629999-212056   |
|         | 电子邮箱 | houyc@postfund.com.cn | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话  |      | 010-58511618          | 95561                 |
| 传真      |      | 010-82295155          | 021-62159217          |
| 注册地址    |      | 北京市东城区和平里中街乙 16 号     | 福州市湖东路 154 号          |
| 办公地址    |      | 北京市东城区和平里中街乙 16 号     | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼  |
| 邮政编码    |      | 100013                | 200120                |
| 法定代表人   |      | 毕劲松                   | 吕家进                   |

### 2.4 信息披露方式

|                     |   |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 上海证券报   |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | <a href="http://www.postfund.com.cn">http://www.postfund.com.cn</a> |
| 基金中期报告备置地点          | 基金管理人和基金托管人的办公场所  |

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日) |
|---------------|-----------------------------|
| 本期已实现收益       | 28,555,044.13               |
| 本期利润          | 7,747,575.07                |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0087                      |
| 本期加权平均净值利润率   | 0.82%                       |
| 本期基金份额净值增长率   | 0.95%                       |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2021年6月30日)            |
| 期末可供分配利润      | -17,087,934.46              |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0229                     |
| 期末基金资产净值      | 793,627,525.99              |
| 期末基金份额净值      | 1.064                       |
| 3.1.3 累计期末指标  | 报告期末(2021年6月30日)            |
| 基金份额累计净值增长率   | 6.40%                       |

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

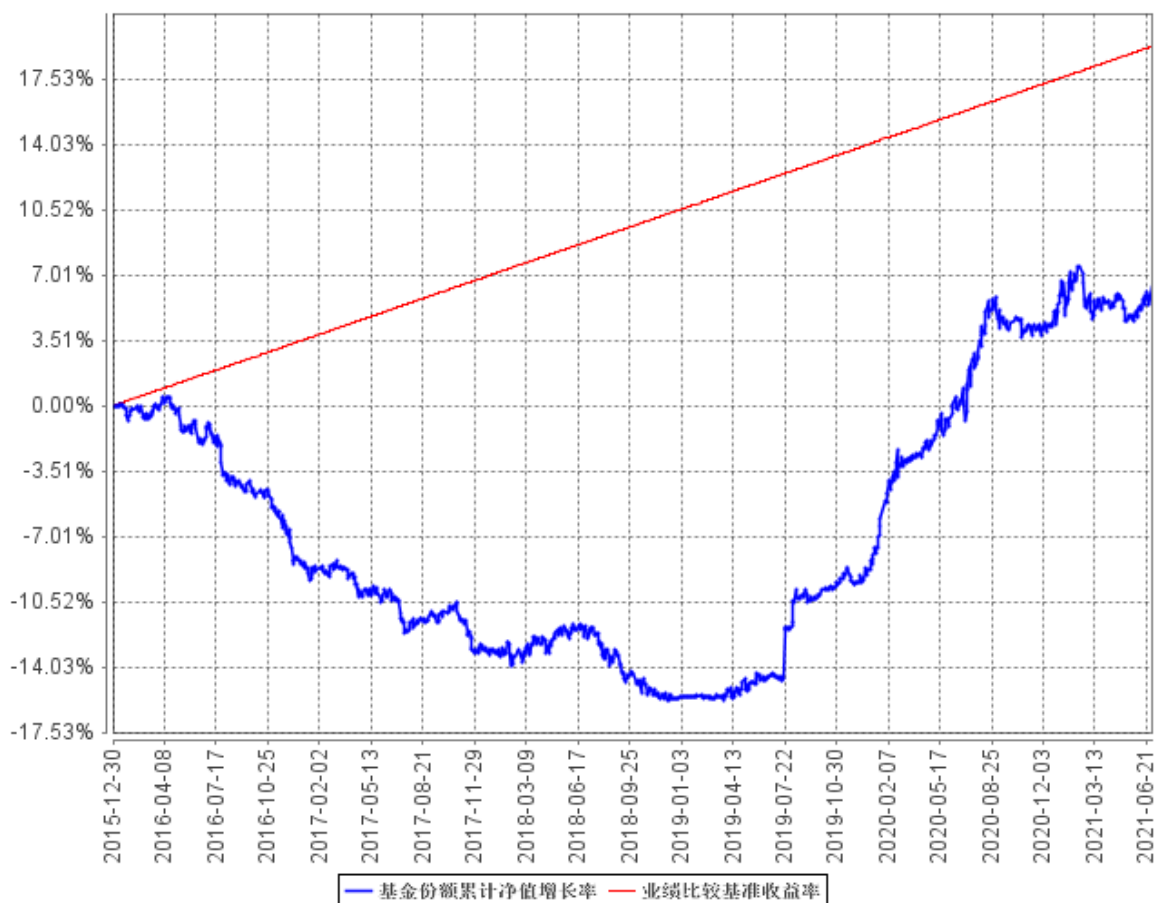
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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      | 1.33%    | 0.28%       | 0.24%      | 0.01%         | 1.09%   | 0.27% |
| 过去三个月      | 0.76%    | 0.23%       | 0.74%      | 0.01%         | 0.02%   | 0.22% |
| 过去六个月      | 0.95%    | 0.33%       | 1.48%      | 0.01%         | -0.53%  | 0.32% |
| 过去一年       | 5.35%    | 0.34%       | 3.02%      | 0.01%         | 2.33%   | 0.33% |
| 过去三年       | 20.77%   | 0.30%       | 9.66%      | 0.01%         | 11.11%  | 0.29% |
| 自基金合同生效起至今 | 6.40%    | 0.27%       | 19.27%     | 0.01%         | -12.87% | 0.26% |



### 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



## § 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 2021 年 6 月 30 日，本公司共管理 49 开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮睿利增强债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、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、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮未来成长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 | 说明 |
|----|----|-----------------|-----|----|
|----|----|-----------------|-----|----|

|    |      | 任职日期             | 离任日期 | 业年限 |  |
|----|------|------------------|------|-----|--|
| 王喆 | 基金经理 | 2018 年 12 月 19 日 | -    | 9 年 | 曾就职于中国工商银行北京分行海淀西区支行、中国工商银行总行资产管理部从事投资管理及研究分析、中邮创业基金管理股份有限公司从事证券投资研究工作。现担任中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮稳健添利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、中邮风格轮动灵活配置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基金经理。 |

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

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金主要通过量化多因子模型构建股票多头组合，并通过持有股指期货空头对冲股票投资组合的系统性风险，从而将多头组合相对指数的超额收益转化为绝对收益。

2021 年上半年，市场演绎了极致的结构化行情。一季度的初，高盈利、高成长、高机构持仓的行业龙头个股具备明显的 alpha 收益，市场风格基本上也是 2020 年的延续，因此，组合净值在年初获得了快速增长。2 月中旬，市场风格突然发生变化，从 2017 年开始就持续走弱的估值、波动率、反转等因子的收益在几个交易日内获得了快速修复，由于前期强势的因子拥挤度很高，且模型超额收益回撤在此期间超过了模型回测期的最大回撤，本基金及时对策略进行了调整，并降低了组合仓位。然而，市场进入 3 月中旬至一季报年报披露期，前期强势的因子再次修复，由于仓位较低且本基金对原模型进行了调整，导致产品净值迟迟没有突破前期高点。

二季度初，市场的情绪逐步稳定，但基差出现快速收敛，产品净值因此出现进一步回撤。二季度末，市场风格趋于稳定，成长、盈利、机构持仓因子恢复动量，市场结构分化从因子端映射到行业端，既新能源、汽车、电子等超额收益明显，市场分化持续加剧，由于担心市场可能出现今年 2 月末的情况，产品维持中等仓位操作。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.064 元，累计净值为 1.064 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.95%，业绩比较基准收益率为 1.48%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为经济增长不断趋缓是大方向，因此货币政策短期难以收紧，利率仍会维持在偏低位置，市场流动性无忧；另一方面，国内外的不确定性较多，首先是“疫情”的不断反复，影响了全球的有效需求，从而影响经济的恢复，其次国际贸易摩擦仍然会时不时对市场风

险偏好造成较大的扰动。资金方面，在当前低利率的大环境下，叠加资金进入房地产市场长期受到压制，权益市场仍是相对具有性价比的投资去处，居民资金有望延续入市趋势，另一方面国内经济恢复较好，A股市场相对估值较低，吸引力突出，外资也将继续大幅度流入。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未进行利润分配。

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

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，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

本托管人认真复核了本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、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                |                                  |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 59,077,125.00                  | 53,676,668.82                    |
| 结算备付金           |            | 65,573,159.22                  | 242,582,400.53                   |
| 存出保证金           |            | 58,397,059.29                  | 65,943,584.86                    |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 508,066,285.49                 | 634,024,308.55                   |
| 其中：股票投资         |            | 496,520,285.49                 | 616,036,908.55                   |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 11,546,000.00                  | 17,987,400.00                    |
| 资产支持证券投资        |            | -                              | -                                |
| 贵金属投资           |            | -                              | -                                |
| 衍生金融资产          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 买入返售金融资产        | 6.4.7.4    | 60,000,000.00                  | 20,000,000.00                    |
| 应收证券清算款         |            | 44,659,202.58                  | -                                |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 283,598.09                     | 433,804.26                       |
| 应收股利            |            | -                              | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| 资产总计            |            | 796,056,429.67                 | 1,016,660,767.02                 |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                |                                  |
| 短期借款            |            | -                              | -                                |
| 交易性金融负债         |            | -                              | -                                |
| 衍生金融负债          | 6.4.7.3    | -                              | -                                |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                              | -                                |
| 应付证券清算款         |            | -                              | 23,386,289.83                    |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 713,649.80                     | 746,653.74                       |
| 应付托管费           |            | 178,412.47                     | 186,663.42                       |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 1,327,745.47                   | 1,472,257.32                     |
| 应交税费            |            | -                              | -                                |

|               |          |                |                  |
|---------------|----------|----------------|------------------|
| 应付利息          |          | -              | -                |
| 应付利润          |          | -              | -                |
| 递延所得税负债       |          | -              | -                |
| 其他负债          | 6.4.7.8  | 209,095.94     | 500,000.00       |
| 负债合计          |          | 2,428,903.68   | 26,291,864.31    |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |                  |
| 实收基金          | 6.4.7.9  | 745,953,639.35 | 939,870,419.98   |
| 未分配利润         | 6.4.7.10 | 47,673,886.64  | 50,498,482.73    |
| 所有者权益合计       |          | 793,627,525.99 | 990,368,902.71   |
| 负债和所有者权益总计    |          | 796,056,429.67 | 1,016,660,767.02 |

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.064 元，基金份额总额 745,953,639.35 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |            | 20,352,920.99                            | 33,169,816.23                                 |
| 1.利息收入                |            | 2,680,524.09                             | 899,916.28                                    |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11   | 1,617,343.56                             | 829,091.64                                    |
| 债券利息收入                |            | 389,891.25                               | 37,107.38                                     |
| 资产支持证券利息收入            |            | -  | -   |
| 买入返售金融资产收入            |            | 673,289.28                               | 33,717.26                                     |
| 证券出借利息收入              |            | -  | -   |
| 其他利息收入                |            | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |            | 38,196,482.78                            | 21,919,948.08                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12   | 60,984,477.06                            | 23,052,066.03                                 |
| 基金投资收益                |            | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13   | 11,569.74                                | 10,694.89                                     |
| 资产支持证券投资收益            | 6.4.7.13.5 | -  | -   |
| 贵金属投资收益               | 6.4.7.14   | -  | -   |
| 衍生工具收益                | 6.4.7.15   | -26,532,206.41                           | -2,833,755.04                                 |
| 股利收益                  | 6.4.7.16   | 3,732,642.39                             | 1,690,942.20                                  |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17   | -20,807,469.06                           | 10,299,373.10                                 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -  | -   |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列）     | 6.4.7.18   | 283,383.18                               | 50,578.77                                     |
| <b>减：二、费用</b>         |            | 12,605,345.92                            | 4,402,432.29                                  |
| 1. 管理人报酬              | 6.4.10.2.1 | 5,820,991.42                             | 1,444,240.64                                  |
| 2. 托管费                | 6.4.10.2.2 | 1,173,286.73                             | 361,060.10                                    |



|                            |            |                     |                      |
|----------------------------|------------|---------------------|----------------------|
| 3. 销售服务费                   | 6.4.10.2.3 | -                   | -                    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.19   | 5,482,318.80        | 2,458,591.83         |
| 5. 利息支出                    |            | -                   | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |            | -                   | -                    |
| 6. 税金及附加                   |            | 0.07                | 19,645.19            |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.20   | 128,748.90          | 118,894.53           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |            | <b>7,747,575.07</b> | <b>28,767,383.94</b> |
| 减：所得税费用                    |            | -                   | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |            | <b>7,747,575.07</b> | <b>28,767,383.94</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日      |                |                 |
|--|--|----------------|-----------------|
|  | 实收基金                                       | 未分配利润          | 所有者权益合计         |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 939,870,419.98                             | 50,498,482.73  | 990,368,902.71  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 7,747,575.07   | 7,747,575.07    |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）      | -193,916,780.63                            | -10,572,171.16 | -204,488,951.79 |
| 其中：1. 基金申购款                            | 54,691,977.54                              | 2,851,443.42   | 57,543,420.96   |
| 2. 基金赎回款                               | -248,608,758.17                            | -13,423,614.58 | -262,032,372.75 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -  | -              | -               |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 745,953,639.35                             | 47,673,886.64  | 793,627,525.99  |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日 |                |                 |

|  | 实收基金           | 未分配利润          | 所有者权益合计        |
|--|----------------|----------------|----------------|
| 一、期初所有者权益(基金净值)                        | 239,253,597.77 | -21,153,673.44 | 218,099,924.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -              | 28,767,383.94  | 28,767,383.94  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | 353,261,035.50 | -1,474,555.61  | 351,786,479.89 |
| 其中：1.基金申购款                             | 408,586,241.50 | -2,426,791.78  | 406,159,449.72 |
| 2.基金赎回款                                | -55,325,206.00 | 952,236.17     | -54,372,969.83 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | -              | -              | -              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 592,514,633.27 | 6,139,154.89   | 598,653,788.16 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金（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[2015] 2683 号《关于准予中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金注册的批复》批准进行募集，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《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》发起，并于 2015 年 12 月 30 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 1,239,463,253.94 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字（2015）第 110ZC0679 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，基金托管人为兴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《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。在正常市场情况下，本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值比例范围在 80%~120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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%。在封闭期内，本基金不受上述 5%的限制。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金财务报表以基金持续经营为基础编制，执行财政部颁布的企业会计准则及其应用指南、解释及其他有关规定（统称“企业会计准则”）和中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的证监会公告[2010]5号《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

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

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本报告期本基金所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本报告期内本基金无会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《财政部国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部国家税务总局证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《财政部国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《财政部国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《财政部国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2017]56号《财政部国家税务总局关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《财政部国家税务总局关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金主要税项列示如下：

1. 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税；基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；对个人持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

2. 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产（质押式、买断式）；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

基金增值税应税行为包括贷款服务和金融商品转让。采用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不

再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。基金管理人运营基金提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（1）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（2）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 59,077,125.00          |
| 定期存款           | -                      |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | -                      |
| 存款期限 1-3 个月    | -                      |
| 存款期限 3 个月以上    | -                      |
| 其他存款           | -                      |
| 合计：            | 59,077,125.00          |

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                |               |
|---------------|------------------------|----------------|---------------|
|               | 成本                     | 公允价值           | 公允价值变动        |
| 股票            | 466,253,603.69         | 496,520,285.49 | 30,266,681.80 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -              | -             |
| 债券            | 交易所市场                  | 11,544,666.67  | 11,546,000.00 |
|               | 银行间市场                  | -              | -             |
|               | 合计                     | 11,544,666.67  | 11,546,000.00 |
| 资产支持证券        | -                      | -              | -             |
| 基金            | -                      | -              | -             |
| 其他            | -                      | -              | -             |
| 合计            | 477,798,270.36         | 508,066,285.49 | 30,268,015.13 |

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

**6.4.7.4 买入返售金融资产****6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年6月30日 |           |
|-------|-------------------|-----------|
|       | 账面余额              | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 60,000,000.00     | -         |
| 银行间市场 | -                 | -         |
| 合计    | 60,000,000.00     | -         |

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年6月30日 |
|------------|-------------------|
| 应收活期存款利息   | 6,786.76          |
| 应收定期存款利息   | -                 |
| 应收其他存款利息   | -                 |
| 应收结算备付金利息  | 36,921.75         |
| 应收债券利息     | 206,272.81        |
| 应收资产支持证券利息 | -                 |
| 应收买入返售证券利息 | 33,435.60         |
| 应收申购款利息    | -                 |
| 应收黄金合约拆借孳息 | -                 |
| 应收出借证券利息   | -                 |
| 其他         | 181.17            |
| 合计         | 283,598.09        |

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本期末无其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 1,327,745.47           |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 1,327,745.47           |

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 预提费用        | 209,095.94             |
| 合计          | 209,095.94             |

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |                 |
|---------------|---------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额            |
| 上年度末          | 939,870,419.98                        | 939,870,419.98  |
| 本期申购          | 54,691,977.54                         | 54,691,977.54   |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -248,608,758.17                       | -248,608,758.17 |
| - 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           | 745,953,639.35                        | 745,953,639.35  |

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

| 项目   | 已实现部分          | 未实现部分          | 未分配利润合计       |
|------|----------------|----------------|---------------|
| 上年度末 | -53,007,281.94 | 103,505,764.67 | 50,498,482.73 |
| 本期利润 | 28,555,044.13  | -20,807,469.06 | 7,747,575.07  |

|                |                |                |                |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 7,364,303.35   | -17,936,474.51 | -10,572,171.16 |
| 其中：基金申购款       | -2,681,776.58  | 5,533,220.00   | 2,851,443.42   |
| 基金赎回款          | 10,046,079.93  | -23,469,694.51 | -13,423,614.58 |
| 本期已分配利润        | -              | -              | -              |
| 本期末            | -17,087,934.46 | 64,761,821.10  | 47,673,886.64  |

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入  | 147,060.50                 |
| 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 | 1,465,663.81               |
| 其他        | 4,619.25                   |
| 合计        | 1,617,343.56               |

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 1,814,030,656.97           |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,753,046,179.91           |
| 买卖股票差价收入   | 60,984,477.06              |

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 11,569.74                  |
| 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 | 11,569.74 |
|----|-----------|

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 112,931,343.67             |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 111,039,170.21             |
| 减：应收利息总额                | 1,880,603.72               |
| 买卖债券差价收入                | 11,569.74                  |

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

| 项目        | 本期收益金额<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|--------------------------------|
| 国债期货投资收益  | -                              |
| 股指期货-投资收益 | -26,532,206.41                 |

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 3,732,642.39               |
| 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            | 3,732,642.39               |

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产                 | -36,708,755.47                        |
| ——股票投资                     | -36,692,062.95                        |
| ——债券投资                     | -16,692.52                            |
| ——资产支持证券投资                 | -                                     |
| ——贵金属投资                    | -                                     |
| ——其他                       | -                                     |
| 2. 衍生工具                    | 15,901,286.41                         |
| ——权证投资                     | -                                     |
| ——股指期货                     | 15,901,286.41                         |
| 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                         | -20,807,469.06                        |

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 283,383.18                            |
| 合计      | 283,383.18                            |

注：本基金赎回费率最高不超过赎回金额的 5%，随持有期限的增加而递减。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。

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 5,482,318.80                          |
| 银行间市场交易费用 | -                                     |
| 交易基金产生的费用 | -                                     |

|        |              |
|--------|--------------|
| 其中：申购费 | -            |
| 赎回费    | -            |
| 合计     | 5,482,318.80 |

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目         | 本期                   |
|------------|----------------------|
|            | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 审计费用       | 49,588.57            |
| 信息披露费      | 59,507.37            |
| 证券出借违约金    | -                    |
| 银行结算费用     | 1,052.96             |
| 债券帐户维护费    | 9,000.00             |
| 上清所债券账户维护费 | 9,000.00             |
| 其他         | 600.00               |
| 合计         | 128,748.90           |

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

本报告期内，本基金不存在或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2021 年 8 月 20 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称          | 与本基金的关系               |
|----------------|-----------------------|
| 中邮创业基金管理股份有限公司 | 基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴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       |

## 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<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 5,820,991.42                   | 1,444,240.64                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 444,240.45                     | 189,745.00                      |

注：支付基金管理人中邮创业基金管理有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值的 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,173,286.73               | 361,060.10                      |

注：支付基金托管人兴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的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未与关联方发生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

本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行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

本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行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自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              |
|-----------------------------|----------------------|----------------------|
|                             | 2021年1月1日至2021年6月30日 | 2020年1月1日至2020年6月30日 |
| 基金合同生效日（2015年12月30日）持有的基金份额 | 9,999,000.00         | 9,999,000.00         |
| 报告期初持有的基金份额                 | 9,999,000.00         | 9,999,000.00         |
| 报告期间申购/买入总份额                | -                    | -                    |
| 报告期间因拆分变动份额                 | -                    | -                    |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额              | -                    | -                    |
| 报告期末持有的基金份额                 | 9,999,000.00         | 9,999,000.00         |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例         | 1.3400%              | 1.6900%              |

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

本报告期末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称      | 本期                   |            | 上年度可比期间              |            |
|------------|----------------------|------------|----------------------|------------|
|            | 2021年1月1日至2021年6月30日 |            | 2020年1月1日至2020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     |
| 兴业银行股份有限公司 | 59,077,125.00        | 147,060.50 | 27,913,268.63        | 131,326.68 |

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未发生利润分配。

### 6.4.12 期末（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |           |        |        |        |              |            |            |    |
|----------------------|------|------------|-----------|--------|--------|--------|--------------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日      | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位：股) | 期末成本总额     | 期末估值总额     | 备注 |
| 688499               | 利元亨  | 2021年6月23日 | 2021年7月1日 | 新股流通受限 | 38.85  | 38.85  | 2,149        | 83,488.65  | 83,488.65  | -  |
| 301018               | 申菱环境 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日 | 新股流通受限 | 8.29   | 8.29   | 7,811        | 64,753.19  | 64,753.19  | -  |
| 688239               | 航宇科技 | 2021年6月25日 | 2021年7月5日 | 新股流通受限 | 11.48  | 11.48  | 4,926        | 56,550.48  | 56,550.48  | -  |
| 688087               | 英科再生 | 2021年6月30日 | 2021年7月9日 | 新股流通受限 | 21.96  | 21.96  | 2,469        | 54,219.24  | 54,219.24  | -  |
| 301020               | 密封科技 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股流通受限 | 10.64  | 10.64  | 4,210        | 44,794.40  | 44,794.40  | -  |
| 301021               | 英诺激光 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股流通受限 | 9.46   | 9.46   | 2,899        | 27,424.54  | 27,424.54  | -  |
| 688226               | 威腾电气 | 2021年6月28日 | 2021年7月7日 | 新股流通受限 | 6.42   | 6.42   | 2,693        | 17,289.06  | 17,289.06  | -  |
| 605287               | 德才股份 | 2021年6月28日 | 2021年7月6日 | 新股流通受限 | 31.56  | 31.56  | 349          | 11,014.44  | 11,014.44  | -  |
| 605162               | 新中港  | 2021年6月29日 | 2021年7月7日 | 新股流通受限 | 6.07   | 6.07   | 1,377        | 8,358.39   | 8,358.39   | -  |
| 688696               | 极米科技 | 2021年2月23日 | 2021年9月3日 | 新股流通受限 | 133.73 | 780.24 | 1,252        | 167,429.96 | 976,860.48 | -  |
| 688079               | 美迪凯  | 2021年2月23日 | 2021年9月   | 新股流通受限 | 10.19  | 18.40  | 10,622       | 108,238.18 | 195,444.80 | -  |

|        |      |            |             |        |       |        |       |           |            |  |   |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|--------|-------|-----------|------------|--|---|
|        |      | 日          | 2日          |        |       |        |       |           |            |  |   |
| 688613 | 奥精医疗 | 2021年5月13日 | 2021年11月22日 | 新股流通受限 | 16.43 | 63.50  | 2,617 | 42,997.31 | 166,179.50 |  | - |
| 300957 | 贝泰妮  | 2021年3月18日 | 2021年9月27日  | 新股流通受限 | 47.33 | 251.96 | 655   | 31,001.15 | 165,033.80 |  | - |
| 688201 | 信安世纪 | 2021年4月13日 | 2021年10月21日 | 新股流通受限 | 26.78 | 45.41  | 2,129 | 57,014.62 | 96,677.89  |  | - |
| 688621 | 阳光诺和 | 2021年6月11日 | 2021年12月21日 | 新股流通受限 | 26.89 | 63.99  | 1,485 | 39,931.65 | 95,025.15  |  | - |
| 300979 | 华利集团 | 2021年4月15日 | 2021年10月26日 | 新股流通受限 | 33.22 | 87.50  | 897   | 29,798.34 | 78,487.50  |  | - |
| 688117 | 圣诺生物 | 2021年5月26日 | 2021年12月3日  | 新股流通受限 | 17.90 | 35.97  | 1,672 | 29,928.80 | 60,141.84  |  | - |
| 300981 | 中红医疗 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股流通受限 | 48.59 | 90.39  | 472   | 22,934.48 | 42,664.08  |  | - |
| 300973 | 立高食品 | 2021年4月8日  | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 28.28 | 115.71 | 360   | 10,180.80 | 41,655.60  |  | - |
| 688659 | 元琛科技 | 2021年3月24日 | 2021年10月8日  | 新股流通受限 | 6.50  | 10.46  | 3,671 | 23,861.50 | 38,398.66  |  | - |
| 688517 | 金冠电气 | 2021年6月10日 | 2021年12月20日 | 新股流通受限 | 7.71  | 11.88  | 2,892 | 22,297.32 | 34,356.96  |  | - |
| 688367 | 工大高科 | 2021年6月21日 | 2021年12月28日 | 新股流通受限 | 11.53 | 17.94  | 1,717 | 19,797.01 | 30,802.98  |  | - |
| 300953 | 震裕   | 2021年      | 2021        | 新股流    | 28.77 | 99.85  | 240   | 6,904.80  | 23,964.00  |  | - |

|        |      |            |             |        |       |       |       |           |           |  |   |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
|        | 科技   | 3月11日      | 2021年9月22日  | 通受限    |       |       |       |           |           |  |   |
| 301009 | 可靠股份 | 2021年6月8日  | 2021年12月17日 | 新股流通受限 | 12.54 | 27.89 | 801   | 10,044.54 | 22,339.89 |  | - |
| 300941 | 创识科技 | 2021年2月2日  | 2021年8月9日   | 新股流通受限 | 21.31 | 49.94 | 399   | 8,502.69  | 19,926.06 |  | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021年6月22日 | 2021年12月30日 | 新股流通受限 | 7.64  | 38.83 | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 |  | - |
| 300932 | 三友联众 | 2021年1月15日 | 2021年7月22日  | 新股流通受限 | 24.69 | 31.71 | 492   | 12,147.48 | 15,601.32 |  | - |
| 300982 | 苏文电能 | 2021年4月19日 | 2021年10月27日 | 新股流通受限 | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.11  | 14,356.93 |  | - |
| 300968 | 格林精密 | 2021年4月6日  | 2021年10月15日 | 新股流通受限 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.94  | 14,025.34 |  | - |
| 300940 | 南极光  | 2021年1月27日 | 2021年8月3日   | 新股流通受限 | 12.76 | 43.38 | 307   | 3,917.32  | 13,317.66 |  | - |
| 300614 | 百川畅银 | 2021年5月18日 | 2021年11月25日 | 新股流通受限 | 9.19  | 40.38 | 329   | 3,023.51  | 13,285.02 |  | - |
| 300937 | 药易购  | 2021年1月20日 | 2021年7月27日  | 新股流通受限 | 12.25 | 53.71 | 244   | 2,989.00  | 13,105.24 |  | - |
| 300942 | 易瑞生物 | 2021年2月2日  | 2021年8月9日   | 新股流通受限 | 5.31  | 28.52 | 443   | 2,352.33  | 12,634.36 |  | - |
| 300997 | 欢乐家  | 2021年5月26日 | 2021年12月2日  | 新股流通受限 | 4.94  | 13.05 | 928   | 4,584.32  | 12,110.40 |  | - |
| 300933 | 中辰股份 | 2021年1月15日 | 2021年7月22日  | 新股流通受限 | 3.37  | 10.44 | 1,112 | 3,747.44  | 11,609.28 |  | - |



|        |      |            |             |        |       |       |     |          |           |   |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-----|----------|-----------|---|
| 301002 | 崧盛股份 | 2021年5月27日 | 2021年12月7日  | 新股流通受限 | 18.71 | 57.62 | 201 | 3,760.71 | 11,581.62 | - |
| 300955 | 嘉亨家化 | 2021年3月16日 | 2021年9月24日  | 新股流通受限 | 16.53 | 46.07 | 232 | 3,834.96 | 10,688.24 | - |
| 300996 | 普联软件 | 2021年5月26日 | 2021年12月3日  | 新股流通受限 | 20.81 | 42.23 | 241 | 5,015.21 | 10,177.43 | - |
| 300956 | 英力股份 | 2021年3月16日 | 2021年9月27日  | 新股流通受限 | 12.85 | 25.80 | 371 | 4,767.35 | 9,571.80  | - |
| 300962 | 中金辐照 | 2021年3月29日 | 2021年10月11日 | 新股流通受限 | 3.40  | 16.37 | 576 | 1,958.40 | 9,429.12  | - |
| 300952 | 恒辉安防 | 2021年3月3日  | 2021年9月13日  | 新股流通受限 | 11.72 | 27.08 | 340 | 3,984.80 | 9,207.20  | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021年6月23日 | 2021年12月30日 | 新股流通受限 | 13.75 | 32.98 | 275 | 3,781.25 | 9,069.50  | - |
| 300945 | 曼卡龙  | 2021年2月3日  | 2021年8月10日  | 新股流通受限 | 4.56  | 18.88 | 474 | 2,161.44 | 8,949.12  | - |
| 300948 | 冠中生态 | 2021年2月18日 | 2021年8月25日  | 新股流通受限 | 13.00 | 27.42 | 324 | 2,808.00 | 8,884.08  | - |
| 300931 | 通用电梯 | 2021年1月13日 | 2021年7月21日  | 新股流通受限 | 4.31  | 13.11 | 672 | 2,896.32 | 8,809.92  | - |
| 300961 | 深水海纳 | 2021年3月23日 | 2021年9月30日  | 新股流通受限 | 8.48  | 22.07 | 394 | 3,341.12 | 8,695.58  | - |
| 300950 | 德固特  | 2021年2月24日 | 2021年9月3日   | 新股流通受限 | 8.41  | 39.13 | 219 | 1,841.79 | 8,569.47  | - |
| 300986 | 志特新材 | 2021年4月21日 | 2021年11月1日  | 新股流通受限 | 14.79 | 30.57 | 264 | 3,904.56 | 8,070.48  | - |
| 300987 | 川网传媒 | 2021年4月28日 | 2021年11月    | 新股流通受限 | 6.79  | 26.81 | 301 | 2,043.79 | 8,069.81  | - |

|        |      |                  |                  |        |       |       |     |          |          |   |  |
|--------|------|------------------|------------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|--|
|        |      | 日                | 月 11 日           |        |       |       |     |          |          |   |  |
| 300978 | 东箭科技 | 2021 年 4 月 15 日  | 2021 年 10 月 26 日 | 新股流通受限 | 8.42  | 13.60 | 593 | 4,993.06 | 8,064.80 | - |  |
| 300926 | 博俊科技 | 2020 年 12 月 29 日 | 2021 年 7 月 12 日  | 新股流通受限 | 10.76 | 22.20 | 359 | 3,862.84 | 7,969.80 | - |  |
| 300993 | 玉马遮阳 | 2021 年 5 月 17 日  | 2021 年 11 月 24 日 | 新股流通受限 | 12.10 | 19.29 | 410 | 4,961.00 | 7,908.90 | - |  |
| 300930 | 屹通新材 | 2021 年 1 月 13 日  | 2021 年 7 月 21 日  | 新股流通受限 | 13.11 | 24.48 | 322 | 4,221.42 | 7,882.56 | - |  |
| 300985 | 致远新能 | 2021 年 4 月 21 日  | 2021 年 10 月 29 日 | 新股流通受限 | 24.90 | 24.81 | 295 | 7,345.50 | 7,318.95 | - |  |
| 300971 | 博亚精工 | 2021 年 4 月 7 日   | 2021 年 10 月 15 日 | 新股流通受限 | 18.24 | 28.29 | 245 | 4,468.80 | 6,931.05 | - |  |
| 301004 | 嘉益股份 | 2021 年 6 月 18 日  | 2021 年 12 月 27 日 | 新股流通受限 | 7.81  | 21.94 | 312 | 2,436.72 | 6,845.28 | - |  |
| 300991 | 创益通  | 2021 年 5 月 12 日  | 2021 年 11 月 22 日 | 新股流通受限 | 13.06 | 26.51 | 254 | 3,317.24 | 6,733.54 | - |  |
| 300927 | 江天化学 | 2020 年 12 月 29 日 | 2021 年 7 月 7 日   | 新股流通受限 | 13.39 | 30.10 | 217 | 2,905.63 | 6,531.70 | - |  |
| 300975 | 商络电子 | 2021 年 4 月 14 日  | 2021 年 10 月 21 日 | 新股流通受限 | 5.48  | 13.03 | 492 | 2,696.16 | 6,410.76 | - |  |
| 300963 | 中洲特材 | 2021 年 3 月 30 日  | 2021 年 10 月 11 日 | 新股流通受限 | 12.13 | 22.49 | 283 | 3,432.79 | 6,364.67 | - |  |

|        |      |            |             |        |       |       |     |          |          |   |
|--------|------|------------|-------------|--------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301011 | 华立科技 | 2021年6月9日  | 2021年12月17日 | 新股流通受限 | 14.20 | 33.84 | 175 | 2,485.00 | 5,922.00 | - |
| 300943 | 春晖智控 | 2021年2月3日  | 2021年8月10日  | 新股流通受限 | 9.79  | 23.01 | 255 | 2,496.45 | 5,867.55 | - |
| 300967 | 晓鸣股份 | 2021年4月2日  | 2021年10月13日 | 新股流通受限 | 4.54  | 11.54 | 507 | 2,301.78 | 5,850.78 | - |
| 300972 | 万辰生物 | 2021年4月8日  | 2021年10月19日 | 新股流通受限 | 7.19  | 12.65 | 430 | 3,091.70 | 5,439.50 | - |
| 300929 | 华骐环保 | 2021年1月12日 | 2021年7月21日  | 新股流通受限 | 13.87 | 29.55 | 183 | 2,538.21 | 5,407.65 | - |
| 300960 | 通业科技 | 2021年3月22日 | 2021年9月29日  | 新股流通受限 | 12.08 | 23.06 | 234 | 2,826.72 | 5,396.04 | - |
| 300995 | 奇德新材 | 2021年5月17日 | 2021年11月26日 | 新股流通受限 | 14.72 | 23.32 | 191 | 2,811.52 | 4,454.12 | - |
| 300998 | 宁波方正 | 2021年5月25日 | 2021年12月2日  | 新股流通受限 | 6.02  | 21.32 | 201 | 1,210.02 | 4,285.32 | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021年6月15日 | 2021年12月22日 | 新股流通受限 | 8.05  | 24.26 | 170 | 1,368.50 | 4,124.20 | - |
| 300992 | 泰福泵业 | 2021年5月17日 | 2021年11月25日 | 新股流通受限 | 9.36  | 20.32 | 200 | 1,872.00 | 4,064.00 | - |
| 301010 | 晶雪节能 | 2021年6月9日  | 2021年12月20日 | 新股流通受限 | 7.83  | 17.61 | 218 | 1,706.94 | 3,838.98 | - |

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券 | 证券 | 成功 | 可流 | 流通 | 认购 | 期末估 | 数量 | 期末 | 期末估值总额 | 备注 |
|----|----|----|----|----|----|-----|----|----|--------|----|
|----|----|----|----|----|----|-----|----|----|--------|----|

| 代码     | 名称   | 认购日        | 通日        | 受限类型   | 价格     | 值单价    | (单位:张) | 成本总额         |              |   |
|--------|------|------------|-----------|--------|--------|--------|--------|--------------|--------------|---|
| 113050 | 南银转债 | 2021年6月15日 | 2021年7月1日 | 配债流通受限 | 100.00 | 100.00 | 15,460 | 1,546,000.00 | 1,546,000.00 | - |

注：以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上公司公告为准。中伟股份（300919）预计可流通日为2021年6月23日，实际可流通日为2021年7月2日。

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

申菱环境（301018）期末限售7,811股，其中782股限售期限为上市交易之日起6个月，可流通日为2022年1月7日；密封科技（301020）期末限售4,210股，其中421股限售期限为上市交易之日起6个月，可流通日为2022年1月6日；英诺激光（301021）期末限售2,899股，其中290股限售期限为上市交易之日起6个月，可流通日为2022年1月6日。

#### 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的流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期内本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。

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

#### 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<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1    | -                 | -                   |
| A-1 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | 10,000,000.00     | 17,987,400.00       |
| 合计     | 10,000,000.00     | 17,987,400.00       |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021年6月30日 | 上年度末<br>2020年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| AAA    | 1,546,000.00      | -                   |
| AAA 以下 | -                 | -                   |
| 未评级    | -                 | -                   |
| 合计     | 1,546,000.00      | -                   |

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 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>2021年6月<br>30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------|------|------|------|-----|----|
| 资产                    |      |      |      |     |    |

|                     |                |      |              |                |                  |
|---------------------|----------------|------|--------------|----------------|------------------|
| 银行存款                | 59,077,125.00  | -    | -            | -              | 59,077,125.00    |
| 结算备付金               | 65,573,159.22  | -    | -            | -              | 65,573,159.22    |
| 存出保证金               | 58,397,059.29  | -    | -            | -              | 58,397,059.29    |
| 交易性金融资产             | 10,000,000.00  | -    | 1,546,000.00 | 496,520,285.49 | 508,066,285.49   |
| 买入返售金融资产            | 60,000,000.00  | -    | -            | -              | 60,000,000.00    |
| 应收证券清算款             | -              | -    | -            | 44,659,202.58  | 44,659,202.58    |
| 应收利息                | -              | -    | -            | 283,598.09     | 283,598.09       |
| 资产总计                | 253,047,343.51 | -    | 1,546,000.00 | 541,463,086.16 | 796,056,429.67   |
| 负债                  |                |      |              |                |                  |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -            | 713,649.80     | 713,649.80       |
| 应付托管费               | -              | -    | -            | 178,412.47     | 178,412.47       |
| 应付交易费用              | -              | -    | -            | 1,327,745.47   | 1,327,745.47     |
| 其他负债                | -              | -    | -            | 209,095.94     | 209,095.94       |
| 负债总计                | -              | -    | -            | 2,428,903.68   | 2,428,903.68     |
| 利率敏感度缺口             | 253,047,343.51 | -    | 1,546,000.00 | 539,034,182.48 | 793,627,525.99   |
| 上年度末<br>2020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                | 53,676,668.82  | -    | -            | -              | 53,676,668.82    |
| 结算备付金               | 242,582,400.53 | -    | -            | -              | 242,582,400.53   |
| 存出保证金               | 65,943,584.86  | -    | -            | -              | 65,943,584.86    |
| 交易性金融资产             | 17,987,400.00  | -    | -            | 616,036,908.55 | 634,024,308.55   |
| 买入返售金融资产            | 20,000,000.00  | -    | -            | -              | 20,000,000.00    |
| 应收利息                | -              | -    | -            | 433,804.26     | 433,804.26       |
| 资产总计                | 400,190,054.21 | -    | -            | 616,470,712.81 | 1,016,660,767.02 |
| 负债                  |                |      |              |                |                  |
| 应付证券清算款             | -              | -    | -            | 23,386,289.83  | 23,386,289.83    |
| 应付管理人报酬             | -              | -    | -            | 746,653.74     | 746,653.74       |
| 应付托管费               | -              | -    | -            | 186,663.42     | 186,663.42       |
| 应付交易费用              | -              | -    | -            | 1,472,257.32   | 1,472,257.32     |
| 其他负债                | -              | -    | -            | 500,000.00     | 500,000.00       |

|         |                |   |   |                 |                |
|---------|----------------|---|---|-----------------|----------------|
| 负债总计    | -              | - | - | 26,291,864.31   | 26,291,864.31  |
| 利率敏感度缺口 | 400,190,054.21 | - | - | -590,178,848.50 | 990,368,902.71 |

#### 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                        |
|    |                          | 本期末（2021 年 6 月 30 日）            | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 基金净资产变动                  | -23,027.29                      | -12,622.08             |
|    | 基金净资产变动                  | 23,790.62                       | 12,686.11              |

#### 6.4.13.4.2 其他价格风险

##### 市场价格风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、股指期货、权证、资产支持证券、银行存款、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

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

本基金的投资组合比例为：本基金权益类空头头寸的价值占本基金权益类多头头寸的价值的比例范围在 80%—120%之间。其中：权益类空头头寸的价值是指融券卖出的股票市值、卖出股指期货的合约价值及卖出其他权益类衍生工具的合约价值的合计值；权益类多头头寸的价值是指买入持有的股票市值、买入股指期货的合约价值及买入其他权益类衍生工具的合约价值的合计值。



开放期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%，封闭期内的每个交易日日终，持有的买入期货合约价值和有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 100%。

开放期内，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。在封闭期内，本基金不受上述 5% 的限制。

本基金不受证监会《证券投资基金参与股指期货交易指引》第五条第（一）项、第（三）项、第（五）项及第（七）项的限制。

基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，经与基金托管人协商一致后，参与融资融券业务以及通过证券金融公司办理转融通业务，以提高投资效率及进行风险管理。届时基金参与融资融券、转融通等业务的风险控制原则、具体参与比例限制、费用收支、信息披露、估值方法及其他相关事项按照中国证监会的规定及其他相关法律法规的要求执行，无需召开基金份额持有人大会决定。

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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

#### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                          | 上年度末<br>2020 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  | 496,520,285.49         | 62.56                    | 616,036,908.55           | 62.20                 |
| 交易性金融资产-基金投资  | -                      | -                        | -                        | -                     |
| 交易性金融资产-债券投资  | 11,546,000.00          | 1.45                     | 17,987,400.00            | 1.82                  |
| 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            | 508,066,285.49         | 64.02                    | 634,024,308.55           | 64.02                 |

**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（2021 年 6 月 30 日）        | 上年度末（2020 年 12 月 31 日） |
|    | 基金净资产变动              | -12,411,956.79              | 57,474,487.11          |
|    | 基金净资产变动              | 12,411,956.79               | -57,474,487.11         |

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，利用 2021 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-2.44。

**6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额             | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 496,520,285.49 | 62.37         |
|    | 其中：股票             | 496,520,285.49 | 62.37         |
| 2  | 基金投资              | -              | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 11,546,000.00  | 1.45          |
|    | 其中：债券             | 11,546,000.00  | 1.45          |
|    | 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          | 60,000,000.00  | 7.54          |
|    | 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      | 124,650,284.22 | 15.66         |
| 8  | 其他各项资产            | 103,339,859.96 | 12.98         |
| 9  | 合计                | 796,056,429.67 | 100.00        |

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

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|----------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 2,378,404.68   | 0.30          |
| B  | 采矿业              | 3,259,100.00   | 0.41          |
| C  | 制造业              | 310,053,989.35 | 39.07         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39      | 0.00          |
| E  | 建筑业              | 25,371.37      | 0.00          |
| F  | 批发和零售业           | 279,580.90     | 0.04          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 6,413,400.00   | 0.81          |
| H  | 住宿和餐饮业           | -              | -             |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 10,956,868.35  | 1.38          |
| J  | 金融业              | 117,422,192.05 | 14.80         |
| K  | 房地产业             | 1,666,787.20   | 0.21          |
| L  | 租赁和商务服务业         | 16,786,590.00  | 2.12          |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 7,686,508.35   | 0.97          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 36,272.33      | 0.00          |

|   |               |                |       |
|---|---------------|----------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | -              | -     |
| P | 教育            | -              | -     |
| Q | 卫生和社会工作       | 13,505,400.52  | 1.70  |
| R | 文化、体育和娱乐业     | 6,036,800.00   | 0.76  |
| S | 综合            | -              | -     |
|   | 合计            | 496,520,285.49 | 62.56 |

注：由于四舍五入原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本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  | 600519 | 贵州茅台 | 9,759     | 20,071,335.30 | 2.53         |
| 2  | 600036 | 招商银行 | 309,001   | 16,744,764.19 | 2.11         |
| 3  | 603501 | 韦尔股份 | 35,632    | 11,473,504.00 | 1.45         |
| 4  | 600809 | 山西汾酒 | 24,300    | 10,886,400.00 | 1.37         |
| 5  | 002230 | 科大讯飞 | 159,722   | 10,794,012.76 | 1.36         |
| 6  | 000661 | 长春高新 | 25,641    | 9,923,067.00  | 1.25         |
| 7  | 601888 | 中国中免 | 32,200    | 9,663,220.00  | 1.22         |
| 8  | 600919 | 江苏银行 | 1,284,530 | 9,120,163.00  | 1.15         |
| 9  | 601318 | 中国平安 | 139,031   | 8,936,912.68  | 1.13         |
| 10 | 300124 | 汇川技术 | 118,750   | 8,818,375.00  | 1.11         |
| 11 | 000858 | 五粮液  | 29,307    | 8,730,262.23  | 1.10         |
| 12 | 603799 | 华友钴业 | 75,035    | 8,568,997.00  | 1.08         |
| 13 | 601211 | 国泰君安 | 492,148   | 8,435,416.72  | 1.06         |
| 14 | 600837 | 海通证券 | 726,400   | 8,353,600.00  | 1.05         |
| 15 | 601233 | 桐昆股份 | 341,140   | 8,218,062.60  | 1.04         |
| 16 | 601009 | 南京银行 | 773,958   | 8,142,038.16  | 1.03         |
| 17 | 300408 | 三环集团 | 186,000   | 7,890,120.00  | 0.99         |
| 18 | 002648 | 卫星石化 | 198,900   | 7,794,891.00  | 0.98         |
| 19 | 603259 | 药明康德 | 48,480    | 7,591,483.20  | 0.96         |
| 20 | 600104 | 上汽集团 | 333,300   | 7,322,601.00  | 0.92         |
| 21 | 002027 | 分众传媒 | 757,000   | 7,123,370.00  | 0.90         |
| 22 | 002311 | 海大集团 | 86,729    | 7,077,086.40  | 0.89         |
| 23 | 300059 | 东方财富 | 214,720   | 7,040,668.80  | 0.89         |
| 24 | 600426 | 华鲁恒升 | 219,430   | 6,791,358.50  | 0.86         |

|    |        |       |           |              |      |
|----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 25 | 000786 | 北新建材  | 168,400   | 6,609,700.00 | 0.83 |
| 26 | 600660 | 福耀玻璃  | 117,500   | 6,562,375.00 | 0.83 |
| 27 | 000725 | 京东方 A | 1,048,300 | 6,541,392.00 | 0.82 |
| 28 | 600887 | 伊利股份  | 175,200   | 6,452,616.00 | 0.81 |
| 29 | 601919 | 中远海控  | 210,000   | 6,413,400.00 | 0.81 |
| 30 | 002064 | 华峰化学  | 447,900   | 6,360,180.00 | 0.80 |
| 31 | 300015 | 爱尔眼科  | 86,759    | 6,158,153.82 | 0.78 |
| 32 | 300413 | 芒果超媒  | 88,000    | 6,036,800.00 | 0.76 |
| 33 | 000001 | 平安银行  | 263,800   | 5,967,156.00 | 0.75 |
| 34 | 000651 | 格力电器  | 109,800   | 5,720,580.00 | 0.72 |
| 35 | 000063 | 中兴通讯  | 165,500   | 5,499,565.00 | 0.69 |
| 36 | 601838 | 成都银行  | 434,200   | 5,488,288.00 | 0.69 |
| 37 | 000568 | 泸州老窖  | 23,053    | 5,439,124.82 | 0.69 |
| 38 | 605117 | 德业股份  | 39,000    | 4,976,400.00 | 0.63 |
| 39 | 600031 | 三一重工  | 166,700   | 4,845,969.00 | 0.61 |
| 40 | 601601 | 中国太保  | 163,182   | 4,727,382.54 | 0.60 |
| 41 | 601229 | 上海银行  | 563,600   | 4,621,520.00 | 0.58 |
| 42 | 603882 | 金城医学  | 28,800    | 4,601,376.00 | 0.58 |
| 43 | 601169 | 北京银行  | 941,600   | 4,585,592.00 | 0.58 |
| 44 | 601628 | 中国人寿  | 128,800   | 4,365,032.00 | 0.55 |
| 45 | 600481 | 双良节能  | 631,200   | 4,342,656.00 | 0.55 |
| 46 | 000333 | 美的集团  | 59,956    | 4,279,059.72 | 0.54 |
| 47 | 603833 | 欧派家居  | 30,000    | 4,258,800.00 | 0.54 |
| 48 | 002142 | 宁波银行  | 109,200   | 4,255,524.00 | 0.54 |
| 49 | 002179 | 中航光电  | 53,400    | 4,219,668.00 | 0.53 |
| 50 | 688012 | 中微公司  | 25,400    | 4,214,368.00 | 0.53 |
| 51 | 300724 | 捷佳伟创  | 36,000    | 4,176,360.00 | 0.53 |
| 52 | 300760 | 迈瑞医疗  | 8,600     | 4,128,430.00 | 0.52 |
| 53 | 601377 | 兴业证券  | 423,200   | 4,088,112.00 | 0.52 |
| 54 | 600999 | 招商证券  | 213,340   | 4,057,726.80 | 0.51 |
| 55 | 002371 | 北方华创  | 14,600    | 4,049,748.00 | 0.51 |
| 56 | 002867 | 周大生   | 201,600   | 3,985,632.00 | 0.50 |
| 57 | 000513 | 丽珠集团  | 78,000    | 3,901,560.00 | 0.49 |
| 58 | 603806 | 福斯特   | 36,960    | 3,885,604.80 | 0.49 |
| 59 | 002563 | 森马服饰  | 313,300   | 3,743,935.00 | 0.47 |
| 60 | 600563 | 法拉电子  | 23,500    | 3,721,460.00 | 0.47 |
| 61 | 002409 | 雅克科技  | 44,000    | 3,564,000.00 | 0.45 |
| 62 | 000157 | 中联重科  | 381,000   | 3,520,440.00 | 0.44 |
| 63 | 600690 | 海尔智家  | 130,000   | 3,368,300.00 | 0.42 |

|     |        |        |         |              |      |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 64  | 300223 | 北京君正   | 33,200  | 3,350,544.00 | 0.42 |
| 65  | 600338 | 西藏珠峰   | 230,000 | 3,259,100.00 | 0.41 |
| 66  | 600741 | 华域汽车   | 119,600 | 3,141,892.00 | 0.40 |
| 67  | 603688 | 石英股份   | 130,000 | 3,055,000.00 | 0.38 |
| 68  | 603212 | 赛伍技术   | 80,000  | 2,583,200.00 | 0.33 |
| 69  | 000977 | 浪潮信息   | 90,000  | 2,531,700.00 | 0.32 |
| 70  | 600779 | 水井坊    | 20,000  | 2,527,000.00 | 0.32 |
| 71  | 000301 | 东方盛虹   | 118,400 | 2,474,560.00 | 0.31 |
| 72  | 600030 | 中信证券   | 99,199  | 2,474,023.06 | 0.31 |
| 73  | 601238 | 广汽集团   | 186,900 | 2,420,355.00 | 0.30 |
| 74  | 002032 | 苏泊尔    | 37,600  | 2,398,504.00 | 0.30 |
| 75  | 002714 | 牧原股份   | 38,920  | 2,367,114.40 | 0.30 |
| 76  | 300347 | 泰格医药   | 12,079  | 2,334,870.70 | 0.29 |
| 77  | 600765 | 中航重机   | 103,000 | 2,332,950.00 | 0.29 |
| 78  | 300146 | 汤臣倍健   | 70,900  | 2,332,610.00 | 0.29 |
| 79  | 002594 | 比亚迪    | 9,000   | 2,259,000.00 | 0.28 |
| 80  | 000488 | 晨鸣纸业   | 270,400 | 2,201,056.00 | 0.28 |
| 81  | 603589 | 口子窖    | 32,000  | 2,166,080.00 | 0.27 |
| 82  | 002568 | 百润股份   | 22,400  | 2,123,296.00 | 0.27 |
| 83  | 601636 | 旗滨集团   | 109,917 | 2,040,059.52 | 0.26 |
| 84  | 002459 | 晶澳科技   | 40,000  | 1,960,000.00 | 0.25 |
| 85  | 002415 | 海康威视   | 30,000  | 1,935,000.00 | 0.24 |
| 86  | 000776 | 广发证券   | 124,600 | 1,886,444.00 | 0.24 |
| 87  | 000100 | TCL 科技 | 240,000 | 1,836,000.00 | 0.23 |
| 88  | 002532 | 天山铝业   | 217,600 | 1,825,664.00 | 0.23 |
| 89  | 000636 | 风华高科   | 60,000  | 1,813,200.00 | 0.23 |
| 90  | 002821 | 凯莱英    | 4,500   | 1,676,700.00 | 0.21 |
| 91  | 300529 | 健帆生物   | 19,369  | 1,672,706.84 | 0.21 |
| 92  | 601155 | 新城控股   | 40,067  | 1,666,787.20 | 0.21 |
| 93  | 688408 | 中信博    | 7,000   | 1,405,600.00 | 0.18 |
| 94  | 000932 | 华菱钢铁   | 200,000 | 1,320,000.00 | 0.17 |
| 95  | 600926 | 杭州银行   | 86,400  | 1,274,400.00 | 0.16 |
| 96  | 601336 | 新华保险   | 27,700  | 1,271,707.00 | 0.16 |
| 97  | 601689 | 拓普集团   | 30,000  | 1,122,900.00 | 0.14 |
| 98  | 000625 | 长安汽车   | 40,000  | 1,051,200.00 | 0.13 |
| 99  | 000799 | 酒鬼酒    | 4,000   | 1,022,400.00 | 0.13 |
| 100 | 688696 | 极米科技   | 1,252   | 976,860.48   | 0.12 |
| 101 | 300122 | 智飞生物   | 5,000   | 933,650.00   | 0.12 |
| 102 | 002706 | 良信股份   | 40,000  | 901,600.00   | 0.11 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 103 | 601319 | 中国人保 | 150,000 | 889,500.00 | 0.11 |
| 104 | 002966 | 苏州银行 | 90,000  | 661,500.00 | 0.08 |
| 105 | 688033 | 天宜上佳 | 40,000  | 635,600.00 | 0.08 |
| 106 | 600763 | 通策医疗 | 1,000   | 411,000.00 | 0.05 |
| 107 | 688161 | 威高骨科 | 3,069   | 325,467.45 | 0.04 |
| 108 | 301015 | 百洋医药 | 4,614   | 251,115.78 | 0.03 |
| 109 | 688079 | 美迪凯  | 10,622  | 195,444.80 | 0.02 |
| 110 | 688613 | 奥精医疗 | 2,617   | 166,179.50 | 0.02 |
| 111 | 300957 | 贝泰妮  | 655     | 165,033.80 | 0.02 |
| 112 | 301016 | 雷尔伟  | 2,747   | 115,711.58 | 0.01 |
| 113 | 300919 | 中伟股份 | 610     | 99,430.00  | 0.01 |
| 114 | 688201 | 信安世纪 | 2,129   | 96,677.89  | 0.01 |
| 115 | 688621 | 阳光诺和 | 1,485   | 95,025.15  | 0.01 |
| 116 | 688499 | 利元亨  | 2,149   | 83,488.65  | 0.01 |
| 117 | 300979 | 华利集团 | 897     | 78,487.50  | 0.01 |
| 118 | 301018 | 申菱环境 | 7,811   | 64,753.19  | 0.01 |
| 119 | 688117 | 圣诺生物 | 1,672   | 60,141.84  | 0.01 |
| 120 | 688239 | 航宇科技 | 4,926   | 56,550.48  | 0.01 |
| 121 | 688087 | 英科再生 | 2,469   | 54,219.24  | 0.01 |
| 122 | 301020 | 密封科技 | 4,210   | 44,794.40  | 0.01 |
| 123 | 300981 | 中红医疗 | 472     | 42,664.08  | 0.01 |
| 124 | 300973 | 立高食品 | 360     | 41,655.60  | 0.01 |
| 125 | 688659 | 元琛科技 | 3,671   | 38,398.66  | 0.00 |
| 126 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230   | 34,721.10  | 0.00 |
| 127 | 688517 | 金冠电气 | 2,892   | 34,356.96  | 0.00 |
| 128 | 688367 | 工大高科 | 1,717   | 30,802.98  | 0.00 |
| 129 | 301021 | 英诺激光 | 2,899   | 27,424.54  | 0.00 |
| 130 | 300953 | 震裕科技 | 240     | 23,964.00  | 0.00 |
| 131 | 001207 | 联科科技 | 682     | 22,581.02  | 0.00 |
| 132 | 301009 | 可靠股份 | 801     | 22,339.89  | 0.00 |
| 133 | 300941 | 创识科技 | 399     | 19,926.06  | 0.00 |
| 134 | 688226 | 威腾电气 | 2,693   | 17,289.06  | 0.00 |
| 135 | 300925 | 法本信息 | 600     | 15,774.00  | 0.00 |
| 136 | 300932 | 三友联众 | 492     | 15,601.32  | 0.00 |
| 137 | 300982 | 苏文电能 | 317     | 14,356.93  | 0.00 |
| 138 | 300968 | 格林精密 | 1,162   | 14,025.34  | 0.00 |
| 139 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754   | 13,558.42  | 0.00 |
| 140 | 300940 | 南极光  | 307     | 13,317.66  | 0.00 |
| 141 | 300614 | 百川畅银 | 329     | 13,285.02  | 0.00 |

|     |        |      |       |           |      |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 142 | 300937 | 药易购  | 244   | 13,105.24 | 0.00 |
| 143 | 300942 | 易瑞生物 | 443   | 12,634.36 | 0.00 |
| 144 | 603171 | 税友股份 | 637   | 12,230.40 | 0.00 |
| 145 | 300997 | 欢乐家  | 928   | 12,110.40 | 0.00 |
| 146 | 300933 | 中辰股份 | 1,112 | 11,609.28 | 0.00 |
| 147 | 301002 | 崧盛股份 | 201   | 11,581.62 | 0.00 |
| 148 | 605287 | 德才股份 | 349   | 11,014.44 | 0.00 |
| 149 | 300955 | 嘉亨家化 | 232   | 10,688.24 | 0.00 |
| 150 | 300996 | 普联软件 | 241   | 10,177.43 | 0.00 |
| 151 | 300956 | 英力股份 | 371   | 9,571.80  | 0.00 |
| 152 | 300962 | 中金辐照 | 576   | 9,429.12  | 0.00 |
| 153 | 300952 | 恒辉安防 | 340   | 9,207.20  | 0.00 |
| 154 | 300945 | 曼卡龙  | 474   | 8,949.12  | 0.00 |
| 155 | 300948 | 冠中生态 | 324   | 8,884.08  | 0.00 |
| 156 | 300931 | 通用电梯 | 672   | 8,809.92  | 0.00 |
| 157 | 300961 | 深水海纳 | 394   | 8,695.58  | 0.00 |
| 158 | 300950 | 德固特  | 219   | 8,569.47  | 0.00 |
| 159 | 605162 | 新中港  | 1,377 | 8,358.39  | 0.00 |
| 160 | 300986 | 志特新材 | 264   | 8,070.48  | 0.00 |
| 161 | 300987 | 川网传媒 | 301   | 8,069.81  | 0.00 |
| 162 | 300978 | 东箭科技 | 593   | 8,064.80  | 0.00 |
| 163 | 300926 | 博俊科技 | 359   | 7,969.80  | 0.00 |
| 164 | 300993 | 玉马遮阳 | 410   | 7,908.90  | 0.00 |
| 165 | 300930 | 屹通新材 | 322   | 7,882.56  | 0.00 |
| 166 | 300985 | 致远新能 | 295   | 7,318.95  | 0.00 |
| 167 | 300971 | 博亚精工 | 245   | 6,931.05  | 0.00 |
| 168 | 301004 | 嘉益股份 | 312   | 6,845.28  | 0.00 |
| 169 | 300991 | 创益通  | 254   | 6,733.54  | 0.00 |
| 170 | 300927 | 江天化学 | 217   | 6,531.70  | 0.00 |
| 171 | 300975 | 商络电子 | 492   | 6,410.76  | 0.00 |
| 172 | 300963 | 中洲特材 | 283   | 6,364.67  | 0.00 |
| 173 | 301011 | 华立科技 | 175   | 5,922.00  | 0.00 |
| 174 | 300943 | 春晖智控 | 255   | 5,867.55  | 0.00 |
| 175 | 300967 | 晓鸣股份 | 507   | 5,850.78  | 0.00 |
| 176 | 300972 | 万辰生物 | 430   | 5,439.50  | 0.00 |
| 177 | 300929 | 华骐环保 | 183   | 5,407.65  | 0.00 |
| 178 | 300960 | 通业科技 | 234   | 5,396.04  | 0.00 |
| 179 | 605011 | 杭州热电 | 525   | 4,662.00  | 0.00 |
| 180 | 300995 | 奇德新材 | 191   | 4,454.12  | 0.00 |



|     |        |      |     |          |      |
|-----|--------|------|-----|----------|------|
| 181 | 300998 | 宁波方正 | 201 | 4,285.32 | 0.00 |
| 182 | 301012 | 扬电科技 | 170 | 4,124.20 | 0.00 |
| 183 | 300992 | 泰福泵业 | 200 | 4,064.00 | 0.00 |
| 184 | 301010 | 晶雪节能 | 218 | 3,838.98 | 0.00 |
| 185 | 600276 | 恒瑞医药 | 39  | 2,650.83 | 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  | 600036 | 招商银行   | 19,397,954.00 | 1.96            |
| 2  | 600809 | 山西汾酒   | 18,431,132.00 | 1.86            |
| 3  | 603501 | 韦尔股份   | 18,389,111.00 | 1.86            |
| 4  | 000651 | 格力电器   | 18,337,086.00 | 1.85            |
| 5  | 000725 | 京东方 A  | 17,171,796.00 | 1.73            |
| 6  | 000157 | 中联重科   | 17,134,187.66 | 1.73            |
| 7  | 000830 | 鲁西化工   | 16,866,505.71 | 1.70            |
| 8  | 601377 | 兴业证券   | 16,610,913.62 | 1.68            |
| 9  | 600887 | 伊利股份   | 16,396,623.00 | 1.66            |
| 10 | 601336 | 新华保险   | 15,580,888.00 | 1.57            |
| 11 | 603806 | 福斯特    | 15,560,609.11 | 1.57            |
| 12 | 002557 | 洽洽食品   | 15,222,887.40 | 1.54            |
| 13 | 002714 | 牧原股份   | 14,699,241.50 | 1.48            |
| 14 | 601318 | 中国平安   | 14,637,396.00 | 1.48            |
| 15 | 600519 | 贵州茅台   | 14,296,067.86 | 1.44            |
| 16 | 002409 | 雅克科技   | 14,238,067.88 | 1.44            |
| 17 | 000100 | TCL 科技 | 14,208,334.00 | 1.43            |
| 18 | 300413 | 芒果超媒   | 14,067,350.83 | 1.42            |
| 19 | 600660 | 福耀玻璃   | 13,994,624.22 | 1.41            |
| 20 | 002415 | 海康威视   | 13,706,320.72 | 1.38            |

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  | 600519 | 贵州茅台   | 31,557,273.00 | 3.19   |
| 2  | 601318 | 中国平安   | 31,231,333.74 | 3.15   |
| 3  | 000858 | 五粮液    | 23,236,212.00 | 2.35   |
| 4  | 000100 | TCL 科技 | 20,746,720.00 | 2.09   |
| 5  | 600036 | 招商银行   | 20,673,468.00 | 2.09   |
| 6  | 002415 | 海康威视   | 20,558,516.80 | 2.08   |
| 7  | 300122 | 智飞生物   | 18,638,044.62 | 1.88   |
| 8  | 601688 | 华泰证券   | 18,635,633.60 | 1.88   |
| 9  | 002714 | 牧原股份   | 18,101,635.00 | 1.83   |
| 10 | 000651 | 格力电器   | 17,716,015.00 | 1.79   |
| 11 | 600887 | 伊利股份   | 17,284,296.00 | 1.75   |
| 12 | 600031 | 三一重工   | 17,078,616.01 | 1.72   |
| 13 | 300059 | 东方财富   | 16,712,823.72 | 1.69   |
| 14 | 000830 | 鲁西化工   | 16,659,297.93 | 1.68   |
| 15 | 600690 | 海尔智家   | 16,339,176.00 | 1.65   |
| 16 | 002241 | 歌尔股份   | 16,187,740.48 | 1.63   |
| 17 | 601336 | 新华保险   | 16,023,523.00 | 1.62   |
| 18 | 000002 | 万科 A   | 15,496,889.00 | 1.56   |
| 19 | 000333 | 美的集团   | 15,320,331.25 | 1.55   |
| 20 | 002013 | 中航机电   | 15,101,634.66 | 1.52   |

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 | 1,670,221,619.80 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,814,030,656.97 |

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      | 10,000,000.00 | 1.26          |
| 2  | 央行票据      | -             | -             |
| 3  | 金融债券      | -             | -             |
|    | 其中：政策性金融债 | -             | -             |
| 4  | 企业债券      | -             | -             |
| 5  | 企业短期融资券   | -             | -             |

|    |           |               |      |
|----|-----------|---------------|------|
| 6  | 中期票据      | -             | -    |
| 7  | 可转债（可交换债） | 1,546,000.00  | 0.19 |
| 8  | 同业存单      | -             | -    |
| 9  | 其他        | -             | -    |
| 10 | 合计        | 11,546,000.00 | 1.45 |

## 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  | 019640 | 20 国债 10 | 100,000 | 10,000,000.00 | 1.26         |
| 2  | 113050 | 南银转债     | 15,460  | 1,546,000.00  | 0.19         |

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码                | 名称     | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元）         | 公允价值变动（元）     | 风险说明           |
|-------------------|--------|----------|-----------------|---------------|----------------|
| IF2109            | IF2109 | -228     | -353,381,760.00 | -2,319,893.69 | -              |
| IF2112            | IF2112 | -84      | -129,533,040.00 | -4,536,720.00 | -              |
| 公允价值变动总额合计（元）     |        |          |                 |               | -6,856,613.69  |
| 股指期货投资本期收益（元）     |        |          |                 |               | -26,532,206.41 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |        |          |                 |               | 15,901,286.41  |

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金的衍生品投资将严格遵守证监会及相关法律法规的约束，合理利用股指期货、权证等衍生工具，利用数量方法发掘可能的套利机会。投资原则为有利于基金资产增值，控制下跌风险，实现保值和锁定收益。目前衍生品投资策略主要是股指期货套利，即采用股指期货套利的对冲策略积极发现市场上如期货与现货之间、期货不同合约之间等的价差关系，进行套利，以获取绝对

收益。股指期货套利包括以下两种方式：

#### 1) 期现套利

期现套利过程中，由于股指期货合约价格与标的指数价格之间的价差不断变动，套利交易可以通过捕捉该价差进而获利。

#### 2) 跨期套利

跨期套利过程中，不同期货合约之间的价差不断变动，套利交易通过捕捉合约间价差进而获利。

基金经理会实时关注市场的发展，前瞻性地运用其他绝对收益策略。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

#### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

#### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

### 7.12 市场中性策略执行情况

截至本报告期末，本基金持有股票资产 496,520,285.49 元，占基金资产净值的比例为 62.56%；运用股指期货进行对冲的空头合约市值 -482,914,800.00 元，占基金资产净值的比例为 -60.85%，空头合约市值占股票资产的比例为 -97.26%。

本报告期内，本基金执行市场中性策略的投资收益为 38,184,913.04 元，公允价值变动损益为 -20,790,776.54 元。

### 7.13 投资组合报告附注

#### 7.13.1 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

本基金投资的招商银行（600036），其发行主体招商银行股份有限公司于 2021 年 5 月 17 日收到中国银行保险监督管理委员会发出的银保监罚决字【2021】16 号，被处以罚款。

除此，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

**7.13.2 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。

**7.13.3 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   | 58,397,059.29  |
| 2  | 应收证券清算款 | 44,659,202.58  |
| 3  | 应收股利    | -              |
| 4  | 应收利息    | 283,598.09     |
| 5  | 应收申购款   | -              |
| 6  | 其他应收款   | -              |
| 7  | 待摊费用    | -              |
| 8  | 其他      | -              |
| 9  | 合计      | 103,339,859.96 |

**7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.13.5 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 |
| 1,606        | 464,479.23    | 702,593,288.96 | 94.19%     | 43,360,350.39 | 5.81%      |

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份）    | 占基金总份额比例 |
|------------------|--------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 1,133,230.54 | 0.1519%  |

### 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<br>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                 |

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目              | 持有份额总数       | 持有份额占<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额总数       | 发起份额占<br>基金总份<br>额比例（%） | 发起份额承<br>诺持有期限 |
|-----------------|--------------|-------------------------|--------------|-------------------------|----------------|
| 基金管理人固有资<br>金   | 9,999,000.00 | 1.34                    | 9,999,000.00 | 1.34                    | 不少于3年          |
| 基金管理人高级管<br>理人员 | -            | -                       | -            | -                       | -              |
| 基金经理等人员         | -            | -                       | -            | -                       | -              |
| 基金管理人股东         | -            | -                       | -            | -                       | -              |
| 其他              | -            | -                       | -            | -                       | -              |
| 合计              | 9,999,000.00 | 1.34                    | 9,999,000.00 | 1.34                    | 不少于3年          |

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

|                                   |                  |
|-----------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（ 2015 年 12 月 30 日 ）基金份额总额 | 1,239,463,253.94 |
| 本报告期期初基金份额总额                      | 939,870,419.98   |
| 本报告期基金总申购份额                       | 54,691,977.54    |
| 减：本报告期基金总赎回份额                     | 248,608,758.17   |
| 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                      | 745,953,639.35   |

## § 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

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易             |              | 应支付该券商的佣金    |            | 备注 |
|------|--------|------------------|--------------|--------------|------------|----|
|      |        | 成交金额             | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金           | 占当期佣金总量的比例 |    |
| 东北证券 | 2      | 3,473,667,797.63 | 100.00%      | 3,235,030.04 | 100.00%    | -  |
| 长江证券 | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |
| 中信证券 | 2      | -                | -            | -            | -          | -  |

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

(2) 券商经纪人具有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据中邮创业基



金管理有限公司所管理基金的特定要求，提供研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

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

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

2、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 |
| 东北证券 | 204,869,924.54 | 100.00%      | 2,005,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 长江证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |
| 中信证券 | -              | -            | -                | -              | -    | -            |

### 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费率优惠活动的公告               | 规定媒介   | 2021年6月30日 |
| 2  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行股份有限公司费率优惠活动的公告 | 规定媒介   | 2021年6月17日 |
| 3  | 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告   | 规定媒介   | 2021年6月10日 |
| 4  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司费率优惠活动的公告     | 规定媒介   | 2021年6月10日 |
| 5  | 中邮绝对收益策略定期开放混合                                  | 规定媒介   | 2021年6月9日  |

|    |   |      |                 |
|----|---|------|-----------------|
|    | 型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告                           |      |                 |
| 6  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于玄元保险调整基金申购起点金额下限的公告             | 规定媒介 | 2021 年 5 月 27 日 |
| 7  | 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2021 年第 1 季度报告         | 规定媒介 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 8  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于调整特定投资群体通过直销柜台申购旗下部分基金费率优惠方案的公告 | 规定媒介 | 2021 年 4 月 22 日 |
| 9  | 中邮创业基金管理股份有限公司关于增加北京度小满基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠的公告  | 规定媒介 | 2021 年 4 月 19 日 |
| 10 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于珠海盈米调整基金申购及定投起点金额下限的公告          | 规定媒介 | 2021 年 3 月 26 日 |
| 11 | 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金关于运用股指期货对冲的投资策略执行情况公告   | 规定媒介 | 2021 年 3 月 11 日 |
| 12 | 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年年度报告             | 规定媒介 | 2021 年 3 月 11 日 |
| 13 | 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金开放申购、赎回业务公告             | 规定媒介 | 2021 年 3 月 10 日 |
| 14 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于中邮绝对收益赎回费率优惠活动的公告               | 规定媒介 | 2021 年 3 月 10 日 |
| 15 | 风险揭示书   | 规定媒介 | 2021 年 1 月 28 日 |
| 16 | 中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金 2020 年第 4 季度报告         | 规定媒介 | 2021 年 1 月 22 日 |

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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金募集的文件
2. 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金合同》
3. 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金托管协议》
4. 《中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式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

2021 年 8 月 31 日