

# 中邮乐享收益灵活配置混合型 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：中国农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

中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金——中邮创业基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人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 2021 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 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.....	8
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>9</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
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的真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</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.....	57

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮乐享收益灵活配置混合
基金主代码	001430
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 6 月 15 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	373,132,968.36 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的股票投资策略相结合的方法进行投资。</p> <p>（一）大类资产配置</p> <p>本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>（二）行业配置策略</p> <p>本基金通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，从行业对上述因素变化的敏感程度和受益程度入手，筛选处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。</p> <p>对于国家宏观经济运行过程中产生的阶段性焦点行业，本基金通过对经济运行周期、行业竞争态势以及国家产业政策调整等影响行业短期运行情况的因素进行分析和研究，筛选具有短期重点发展趋势的行业资产进行配置，并依据上述因素的短期变化对行业配置权重进行动态调整。</p> <p>（三）股票投资策略</p> <p>本基金以成长投资为主线，核心是投资处于高速成长期并具有竞争壁垒的上市公司。本基金通过定量和定性相结合的方法定期分析和评估上市公司的成长空间和竞争壁垒，从而确定本基金重点投资的成长型行业，并根据定期分析和评估结果动态调整。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>本基金采用的债券投资策略主要包括：久期策略、期限结构策略和个券选择策略等。</p> <p>（1）久期策略</p> <p>根据国内外的宏观经济形势、经济周期、国家的货币政策、汇率政策等经济</p>

因素，对未来利率走势做出准确预测，并确定本基金投资组合久期的长短。考虑到收益率变动对久期的影响，若预期利率将持续下行，则增加信用投资组合的久期；相反，则缩短信用投资组合的久期。组合久期选定之后，要根据各相关经济因素的实时变化，及时调整组合久期。考虑信用溢价对久期的影响，若经济下行，预期利率持续下行的同时，长久期产品比短久期产品将面临更多的信用风险，信用溢价要求更高。因此应缩短久期，并尽量配置更多的信用级别较高的产品。

#### （2）期限结构策略

本基金根据国际国内经济形势、国家的货币政策、汇率政策、货币市场的供需关系、投资者对未来利率的预期等因素，对收益率曲线的变动趋势及变动幅度做出预测。收益率曲线的变动趋势包括：向上平行移动、向下平行移动、曲线趋缓转折、曲线陡峭转折、曲线正蝶式移动和曲线反蝶式移动等。本基金根据变动趋势及变动幅度预测来决定信用投资产品组合的期限结构，然后选择采取相应期限结构的策略：子弹策略、杠铃策略或梯式策略。若预期收益曲线平行移动，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小，宜采用子弹策略；若预期收益曲线做趋缓转折，宜采用杠铃策略；若预期收益曲线做陡峭转折，且幅度较大，宜采用杠铃策略；若幅度较小宜采用子弹策略。用做判断依据的具体正向及负向变动幅度临界点，需要运用测算模型进行测算。

#### （3）个券选择策略

1) 特定跟踪策略

2) 相对价值策略

#### （4）中小企业私募债投资策略

利用自下而上的公司、行业层面定性分析，结合 Z-Score、KMV 等数量分析模型，测算中小企业私募债的违约风险。考虑海外市场高收益债违约事件在不同行业间的明显差异，根据自上而下的宏观经济及行业特性分析，从行业层面对中小企业私募债违约风险进行多维度的分析。个券的选择基于风险溢价与通过公司内部模型测算所得违约风险之间的差异，结合流动性、信息披露、偿债保障等方面的考虑。

#### （5）可转换债券的投资策略

1) 普通可转换债券投资策略

2) 可分离交易可转债

#### （五）权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合。未来，随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等，基金还将积极寻求其他投资机会，履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

#### （六）股指期货投资策略

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

	(七) 资产支持证券投资策略 本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。
业绩比较基准	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	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人或基金托管人的办公场所。

### 2.5 其他相关资料

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



### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	20,890,088.01
本期利润	5,193,969.70
加权平均基金份额本期利润	0.0122
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	1.19%
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	166,153,764.25
期末可供分配基金份额利润	0.4453
期末基金资产净值	539,286,732.61
期末基金份额净值	1.445
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	52.38%

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）。

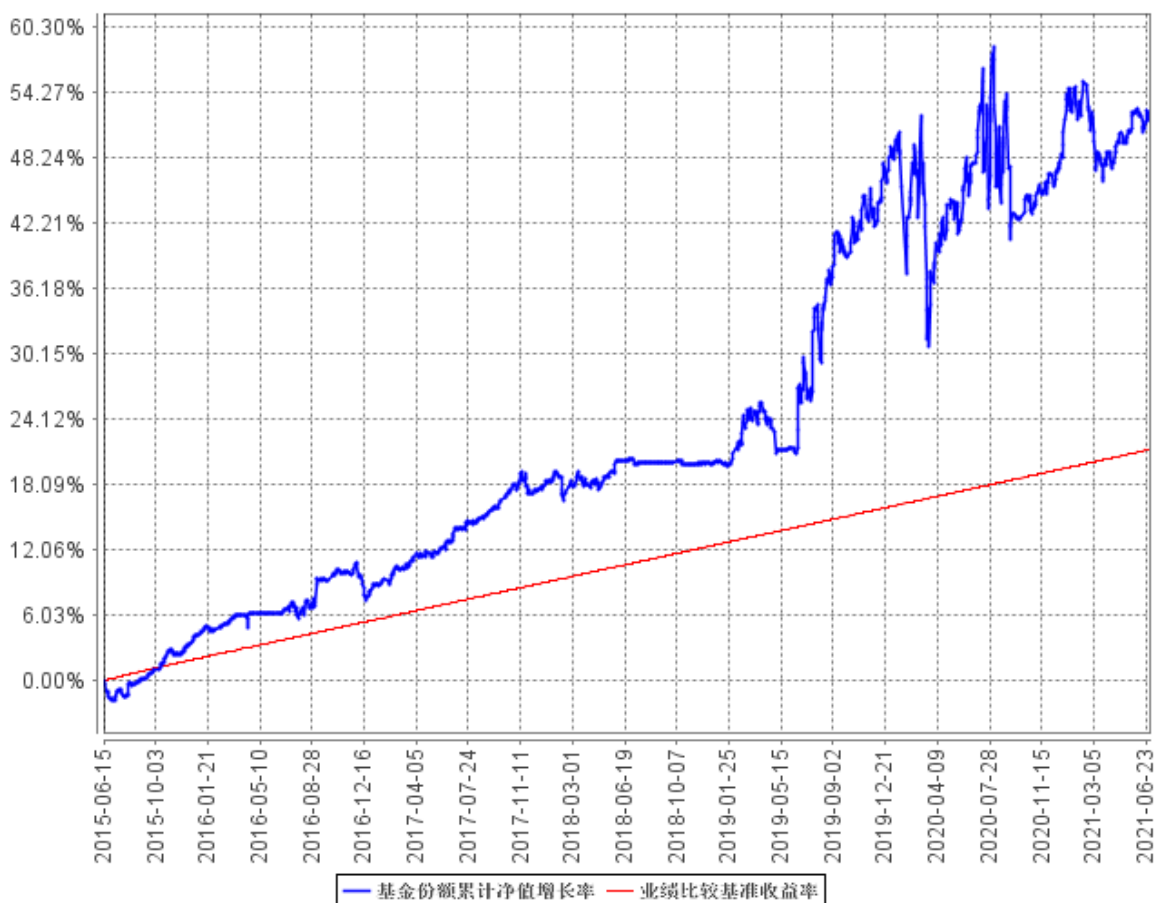
#### 3.2 基金净值表现

##### 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	-0.07%	0.29%	0.24%	0.01%	-0.31%	0.28%
过去三个月	3.29%	0.30%	0.72%	0.01%	2.57%	0.29%
过去六个月	1.19%	0.48%	1.45%	0.01%	-0.26%	0.47%
过去一年	2.70%	0.98%	2.97%	0.01%	-0.27%	0.97%
过去三年	26.53%	0.83%	9.48%	0.01%	17.05%	0.82%
自基金合同生效起至今	52.38%	0.60%	21.32%	0.01%	31.06%	0.59%

### 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	2019年6月5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。
王高	基金经理	2020年7月8日	-	6年	曾任中邮创业基金管理股份有限公司量化投资部量化分析师、基金经理助理。现担任中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金为灵活配置型基金，基金管理人根据市场环境，灵活配置权益和固定收益证券的仓位比例，并根据基金管理人对市场的研判，精选持仓股票和债券标的，力求基金净值低波动、稳健的增长。

股票投资方面，本基金投资主线为寻找大盘蓝筹中业绩增长稳定、估值合理的龙头股票。报告期内本基金坚持既定的投资策略，依据上市公司的财务、估值、成长性等指标从中大盘股中精选股票进行重点投资。债券投资方面，本基金主要投资于高评级、短久期、高流动性的利率债和信用债。

#### 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 1.445 元，累计净值为 1.505 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.19%，业绩比较基准收益率为 1.45%。

#### 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，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《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 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、基金费用开支及利润分配等问题上，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《中华人民共和国证券投资基金法》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《公开募集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，未发现有关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：中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	34,728,886.00	50,557,027.87
结算备付金		11,141,772.87	5,976,133.54
存出保证金		136,587.56	4,491,469.04
交易性金融资产	6.4.7.2	463,929,595.14	558,261,021.38
其中：股票投资		142,756,595.14	197,517,021.38
基金投资		-	-
债券投资		321,173,000.00	360,744,000.00
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	25,000,000.00	-
应收证券清算款		303,783.56	30,560,923.45
应收利息	6.4.7.5	6,021,625.22	5,456,205.80
应收股利		-	-
应收申购款		29.97	59.92
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		541,262,280.32	655,302,841.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 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		690,039.26	1,441,968.98
应付赎回款		216.39	3,377.66
应付管理人报酬		266,749.07	338,865.38
应付托管费		88,916.37	112,955.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	625,487.78	754,850.02
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	304,138.84	462,464.15
负债合计		1,975,547.71	3,114,481.33
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	373,132,968.36	456,722,076.56
未分配利润	6.4.7.10	166,153,764.25	195,466,283.11
所有者权益合计		539,286,732.61	652,188,359.67
负债和所有者权益总计		541,262,280.32	655,302,841.00

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.445 元，基金份额总额 373,132,968.36 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		9,681,786.38	414,058.66
1.利息收入		5,797,745.42	178,897.12
其中：存款利息收入	6.4.7.11	574,393.01	72,411.61
债券利息收入		5,129,381.13	78,731.52
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		93,971.28	27,753.99
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		19,151,494.59	5,876,062.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	18,595,554.13	5,728,040.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	949,400.92	-82,860.73
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	-1,511,087.62	-
股利收益	6.4.7.16	1,117,627.16	230,883.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-15,696,118.31	-6,066,996.75
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	428,664.68	426,095.46
<b>减：二、费用</b>		4,487,816.68	831,998.79
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,811,269.69	368,109.80
2. 托管费	6.4.10.2.2	603,756.58	73,621.99

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,940,070.19	287,433.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.14	-
7. 其他费用	6.4.7.20	132,720.08	102,833.91
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,193,969.70	-417,940.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,193,969.70	-417,940.13

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金

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 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）	456,722,076.56	195,466,283.11	652,188,359.67
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,193,969.70	5,193,969.70
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）	-83,589,108.20	-34,506,488.56	-118,095,596.76
其中：1. 基金申购款	34,963,431.89	15,346,349.71	50,309,781.60
2. 基金赎回款	-118,552,540.09	-49,852,838.27	-168,405,378.36
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）	373,132,968.36	166,153,764.25	539,286,732.61
项目	上年度可比期间 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)	89,175,357.78	36,289,816.57	125,465,174.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-417,940.13	-417,940.13
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)	-84,337,892.94	-33,902,992.17	-118,240,885.11
其中：1.基金申购款	30,891,096.23	10,062,576.36	40,953,672.59
2.基金赎回款	-115,228,989.17	-43,965,568.53	-159,194,557.70
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)	4,837,464.84	1,968,884.27	6,806,349.11

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

中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）已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）1014 号《关于准予中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》批准募集，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2015 年 6 月 15 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 506,243,859.21 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）验字(2015)第 110ZC0266 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《中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、可转换债券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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）。本基金的投资组合比例为：股票投资占基金资产的比例为 0%~95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%~100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为 0%~3%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

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

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

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

#### **6.4.4 重要会计政策和会计估计**

本报告期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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	34,728,886.00
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：	34,728,886.00

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	133,900,907.78	142,756,595.14	8,855,687.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	999,000.00	999,000.00
	银行间市场	317,234,051.67	320,174,000.00
	合计	318,233,051.67	321,173,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	452,133,959.45	463,929,595.14	11,795,635.69

##### 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 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,000,000.00	-

##### 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 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	17,503.73
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	4,207.29
应收债券利息	5,985,842.67
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	14,016.18
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	55.35
合计	6,021,625.22

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
----	------------------------

交易所市场应付交易费用	624,637.78
银行间市场应付交易费用	850.00
合计	625,487.78

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.49
应付证券出借违约金	-
预提费用	304,138.35
合计	304,138.84

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	456,722,076.56	456,722,076.56
本期申购	34,963,431.89	34,963,431.89
本期赎回(以“-”号填列)	-118,552,540.09	-118,552,540.09
本期末	373,132,968.36	373,132,968.36

#### 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	400,976,298.59	-205,510,015.48	195,466,283.11
本期利润	20,890,088.01	-15,696,118.31	5,193,969.70
本期基金份额交易产生的变动数	-75,494,306.40	40,987,817.84	-34,506,488.56
其中：基金申购款	31,147,263.20	-15,800,913.49	15,346,349.71
基金赎回款	-106,641,569.60	56,788,731.33	-49,852,838.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	346,372,080.20	-180,218,315.95	166,153,764.25



**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	518,968.62
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	53,408.76
其他	2,015.63
合计	574,393.01

**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 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	649,037,939.84
减：卖出股票成本总额	630,442,385.71
买卖股票差价收入	18,595,554.13

**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 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	949,400.92
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	949,400.92

**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 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	112,856,895.90

总额	
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付） 成本总额	109,611,838.33
减：应收利息总额	2,295,656.65
买卖债券差价收入	949,400.92

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本期末未持有资产支持证券。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末未持有衍生工具。

#### 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 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	-1,511,087.62

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,117,627.16
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,117,627.16

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-17,715,345.93
——股票投资	-17,422,924.26

——债券投资	-292,421.67
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	2,019,227.62
——权证投资	-
——股指期货	2,019,227.62
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	-15,696,118.31

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	428,664.68
合计	428,664.68

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（不含93日）的，将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于93日（含93日）但少于186日的，将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于186日（含186日）的，将不低于赎回费总额的25%归基金财产。其余用于注册登记费和其他必要的手续费。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,939,020.19
银行间市场交易费用	1,050.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	1,940,070.19

### 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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
债券帐户维护费	9,000.00
银行费用	9,981.73
上清所债券账户维护费	9,600.00
合计	132,720.08

### 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股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

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 6.4.10.1 关联方报酬

##### 6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 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	1,811,269.69	368,109.80
其中：支付销售机构的客户维护费	8,306.91	76,887.52

注：支付基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值 0.6% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.6\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	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
当期发生的基金应支付的托管费	603,756.58	73,621.99

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 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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。

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

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。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

**6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 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
中国农业银行股份有限公司	34,728,886.00	518,968.62	6,355,392.54	69,458.00

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期内本基金未实施利润分配。

**6.4.12 期末（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 (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	2021年	2021	新股流	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-

	电气	6月28日	2021年7月7日	通受限							
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		-
688345	博力威	2021年6月3日	2021年12月13日	新股流通受限	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96		-
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52		-
688097	博众精工	2021年4月29日	2021年11月12日	新股流通受限	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83		-
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	新股流通受限	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15		-
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	399	18,884.67	100,532.04		-
688316	青云科技	2021年3月5日	2021年9月16日	新股流通受限	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00		-
688329	艾隆科技	2021年3月16日	2021年9月29日	新股流通受限	16.81	50.04	1,846	31,031.26	92,373.84		-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00		-
688533	上声电子	2021年4月9日	2021年10月19日	新股流通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23		-
688611	杭州柯林	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00		-

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	560	18,603.20	49,000.00	-
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	-
688597	煜邦电力	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
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	296	14,382.64	26,755.44	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
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	2021年	2021	新股流	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-

	生态	2月18日	2021年8月25日	通受限							
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11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81		-
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	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

		日	月2日							
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

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月21日	2021年7月1日	新债流通受限	100.00	100.00	9,990	999,000.00	999,000.00	-

注：1、以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上市公司公告为准。

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。

2、申菱环境（301018）期末限售7811股，其中782股限售期限为自上市交易之日起6个月，可流通日为2022年1月7日；密封科技（301020）期末限售4210股，其中421股限售期限为自上市交易之日起6个月，可流通日为2022年1月6日；英诺激光（301021）期末限售2899股，其中290股限售期限为自上市交易之日起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

本期末本基金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交易所市场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

期末未参与转融通证券出借业务。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

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

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	999,000.00	-
AAA 以下	-	-

未评级	320,174,000.00	360,744,000.00
合计	321,173,000.00	360,744,000.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 6.4.13.3.1 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 2021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	34,728,886.00	-	-	-	34,728,886.00
结算备付金	11,141,772.87	-	-	-	11,141,772.87
存出保证金	136,587.56	-	-	-	136,587.56
交易性金融资产	-	320,174,000.00	999,000.00	142,756,595.14	463,929,595.14
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	25,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	303,783.56	303,783.56
应收利息	-	-	-	6,021,625.22	6,021,625.22
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	29.97	29.97
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	71,007,246.43	320,174,000.00	999,000.00	149,082,033.89	541,262,280.32
负债					
应付证券清算款	-	-	-	690,039.26	690,039.26
应付赎回款	-	-	-	216.39	216.39
应付管理人报酬	-	-	-	266,749.07	266,749.07
应付托管费	-	-	-	88,916.37	88,916.37
应付交易费用	-	-	-	625,487.78	625,487.78
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	304,138.84	304,138.84
负债总计	-	-	-	1,975,547.71	1,975,547.71
利率敏感度缺口	71,007,246.43	320,174,000.00	999,000.00	147,106,486.18	539,286,732.61
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	50,557,027.87	-	-	-	50,557,027.87
结算备付金	5,976,133.54	-	-	-	5,976,133.54
存出保证金	4,491,469.04	-	-	-	4,491,469.04
交易性金融资产		360,744,000.00	-	197,517,021.38	558,261,021.38
衍生金融资产		-	-	-	-
买入返售金融资产		-	-	-	-
应收证券清算款		-	-	30,560,923.45	30,560,923.45
应收利息		-	-	5,456,205.80	5,456,205.80
应收股利		-	-	-	-
应收申购款		-	-	59.92	59.92
其他资产		-	-	-	-
资产总计	61,024,630.45	360,744,000.00	-	233,534,210.55	655,302,841.00
负债					
卖出回购金融资产		-	-	-	-
应付证券清算款		-	-	1,441,968.98	1,441,968.98
应付赎回款		-	-	3,377.66	3,377.66
应付管理人报酬		-	-	338,865.38	338,865.38
应付托管费		-	-	112,955.14	112,955.14
应付交易费用		-	-	754,850.02	754,850.02
应交税费		-	-	-	-
应付利息		-	-	-	-
应付利润		-	-	-	-
其他负债		-	-	462,464.15	462,464.15
负债总计		-	-	3,114,481.33	3,114,481.33
利率敏感度缺口	61,024,630.45	360,744,000.00	-	230,419,729.22	652,188,359.67

#### 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	-1,936,092.62	-2,238,237.32
2. 基金净资产变动	1,972,111.21	2,278,338.00	



#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金本报告期末未持有外汇投资，因此市场汇率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.3 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（含中小企业私募债券）、可转换债券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0%~95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%~100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为 0%~3%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的 10%。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制并遵守相关期货交易所的业务规则。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	142,756,595.14	26.47	197,517,021.38	30.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	321,173,000.00	59.56	360,744,000.00	55.31
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	463,929,595.14	86.03	558,261,021.38	85.60

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	2. 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
	1. 基金净资产变动	-12,539,839.10	-60,683,658.51
	2. 基金净资产变动	12,539,839.10	60,683,658.51

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-2.70。

#### 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	142,756,595.14	26.37
	其中：股票	142,756,595.14	26.37
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	321,173,000.00	59.34
	其中：债券	321,173,000.00	59.34
	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	25,000,000.00	4.62
	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	45,870,658.87	8.47
8	其他各项资产	6,462,026.31	1.19
9	合计	541,262,280.32	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	11,290.28	0.00
B	采矿业	6,113,251.35	1.13
C	制造业	79,129,200.10	14.67
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	46,404.58	0.01
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	4,086,697.70	0.76
J	金融业	34,488,851.14	6.40
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	3,669,900.00	0.68
M	科学研究和技术服务业	7,781,300.00	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	36,272.33	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	7,344,940.00	1.36
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	142,756,595.14	26.47

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产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	000858	五粮液	24,000	7,149,360.00	1.33
2	600519	贵州茅台	3,200	6,581,440.00	1.22
3	600036	招商银行	120,000	6,502,800.00	1.21
4	000725	京东方 A	1,000,000	6,240,000.00	1.16
5	600919	江苏银行	800,000	5,680,000.00	1.05
6	000063	中兴通讯	159,930	5,314,473.90	0.99
7	300059	东方财富	150,000	4,918,500.00	0.91
8	603259	药明康德	30,000	4,697,700.00	0.87
9	600426	华鲁恒升	150,000	4,642,500.00	0.86
10	600887	伊利股份	120,000	4,419,600.00	0.82
11	600031	三一重工	140,000	4,069,800.00	0.75
12	002409	雅克科技	50,000	4,050,000.00	0.75
13	600030	中信证券	160,000	3,990,400.00	0.74
14	600089	特变电工	300,000	3,855,000.00	0.71
15	300244	迪安诊断	100,000	3,830,000.00	0.71
16	002027	分众传媒	390,000	3,669,900.00	0.68
17	002460	赣锋锂业	30,000	3,632,700.00	0.67
18	600104	上汽集团	160,000	3,515,200.00	0.65
19	603882	金域医学	22,000	3,514,940.00	0.65
20	000932	华菱钢铁	529,979	3,497,861.40	0.65
21	300124	汇川技术	47,000	3,490,220.00	0.65
22	601211	国泰君安	200,000	3,428,000.00	0.64
23	000001	平安银行	150,000	3,393,000.00	0.63
24	601899	紫金矿业	350,000	3,391,500.00	0.63
25	300033	同花顺	30,018	3,385,430.04	0.63

26	002555	三七互娱	140,000	3,362,800.00	0.62
27	601009	南京银行	300,000	3,156,000.00	0.59
28	601233	桐昆股份	130,000	3,131,700.00	0.58
29	300685	艾德生物	30,000	3,122,400.00	0.58
30	002049	紫光国微	20,000	3,083,800.00	0.57
31	300676	华大基因	26,000	3,083,600.00	0.57
32	601636	旗滨集团	160,000	2,969,600.00	0.55
33	601857	中国石油	500,000	2,645,000.00	0.49
34	002340	格林美	240,000	2,244,000.00	0.42
35	688396	华润微	10,000	910,200.00	0.17
36	688008	澜起科技	10,000	623,800.00	0.12
37	688777	中控技术	6,000	564,900.00	0.10
38	688076	诺泰生物	4,984	339,958.64	0.06
39	688625	呈和科技	2,672	142,764.96	0.03
40	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.02
41	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.02
42	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.02
43	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.02
44	300957	贝泰妮	399	100,532.04	0.02
45	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
46	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.02
47	688329	艾隆科技	1,846	92,373.84	0.02
48	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.02
49	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
50	001203	大中矿业	3,809	76,751.35	0.01
51	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
52	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
53	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.01
54	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
55	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
56	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
57	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
58	300979	华利集团	560	49,000.00	0.01
59	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
60	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
61	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
62	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.01
63	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
64	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01

65	300981	中红医疗	296	26,755.44	0.00
66	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
67	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
68	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
69	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.00
70	300884	狄耐克	749	20,133.12	0.00
71	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
72	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
73	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
74	300908	仲景食品	285	16,983.15	0.00
75	300909	汇创达	386	16,636.60	0.00
76	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.00
77	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
78	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
79	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
80	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
81	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
82	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
83	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
84	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
85	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
86	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
87	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
88	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
89	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
90	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
91	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
92	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
93	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
94	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
95	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
96	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
97	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
98	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
99	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
100	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
101	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
102	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
103	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00

104	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
105	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
106	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
107	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
108	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
109	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
110	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
111	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
112	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
113	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
114	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
115	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
116	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
117	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
118	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
119	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
120	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
121	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
122	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
123	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
124	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
125	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
126	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
127	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
128	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
129	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
130	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	601636	旗滨集团	15,169,337.00	2.33
2	002555	三七互娱	12,562,802.03	1.93
3	600887	伊利股份	11,815,775.00	1.81
4	002304	洋河股份	11,604,322.00	1.78

5	002156	通富微电	11,589,886.00	1.78
6	600118	中国卫星	11,420,505.98	1.75
7	000725	京东方 A	11,418,374.00	1.75
8	601601	中国太保	11,362,077.00	1.74
9	002594	比亚迪	9,516,286.00	1.46
10	601939	建设银行	9,451,000.00	1.45
11	600426	华鲁恒升	9,237,223.60	1.42
12	603259	药明康德	9,003,837.80	1.38
13	601166	兴业银行	8,749,020.68	1.34
14	600919	江苏银行	8,489,316.98	1.30
15	002402	和而泰	8,481,075.00	1.30
16	000001	平安银行	8,409,835.80	1.29
17	600111	北方稀土	7,987,394.00	1.22
18	300059	东方财富	7,780,403.57	1.19
19	600409	三友化工	7,613,137.84	1.17
20	300015	爱尔眼科	7,610,319.64	1.17

#### 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	300059	东方财富	15,544,795.00	2.38
2	002142	宁波银行	14,496,040.00	2.22
3	000001	平安银行	12,591,730.96	1.93
4	601636	旗滨集团	12,294,373.00	1.89
5	002304	洋河股份	11,887,762.25	1.82
6	601318	中国平安	11,346,786.00	1.74
7	601601	中国太保	11,220,926.00	1.72
8	002156	通富微电	10,545,732.38	1.62
9	600118	中国卫星	10,199,085.60	1.56
10	600893	航发动力	9,949,041.00	1.53
11	600519	贵州茅台	9,410,921.00	1.44
12	002402	和而泰	9,180,494.00	1.41
13	601939	建设银行	9,069,000.00	1.39
14	000725	京东方 A	8,997,500.00	1.38
15	600276	恒瑞医药	8,881,076.20	1.36



16	000063	中兴通讯	8,720,402.00	1.34
17	600426	华鲁恒升	8,613,121.00	1.32
18	002594	比亚迪	8,489,994.00	1.30
19	002624	完美世界	8,115,530.00	1.24
20	601166	兴业银行	7,716,848.00	1.18

### 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	593,104,883.73
卖出股票收入（成交）总额	649,037,939.84

### 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	320,174,000.00	59.37
	其中：政策性金融债	320,174,000.00	59.37
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）	999,000.00	0.19
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	321,173,000.00	59.56

### 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	200207	20 国开 07	1,900,000	190,532,000.00	35.33
2	200208	20 国开 08	700,000	69,174,000.00	12.83
3	190203	19 国开 03	600,000	60,468,000.00	11.21
4	113050	南银转债	9,990	999,000.00	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

本报告期末本基金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**

本报告期末本基金未持有贵金属。

**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**

本报告期末本基金未持有权证。

**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
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					0.00
股指期货投资本期收益（元）					-1,511,087.62
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,019,227.62

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本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。

**7.12.2 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	136,587.56
2	应收证券清算款	303,783.56
3	应收股利	-
4	应收利息	6,021,625.22
5	应收申购款	29.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,462,026.31

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## § 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
533	700,061.85	372,564,405.82	99.85%	568,562.54	0.15%

### 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	9,904.82	0.0027%

注：本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 0~10 万份。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2015 年 6 月 15 日 ）基金份额总额	506,243,859.21
本报告期期初基金份额总额	456,722,076.56
本报告期基金总申购份额	34,963,431.89
减：本报告期基金总赎回份额	118,552,540.09
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	373,132,968.36

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 5 月，本基金托管人中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

### 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	
天风证券	2	1,232,808,887.31	100.00%	1,148,113.64	100.00%	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

能力以及其他综合服务能力。

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

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

2、报告期内租用交易单元变更情况：本报告期内本基金不存在交易单元退租情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
天风证券	606,159.46	100.00%	205,000,000.00	100.00%	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

### 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	中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定媒介	2021 年 1 月 22 日
2	风险揭示书	规定媒介	2021 年 1 月 28 日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 1 月 28 日
4	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加 国金证券股份有限公司为代销机构的公告	规定媒介	2021 年 3 月 3 日
5	中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	规定媒介	2021 年 3 月 11 日
6	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 3 月 24 日
7	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
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金开通定投业务及参加费率优惠的公告	规定媒介	2021 年 3 月 26 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旗下部分基金开通定投业务并参加费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 4 月 19 日
11	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
12	中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定媒介	2021 年 4 月 22 日
13	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
14	中邮创业基金管理股份有限公司关于中邮乐享收益基金赎回费率优惠活动的公告	规定媒介	2021 年 6 月 29 日
15	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



## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210630	142,739,837.40	0.00	0.00	142,739,837.40	38.25%
	2	20210423-20210429	73,909,090.91	0.00	0.00	73,909,090.91	19.81%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%引起的风险，主要是由于持有人结构相对集中，机构同质化，资金呈现“大进大出”特点，在市场突变情况下，赎回行为高度一致，给基金投资运作可能会带来较大压力，使得基金资产的变现能力和投资者赎回管理的匹配与平衡可能面临较大考验，继而可能给基金带来潜在的流动性风险。							

### 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乐享收益灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮乐享收益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

2021 年 8 月 31 日