

中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司（简称：中国农业银行）根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	错误！未定义书签。
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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
§5 托管人报告	14
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真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16

6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
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	48
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	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	52
§10 重大事件揭示	53
10.1 基金份额持有人大会决议	53
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	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	55
§11 影响投资者决策的其他重要信息	58

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	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§12 备查文件目录.....	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮核心优势灵活配置混合
基金主代码	590003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2009 年 10 月 28 日
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	552,867,697.27 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	秦一楠
	联系电话	010-82295160—157	010-66060069
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010—58511618	95599
传真		010-82295155	010-68121816
注册地址		北京市东城区和平里中街	北京市东城区建国门内大街 69

	乙 16 号	号
办公地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100013	100031
法定代表人	毕劲松	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人或基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-11,314,050.16
本期利润	44,914,773.99
加权平均基金份额本期利润	0.1149
本期加权平均净值利润率	3.71%
本期基金份额净值增长率	4.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	892,525,837.25
期末可供分配基金份额利润	1.6144
期末基金资产净值	1,842,069,875.90
期末基金份额净值	3.332
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	292.48%

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.06%	2.17%	5.78%	0.64%	-2.72%	1.53%
过去三个月	7.66%	2.45%	4.29%	0.86%	3.37%	1.59%
过去六个月	4.45%	2.28%	-4.59%	0.87%	9.04%	1.41%
过去一年	43.87%	2.34%	-6.66%	0.75%	50.53%	1.59%
过去三年	159.10%	1.87%	17.09%	0.76%	142.01%	1.11%
自基金合同 生效起至今	292.48%	1.61%	56.30%	0.86%	236.18%	0.75%

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

2. 关于业绩基准的说明

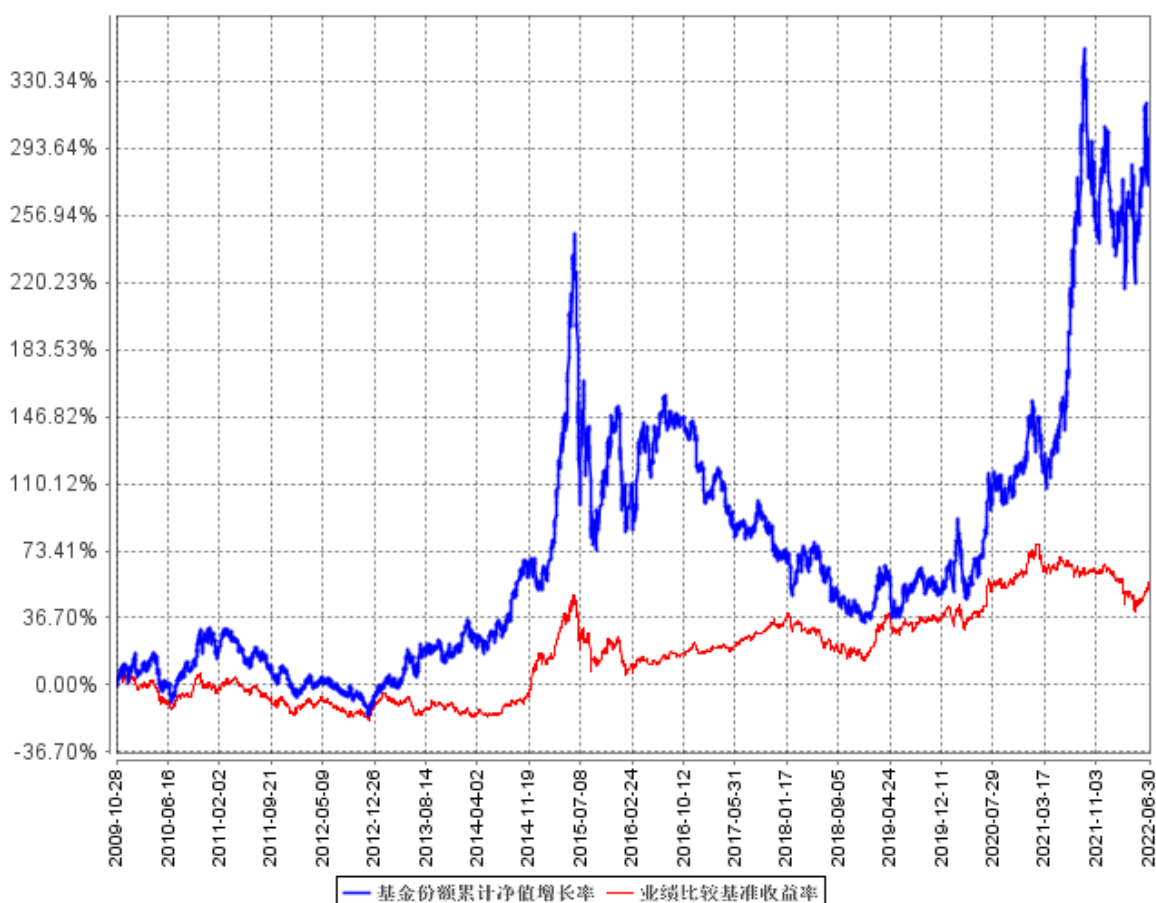
本基金业绩衡量基准=沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%

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

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

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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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

§ 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 2022 年 6 月 30 日，本公司共管理 57 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮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、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮未来成长混合型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金、中邮兴荣价值一年持有期混合型证券投资基金、

中邮能源革新混合型发起式证券投资基金、中邮睿泽一年持有期债券型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张腾	基金经理	2015 年 3 月 18 日	—	11 年	工学硕士，曾任申银万国证券研究所研究员、中邮创业基金管理股份有限公司行业研究员、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理兼行业研究员、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

2022 年上半年市场风格和热点经历了几次大的转换，我们有得有失，在基金一、半年报中做过详细回顾和分析，不再赘述。

主线上最值得反思的一点是，我们基于美联储货币政策由疫后宽松转向紧缩的大周期，以及中美利差收窄至长期合理水平以下掣肘国内货币政策空间的判断，配置上将主力仓位放在承压相对较小的低估值短久期板块，对于流动性依赖较高的如过去几年的核心资产和赛道股则要么仓位要么时间上相对回避。这一策略在上半年前半段比较有效，但正如后来我们看到的国内货币政策在一定程度上保持了较高的独立性，突发的疫情对经济的冲击也是货币政策超预期宽松的原因之一，后半段，随着国内疫情缓解带来的风险偏好提升，以及美联储加息过快带来的经济衰退硬着陆风险，市场有从滞涨向衰退交易演进的趋势，成长股有一轮大的反弹行情，我们对此判断和应对不充分。

上半年，本基金重新放开了基金申购，随着基金规模和持有人范围的扩大，我们增加了对机构投资者和广大基民的交流互动，有幸获知持有人关注的一些共性的问题，在此一并说明。

一是对于碳中和的理解及相应投资机会，我们自 2021 年一季报开始就持续围绕这一主题进行思考、实践和完善，不同于市场绝大多数将碳中和简单等同于新能源，我们会更多从能源系统角度比较不同能源技术的经济性、技术水平和未来提升空间，也会更多从政治、经济、社会、政策等系统思维的角度去理解约束条件，并进行动态情景预测分析。我们的碳中和投资框架是具有鲜明特色，广阔覆盖面的，结合此前几个季度的持仓布局，风电、储能、电网设备、煤炭我们基本上都是领先于行情启动数周甚至数月，也证明了基于系统视角布局碳中和的前瞻预判性和策略生命力，不足之处是这种偏自上而下的视角对于精准的时点判断有效性不足，资金效率不高或者净值短期波动较大。

二是持有人质疑煤炭及传统能源标签太过鲜明，而主流光伏新能源车配置较少，一方面是我

们基于自上而下分析加息周期中市场风格和估值因素做的主动选择，另一方面是主流赛道所需的信息跟踪强度要求较高，在我自身精力和资源有限的情况下做的更具相对优势的差异化选择，未来随着自上而下框架稳定后所需精力减少和公司内外部研究支持的增加，以及如果宏观环境从滞涨转向衰退交易的确认，这种情况可能会发生一定程度的转变。人类没有上帝视角，但时间会证明很多事，我们对于不熟悉事物的认知都需要一个过程，在一开始不可避免的会有时间或者空间上的局限性，古人夏虫语冰和盲人摸象的典故就给我们这两个方面很好的警醒。对于碳中和，我们不应该叶公好龙般的停留于口号，而应更务实地去了解去思考其本质和深远意义。在投资中，我也经常反复思考“真实性究竟是什么”这一主题，一个长期、宽广的全局系统性的视角，开放的心态，务实而又动态调整的方法，可能越能接近这一问题的答案。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.332 元，累计净值为 3.512 元；本报告期基金份额净值增长率为 4.45%，业绩比较基准收益率为-4.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

海外主要经济体疫后货币宽松的后遗症逐步显现，供给侧方面俄乌冲突、海运价格暴涨、供应链脱钩、工资通胀螺旋等因素又进一步加剧了供给冲击，美联储本轮加息时点较以往各轮周期平均约滞后了十几个月，因此本轮加息注定了较以往力度更大节奏更急。当前欧债信用利差扩大，边缘新兴国家风险加大，宏观不确定性加强。未来一方面需要做好充分防御应对衰退风险，另一方面关注市场在避险和经济不好流动性过剩中的风格切换。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、基金托管协议的约定，对本基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	36,359,201.41	67,286,961.29
结算备付金		683,140.52	1,772,346.04
存出保证金		481,476.76	340,967.43
交易性金融资产	6.4.7.2	1,885,877,649.48	1,014,215,910.99
其中：股票投资		1,459,012,390.44	828,974,011.49
基金投资		-	-
债券投资		426,865,259.04	185,241,899.50
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		27,826,013.29	9,031,478.62
应收股利		-	-
应收申购款		49,163,346.85	2,245,986.83
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	528,925.42
资产总计		2,000,390,828.31	1,095,422,576.62
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		95,544,463.43	-
应付清算款		39,624,416.59	3,353,996.00

应付赎回款		8,594,834.57	1,274,802.08
应付管理人报酬		1,935,956.87	1,401,977.56
应付托管费		322,659.47	233,662.91
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,919,811.15	9,918,760.66
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,378,810.33	1,966,585.52
负债合计		158,320,952.41	18,149,784.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	552,867,697.27	337,692,404.09
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,289,202,178.63	739,580,387.80
净资产合计		1,842,069,875.90	1,077,272,791.89
负债和净资产总计		2,000,390,828.31	1,095,422,576.62

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.332 元，基金份额总额 552,867,697.27 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		55,796,294.76	60,484,896.83
1.利息收入		729,120.57	942,989.56
其中：存款利息收入	6.4.7.13	729,120.57	222,327.87
债券利息收入		-	720,661.69
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,186,332.64	58,548,821.49
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,578,634.31	52,009,135.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-17,689,265.56	5,226,303.62
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	20,081,567.23	1,313,382.71
以摊余成本计量的金融资		-	-

产终止确认产生的收益			
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	56,228,824.15	977,773.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,024,682.68	15,312.31
减：二、营业总支出		10,881,520.77	4,858,743.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	8,927,710.77	2,476,589.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,487,951.78	412,764.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		319,088.58	-
其中：卖出回购金融资产支出		319,088.58	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,313.20	99.74
8. 其他费用	6.4.7.23	145,456.44	1,969,289.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		44,914,773.99	55,626,153.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		44,914,773.99	55,626,153.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		44,914,773.99	55,626,153.56

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	337,692,404.09	-	739,580,387.80	1,077,272,791.89
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	337,692,404.09	-	739,580,387.80	1,077,272,791.89

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	215,175,293.18	-	549,621,790.83	764,797,084.01
(一)、综合收益总额	-	-	44,914,773.99	44,914,773.99
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	215,175,293.18	-	504,707,016.84	719,882,310.02
其中: 1.基金申购款	397,339,299.05	-	879,785,285.39	1,277,124,584.44
2.基金赎回款	-182,164,005.87	-	-375,078,268.55	-557,242,274.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	552,867,697.27	-	1,289,202,178.63	1,842,069,875.90
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	185,936,987.44	-	180,673,382.97	366,610,370.41
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	185,936,987.44	-	180,673,382.97	366,610,370.41
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-32,206,822.62	-	21,641,637.64	-10,565,184.98
(一)、综合收益总额	-	-	55,626,153.56	55,626,153.56
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-32,206,822.62	-	-33,984,515.92	-66,191,338.54
其中: 1.基金申购款	5,665,684.56	-	5,856,797.97	11,522,482.53
2.基金赎回款	-37,872,507.18	-	-39,841,313.89	-77,713,821.07
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-

（四）、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	153,730,164.82	-	202,315,020.61	356,045,185.43

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：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监基金字[2009]811 号《关于核准中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2009 年 10 月 28 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集 3,942,346,068.45 元，业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字(2009)第 079 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：股票资产占基金资产的比例为 30%-80%，债券资产占基金资产的 15%-65%，权证的投资比例为基金资产净值的 0%-3%，并保持不低于基金资产 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金基于上述编制基础的财务报表符合企业会计准则的要求，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和基金净值变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

①新金融工具准则

财政部于 2017 年颁布了《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”），本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，对会计政策相关内容进行了调整。

新金融工具准则要求根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，将金融资产划分为以下三类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。混合合同包含的主合同属于金融资产的，不应从该混合合同中分拆嵌入衍生工具，而应当将该混合合同作为一个整体适用金融资产分类的相关规定。

采用新金融工具准则对本基金金融负债的会计政策并无重大影响。

本基金按照新金融工具准则的规定，对金融工具的分类和计量进行追溯调整，金融工具原账面价值和新金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）的新账面价值之间的差额仅涉及重分类，不影响 2022 年年初未分配利润。同时，本基金未对比较财务报表数据进行调整。

②财务报表格式的調整

财政部于 2018 年 12 月 27 日发布了《关于修订印发 2018 年度金融企业财务报表格式的通知》（财会〔2018〕36 号），对已执行新金融工具准则的金融企业的财务报表格式进行了规范。根据该通知及中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金对财务报表格式进行了以下修订：

资产负债表，增加根据新金融工具准则新增的报表项目：债权投资、其他债权投资、其他权益工具投资；基于实际利率法计提的金融工具的利息应包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关资产负债表项目中，而不应单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目；“应付交易

费用”并入“其他负债”。

财务报表格式的修订对本基金的资产总额、负债总额、净利润、所有者权益等无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，执行新金融工具准则时金融工具分类和账面价值调节如下：

应收利息调整前账面金额为 528,925.42 元，全部调整至相关金融资产的账面价值中，其中 32,259.34 元重分类至银行存款，797.60 元重分类至结算备付金，153.40 元重分类至存出保证金，495,712.82 元重分类至交易性金融资产-债券投资，2.26 元重分类至应收申购款，应收利息调整后账面金额为 0 元。

银行存款调整前账面金额为 67,286,961.29 元，调整后账面金额为 67,319,220.63 元；结算备付金调整前账面金额为 1,772,346.04 元，调整后账面金额为 1,773,143.64 元；存出保证金调整前账面金额为 340,967.43 元，调整后账面金额为 341,120.83 元；交易性金融资产调整前账面金额为 1,014,215,910.99 元，调整后账面金额为 1,014,711,623.81 元；应收申购款调整前账面金额为 2,245,986.83 元，调整后账面金额为 2,245,989.09 元。

应付利息调整前账面金额为-9,385.65 元，全部重分类至卖出回购金融资产款，调整后账面金额为 0 元。卖出回购金融资产款调整前账面金额为 0 元，调整后账面金额为-9,385.65 元。

应付交易费用调整前账面金额为 1,375,968.72 元，全部重分类至其他负债，调整后账面金额为 0 元。其他负债调整前账面金额为 600,002.45 元，调整后账面金额为 1,975,971.17 元。

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

无。

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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	36,359,201.41

等于：本金	36,314,292.11
加：应计利息	44,909.30
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	36,359,201.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,359,803,432.55	-	1,459,012,390.44	99,208,957.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	410,390,730.64	2,152,462.76	426,865,259.04	14,322,065.64
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	410,390,730.64	2,152,462.76	426,865,259.04	14,322,065.64
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,770,194,163.19	2,152,462.76	1,885,877,649.48	113,531,023.53

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：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

注：本基金本期末未持有返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本期末未有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本期末未有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本期末未有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	30,265.58
应付证券出借违约金	—
应付交易费用	1,752,912.54
其中：交易所市场	1,752,912.54
银行间市场	—
—	—
应付利息	—
预提费用	499,014.74
其他	96,617.47
合计	2,378,810.33

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	337,692,404.09	337,692,404.09
本期申购	397,339,299.05	397,339,299.05

本期赎回(以“-”号填列)	-182,164,005.87	-182,164,005.87
- 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	552,867,697.27	552,867,697.27

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	571,029,366.74	168,551,021.06	739,580,387.80
本期利润	-11,314,050.16	56,228,824.15	44,914,773.99
本期基金份额交易产生的变动数	332,810,520.67	171,896,496.17	504,707,016.84
其中：基金申购款	616,076,787.50	263,708,497.89	879,785,285.39
基金赎回款	-283,266,266.83	-91,812,001.72	-375,078,268.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	892,525,837.25	396,676,341.38	1,289,202,178.63

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	673,955.08
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	29,802.03
其他	25,363.46
合计	729,120.57

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,824,030,249.41
减：卖出股票成本总额	1,822,937,787.60
减：交易费用	5,671,096.12

买卖股票差价收入	-4,578,634.31
----------	---------------

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	832,400.87
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-18,521,666.43
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	-17,689,265.56

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	300,212,075.24
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	317,606,135.43
减：应计利息总额	1,109,517.38
减：交易费用	18,088.86
买卖债券差价收入	-18,521,666.43

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

注：本报告期间，本基金无资产支持证券投资。

6.4.7.17 贵金属投资收益

注：本报告期间，本基金无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

注：本报告期本基金无衍生工具投资。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	20,081,567.23

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	20,081,567.23

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	56,228,824.15
——股票投资	52,757,322.52
——债券投资	3,471,501.63
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	56,228,824.15

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,024,682.68
合计	1,024,682.68

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行结算费用	7,841.70
上清所债券账户维护费	9,000.00

中债债券帐户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	145,456.44

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

截止 2022 年 08 月 22 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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

注：本报告期及上年度可比期间，本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

6.4.10.1.1 应支付关联方的佣金

注：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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,927,710.77	2,476,589.25
其中：支付销售机构的客户维护费	2,585,436.80	863,559.96

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

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,487,951.78	412,764.84

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

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
基金合同生效日（2009年10月28日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	2,991,921.01	—
报告期间申购/买入总份额	4,512,334.54	—
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	—	—
报告期末持有的基金份额	7,504,255.55	—
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.36%	—

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
首创证券股份有限公司	15,422,270.20	2.79%	—	—

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	36,359,201.41	673,955.08	24,237,866.46	213,349.73

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本报告期本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2022 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	受限期	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
600941	中国移动	2021 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	57.58	60.26	87,363	5,030,361.54	5,264,494.38	-
600938	中国海油	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-
688295	中复神鹰	2022 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	29.33	34.42	13,998	410,561.34	481,811.16	-
301236	软通动力	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.88	31.38	1,256	61,000.56	39,413.28	-
301200	大族数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股流通受限	76.56	51.92	651	49,840.56	33,799.92	-
301150	中一科技	2022 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	-
301216	万凯新材	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301207	华兰疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股流通受限	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98	-
301206	三元生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股流通受限	109.30	45.69	692	50,387.30	31,617.48	-
301215	中汽股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301109	军信股份	2022 年 4 月 6 日	6 个月	新股流通受限	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	-
301219	腾远	2022 年	6 个月	新股	173.98	87.82	302	29,228.64	26,521.64	-

	钴业	3月10日	月	流通受限						
301263	泰恩康	2022年3月22日	6个月	新股流通受限	19.93	31.38	682	13,592.26	21,401.16	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股流通受限	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301187	欧圣电气	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	21.33	22.54	876	18,685.08	19,745.04	-
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股流通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股流通受限	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股流通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股流通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301248	杰创智能	2022年4月13日	6个月	新股流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301148	嘉戎技术	2022年4月14日	6个月	新股流通受限	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股流通	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-

		日	月	受限						
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 月	个 新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301137	哈焊华通	2022 年 3 月 14 日	6 月	个 新股流通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301196	唯科科技	2022 年 1 月 4 日	6 月	个 新股流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301222	浙江恒威	2022 年 3 月 2 日	6 月	个 新股流通受限	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72	-
301288	清研环境	2022 年 4 月 14 日	6 月	个 新股流通受限	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301163	宏德股份	2022 年 4 月 11 日	6 月	个 新股流通受限	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-
301130	西点药业	2022 年 2 月 16 日	6 月	个 新股流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301181	标榜股份	2022 年 2 月 11 日	6 月	个 新股流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301228	实朴检测	2022 年 1 月 21 日	6 月	个 新股流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022 年 4 月 6 日	6 月	个 新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-

注：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，新增股票的受限期、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 95,544,463.43 元,于 2022 年 07 月 11 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的金额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注:本基金本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	—	—
A-1 以下	—	—

未评级	92,025,208.61	110,473.00
合计	92,025,208.61	110,473.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	9,132,344.77	—
AAA 以下	325,675,254.94	163,923,108.50
未评级	32,450.72	21,208,318.00
合计	334,840,050.43	185,131,426.50

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 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 2022 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	36,359,201.41	-	-	-	36,359,201.41
结算备付金	683,140.52	-	-	-	683,140.52
存出保证金	481,476.76	-	-	-	481,476.76
交易性金融资产	90,624,792.60	196,257,888.94	137,830,114.74	1,461,164,853.20	1,885,877,649.48
应收清算	-	-	-	27,826,013.29	27,826,013.29

款					
应收 申购 款	-	-	-	49,163,346.85	49,163,346.85
资产 总计	128,148,611.29	196,257,888.94	137,830,114.74	1,538,154,213.34	2,000,390,828.31
负债					
卖出 回购 金融 资产 款	95,544,463.43	-	-	-	95,544,463.43
应付 清算 款	-	-	-	39,624,416.59	39,624,416.59
应付 赎回 款	-	-	-	8,594,834.57	8,594,834.57
应付 管理 人报 酬	-	-	-	1,935,956.87	1,935,956.87
应付 托管 费	-	-	-	322,659.47	322,659.47
应交 税费	-	-	-	9,919,811.15	9,919,811.15
其他 负债	-	-	-	2,378,810.33	2,378,810.33
负债 总计	95,544,463.43	-	-	62,776,488.98	158,320,952.41
利率 敏感 度缺 口	32,604,147.86	196,257,888.94	137,830,114.74	1,475,377,724.36	1,842,069,875.90
上年 度末 2021 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	67,286,961.29	-	-	-	67,286,961.29
结算备付金	1,772,346.04	-	-	-	1,772,346.04
存出保证金	340,967.43	-	-	-	340,967.43
交易性金融资产	110,473.00	168,851,547.10	16,279,879.40	828,974,011.49	1,014,215,910.99
应收证券清算款	-	-	-	9,031,478.62	9,031,478.62
应收申购款	-	-	-	2,245,986.83	2,245,986.83
其他资产	-	-	-	528,925.42	528,925.42
资产总计	69,510,747.76	168,851,547.10	16,279,879.40	840,780,402.36	1,095,422,576.62
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	3,353,996.00	3,353,996.00
应付赎回款	-	-	-	1,274,802.08	1,274,802.08
应付管理人报酬	-	-	-	1,401,977.56	1,401,977.56
应付托管费	-	-	-	233,662.91	233,662.91
应交税费	-	-	-	9,918,760.66	9,918,760.66
其他负债	-	-	-	1,966,585.52	1,966,585.52
负债总计	-	-	-	18,149,784.73	18,149,784.73

利率 敏感 度缺 口	69,510,747.76	168,851,547.10	16,279,879.40	822,630,617.63	1,077,272,791.89
---------------------	---------------	----------------	---------------	----------------	------------------

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变		
	2. 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	-3,611,689.25	-1,967,558.49
	2. 基金净资产变动	3,717,538.52	2,051,867.80

6.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会允许基金投资的其他金融工具。如法律法规和监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金为混合型基金，基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 30%~80%，债券资产占基金资产的 15%~65%，权证占基金资产净值的 0%~3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金投资于核心优势企业的股票比例不低于基金股票资产的 80%。

于 2022 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,459,012,390.44	79.21	828,974,011.49	76.95
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	426,865,259.04	23.17	185,241,899.50	17.20
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,885,877,649.48	102.38	1,014,215,910.99	94.15

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	2. 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	28,190,329.12	12,638,153.54
	2. 基金净资产变动	-28,190,329.12	-12,638,153.54

注：利用 CAPM 模型计算得到上述结果，其中，利用 2022 年 1 月 1 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 1.49。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	1,786,136,523.21	983,190,849.69
第二层次	92,057,659.33	28,885,177.09
第三层次	7,683,466.94	2,139,884.21
合计	1,885,877,649.48	1,014,215,910.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的金融工具的公允价值未发生所属层次间的重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括：银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他各类应收应付款项等。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,459,012,390.44	72.94
	其中：股票	1,459,012,390.44	72.94
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	426,865,259.04	21.34
	其中：债券	426,865,259.04	21.34
	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	—	—
	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	37,042,341.93	1.85
8	其他各项资产	77,470,836.90	3.87
9	合计	2,000,390,828.31	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	49,312.00	0.00
B	采矿业	856,063,402.28	46.47
C	制造业	421,508,337.48	22.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,639,608.00	0.25
E	建筑业	15,997,000.00	0.87
F	批发和零售业	144,797,942.72	7.86
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	5,457,177.45	0.30
J	金融业	8,567.00	0.00
K	房地产业	10,335,000.00	0.56
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	77,851.87	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	41,997.72	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	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,459,012,390.44	79.21

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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本报告期末本基金未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600546	山煤国际	4,801,600	93,439,136.00	5.07
2	601225	陕西煤业	4,338,700	91,893,666.00	4.99
3	601966	玲珑轮胎	3,600,150	91,335,805.50	4.96
4	601699	潞安环能	6,223,603	90,989,075.86	4.94
5	601001	晋控煤业	4,641,908	82,393,867.00	4.47
6	601069	西部黄金	5,749,608	78,079,676.64	4.24
7	600256	广汇能源	7,304,851	76,993,129.54	4.18
8	000807	云铝股份	7,312,700	72,249,476.00	3.92
9	000968	蓝焰控股	6,797,000	71,028,650.00	3.86
10	000933	神火股份	5,385,148	70,437,735.84	3.82
11	601101	昊华能源	6,471,929	66,660,868.70	3.62
12	600188	兖矿能源	1,653,233	65,269,638.84	3.54
13	600988	赤峰黄金	4,049,915	64,596,144.25	3.51
14	600938	中国海油	3,693,913	64,325,215.49	3.49
15	600180	瑞茂通	6,649,923	51,337,405.56	2.79
16	000983	山西焦煤	3,780,950	50,626,920.50	2.75
17	601058	赛轮轮胎	4,400,200	49,590,254.00	2.69
18	600096	云天化	1,117,577	35,181,323.96	1.91
19	000975	银泰黄金	3,307,679	32,216,793.46	1.75
20	000723	美锦能源	2,200,000	26,840,000.00	1.46
21	300423	昇辉科技	2,000,000	21,640,000.00	1.17
22	002128	电投能源	1,465,300	20,983,096.00	1.14
23	002408	齐翔腾达	2,199,854	17,840,815.94	0.97
24	601117	中国化学	1,700,000	15,997,000.00	0.87

25	600657	信达地产	1,500,000	10,335,000.00	0.56
26	002984	森麒麟	300,200	9,339,222.00	0.51
27	600941	中国移动	87,363	5,264,494.38	0.29
28	300228	富瑞特装	800,000	5,232,000.00	0.28
29	300471	厚普股份	300,000	4,914,000.00	0.27
30	600995	文山电力	302,000	4,623,620.00	0.25
31	000422	湖北宜化	200,200	4,066,062.00	0.22
32	688339	亿华通	40,280	3,962,746.40	0.22
33	600426	华鲁恒升	100,000	2,920,000.00	0.16
34	600389	江山股份	30,000	1,821,900.00	0.10
35	000830	鲁西化工	100,000	1,729,000.00	0.09
36	002648	卫星化学	27,984	723,386.40	0.04
37	688357	建龙微纳	5,000	562,200.00	0.03
38	688295	中复神鹰	13,998	481,811.16	0.03
39	600406	国电南瑞	2,400	64,800.00	0.00
40	688063	派能科技	200	62,440.00	0.00
41	688590	新致软件	4,171	59,770.43	0.00
42	600089	特变电工	2,000	54,780.00	0.00
43	301236	软通动力	1,256	39,413.28	0.00
44	000400	许继电气	2,000	38,400.00	0.00
45	301200	大族数控	651	33,799.92	0.00
46	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
47	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
48	000998	隆平高科	2,000	33,320.00	0.00
49	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
50	301206	三元生物	692	31,617.48	0.00
51	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
52	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
53	600486	扬农化工	200	26,656.00	0.00
54	301219	腾远钴业	302	26,521.64	0.00
55	301058	中粮工科	1,386	24,102.54	0.00
56	301263	泰恩康	682	21,401.16	0.00
57	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
58	301187	欧圣电气	876	19,745.04	0.00
59	600309	万华化学	200	19,398.00	0.00
60	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
61	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
62	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
63	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00

64	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
65	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
66	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
67	600025	华能水电	2,000	13,980.00	0.00
68	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
69	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
70	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
71	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
72	002714	牧原股份	200	11,054.00	0.00
73	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
74	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
75	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
76	300274	阳光电源	100	9,825.00	0.00
77	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
78	601012	隆基绿能	140	9,328.20	0.00
79	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00
80	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
81	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
82	688036	传音控股	100	8,923.00	0.00
83	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
84	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
85	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00
86	601088	中国神华	200	6,660.00	0.00
87	603868	飞科电器	79	5,984.25	0.00
88	300087	荃银高科	300	4,938.00	0.00
89	002142	宁波银行	100	3,581.00	0.00
90	002497	雅化集团	100	3,265.00	0.00
91	600580	卧龙电驱	200	2,884.00	0.00
92	601689	拓普集团	40	2,737.20	0.00
93	600160	巨化股份	200	2,630.00	0.00
94	603218	日月股份	100	2,540.00	0.00
95	600499	科达制造	100	2,064.00	0.00
96	000708	中信特钢	100	2,015.00	0.00
97	600116	三峡水利	200	2,008.00	0.00
98	601166	兴业银行	100	1,990.00	0.00
99	002733	雄韬股份	100	1,741.00	0.00
100	000001	平安银行	100	1,498.00	0.00
100	600926	杭州银行	100	1,498.00	0.00
101	000338	潍柴动力	100	1,247.00	0.00

102	002063	远光软件	48	337.44	0.00
-----	--------	------	----	--------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601966	玲珑轮胎	105,700,893.97	9.81
2	000933	神火股份	102,754,508.46	9.54
3	600256	广汇能源	92,661,972.59	8.60
4	600988	赤峰黄金	89,132,455.15	8.27
5	601101	昊华能源	88,683,571.00	8.23
6	000807	云铝股份	86,789,731.84	8.06
7	601225	陕西煤业	86,437,833.00	8.02
8	002128	电投能源	80,918,206.97	7.51
9	600938	中国海油	80,527,537.98	7.48
10	601069	西部黄金	79,337,007.48	7.36
11	600180	瑞茂通	77,544,001.54	7.20
12	000983	山西焦煤	71,161,456.69	6.61
13	600123	兰花科创	70,173,675.15	6.51
14	601088	中国神华	69,477,931.01	6.45
15	601699	潞安环能	69,107,505.02	6.42
16	601058	赛轮轮胎	65,093,594.15	6.04
17	600096	云天化	63,257,541.33	5.87
18	600426	华鲁恒升	59,319,201.90	5.51
19	600546	山煤国际	57,867,926.46	5.37
20	600011	华能国际	55,627,481.60	5.16
21	000830	鲁西化工	54,827,454.00	5.09
22	600863	内蒙华电	52,901,544.85	4.91
23	600309	万华化学	47,856,669.00	4.44
24	601600	中国铝业	47,195,955.00	4.38
25	601001	晋控煤业	41,742,815.20	3.87
26	000723	美锦能源	38,302,477.08	3.56
27	000422	湖北宜化	35,497,695.70	3.30
28	000975	银泰黄金	32,050,448.53	2.98
29	601678	滨化股份	30,903,922.34	2.87

30	600989	宝丰能源	26,296,028.89	2.44
31	300228	富瑞特装	22,053,517.20	2.05

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	600123	兰花科创	93,868,666.73	8.71
2	000723	美锦能源	90,226,414.09	8.38
3	601101	昊华能源	75,347,329.16	6.99
4	601088	中国神华	72,418,921.40	6.72
5	605090	九丰能源	66,815,612.36	6.20
6	600011	华能国际	63,196,534.00	5.87
7	600989	宝丰能源	54,535,262.87	5.06
8	600021	上海电力	53,433,629.70	4.96
9	000830	鲁西化工	53,421,364.45	4.96
10	600863	内蒙华电	51,976,493.32	4.82
11	600426	华鲁恒升	51,834,486.20	4.81
12	000875	吉电股份	51,611,265.65	4.79
13	002128	电投能源	50,839,537.00	4.72
14	600995	文山电力	47,569,436.00	4.42
15	002733	雄韬股份	44,282,377.17	4.11
16	600309	万华化学	44,000,634.00	4.08
17	300471	厚普股份	42,514,218.54	3.95
18	601600	中国铝业	40,740,420.00	3.78
19	600348	华阳股份	40,241,904.09	3.74
20	688339	亿华通	39,344,601.30	3.65
21	600256	广汇能源	37,619,770.80	3.49
22	000933	神火股份	37,210,786.18	3.45
23	601699	潞安环能	35,839,739.31	3.33
24	300228	富瑞特装	30,065,581.01	2.79
25	600546	山煤国际	29,686,375.00	2.76
26	000983	山西焦煤	29,347,035.50	2.72
27	600188	兖矿能源	27,392,934.00	2.54
28	601678	滨化股份	27,305,130.34	2.53
29	600096	云天化	26,322,470.00	2.44
30	000422	湖北宣化	23,430,491.20	2.17

31	600025	华能水电	22,068,737.96	2.05
32	601001	晋控煤业	21,666,831.00	2.01

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	2,400,218,844.03
卖出股票收入（成交）总额	1,824,030,249.41

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	92,035,167.18	5.00
2	央行票据	—	—
3	金融债券	22,492.15	0.00
	其中：政策性金融债	22,492.15	0.00
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	334,807,599.71	18.18
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	426,865,259.04	23.17

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	127050	麒麟转债	642,106	81,221,623.99	4.41
2	127027	靖远转债	494,340	73,061,948.66	3.97
3	128017	金禾转债	256,735	58,863,075.39	3.20
4	019658	21 国债 10	569,630	58,048,106.14	3.15
5	128046	利尔转债	211,309	39,410,170.57	2.14

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

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与股指期货的投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

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 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 投资组合报告附注

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

本报告期内本基金投资的山煤国际（600546），其发行主体山煤国际能源集团股份有限公司收到中国证券监督管理委员会山西监管局行政监管措施决定书【2021】8 号、上海证券交易所纪律处分决定书【2022】16 号。

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	481,476.76
2	应收清算款	27,826,013.29
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	49,163,346.85
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	77,470,836.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值
----	------	------	------	---------

				比例（%）
1	127050	麒麟转债	81,221,623.99	4.41
2	127027	靖远转债	73,061,948.66	3.97
3	128017	金禾转债	58,863,075.39	3.20
4	128046	利尔转债	39,410,170.57	2.14
5	127043	川恒转债	33,048,334.12	1.79
6	128128	齐翔转 2	20,508,017.53	1.11
7	110061	川投转债	4,979,621.00	0.27
8	132018	G 三峡 EB1	13,996.10	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末本基金未前十名股票中不存在流通受限股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
80,355	6,880.31	183,512,212.41	33.19%	369,355,484.86	66.81%

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	438,129.48	0.0792%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2009 年 10 月 28 日 ）基金份额总额	3,942,346,068.45
本报告期期初基金份额总额	337,692,404.09
本报告期基金总申购份额	397,339,299.05
减：本报告期基金总赎回份额	182,164,005.87
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	552,867,697.27

§ 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

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。
2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
华西证券	2	2,176,968,296.02	52.10%	1,592,032.66	46.07%	-
中信证券	1	1,195,744,560.91	28.62%	1,113,599.29	32.22%	-
长城证券	1	805,747,618.59	19.28%	750,395.48	21.71%	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	退租
安信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

(2) 券商经纪人具有较强的综合服务能力：能及时、全面、定期提供高质量的关于宏观、行业、资本市场、个股分析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
华西证券	603,025,036.45	73.27%	352,934,000.00	72.51%	-	-
中信证券	208,106,183.06	25.29%	108,600,000.00	22.31%	-	-
长城证券	11,863,535.00	1.44%	25,200,000.00	5.18%	-	-

湘财证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源西部证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

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调整旗下部分基金在首创证券 股份有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 6 月 22 日
2	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在和讯信息科技有 限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 6 月 20 日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在万家财富基金销 售有限公司开通定投业务并调整其申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 5 月 31 日
4	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源西部证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 5 月 27 日
5	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 5 月 26 日

6	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在北京微动利基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 5 月 25 日
7	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在广发证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 4 月 26 日
8	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定媒介	2022 年 4 月 22 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 4 月 15 日
10	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年年度报告	规定媒介	2022 年 3 月 11 日
11	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银国际证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 3 月 9 日
12	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 3 月 8 日
13	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加北京中植基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2022 年 3 月 4 日
14	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海长量基金销售有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 2 月 22 日
15	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 恢复大额申购业务公告	规定媒介	2022 年 2 月 16 日
16	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 参加国融证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 1 月 25 日
17	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定媒介	2022 年 1 月 24 日
18	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 暂停大额申购业务公告	规定媒介	2022 年 1 月 14 日

19	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金 参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 1 月 11 日
20	中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金 恢复大额申购业务公告	规定媒介	2022 年 1 月 11 日

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

投资者可在营业时间免费查阅。也可在支付工本费后，在合理时间内取得上述文件的复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：www.postfund.com.cn

中邮创业基金管理股份有限公司

2022 年 8 月 31 日