

# 中邮核心主题混合型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司（简称：招商银行）根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 2024 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	7
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>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
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	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
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	37

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 .....	38
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 .....	38
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 .....	38
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	38
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	38
7.12 投资组合报告附注 .....	38
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	39
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	39
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情况 .....	39
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>39</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	40
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	40
10.4 基金投资策略的改变 .....	40
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	40
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 .....	40
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	40
10.8 其他重大事件 .....	42
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>43</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 .....	43
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	43
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>43</b>
12.1 备查文件目录 .....	43
12.2 存放地点 .....	43
12.3 查阅方式 .....	43

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮核心主题混合型证券投资基金
基金简称	中邮核心主题混合
基金主代码	590005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年5月19日
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	201,432,294.66份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金重点关注中国经济结构调整过程中带来的投资机会，采用主题策略和核心策略相结合的方法筛选核心主题企业，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>1. 大类资产配置策略</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>2. 股票投资策略</p> <p>本基金采用主题投资策略与核心投资策略相结合的方法进行股票投资：主题投资策略是自上而下挖掘出可能导致经济结构发生根本性变化的因素，分析这些根本变化的内涵，再形成与之相匹配的投资主题，然后再选择能够受益于该投资主题的上市公司，构建股票组合进行投资。本基金采用主题投资策略作为股票投资的主要策略，在具体的择股过程中还将核心投资策略作为辅助策略，同等条件下优先选择具有核心竞争力的企业进行投资。</p> <p>(1) 主题挖掘</p> <p>本基金在进行主题挖掘的时候采用纵向和横向相结合的方式，同时关注主题的生命周期。</p> <p>本基金将通过自上而下的方式，从宏观经济、国家政策、社会文化、人口结构、科技进步等多个纵向角度出发，在深入研究的基础上，分析影响经济发展和企业盈利的关键性因素，从而前瞻性地挖掘出中国经济结构调整过程中不断涌现出的有深刻影响力的投资主题。横向的主题挖掘主要是指将“中国经济结构调整”从生产领域、流通领域、消费领域、区域经济和资本市场五个方向分解，把握经济结构调整的脉搏，细分出具有实际投资意义的细分主题。</p> <p>在主题挖掘同时，本基金还将判断“主题的生命周期”并对其进行阶段划分。“主题的生命周期”是指投资主题对经济和资本市场的影响持续期。对“主题的生命周期”进行阶段划分的根据是投资</p>

主题对经济和资本市场影响力的强弱。主题的生命周期一般分为四个阶段：主题萌芽、主题形成、主题实现和主题衰退。

### (2) 主题配置

在主题挖掘的基础上，基金管理人定期召开投资决策委员会会议，由宏观经济研究员、策略研究员、行业研究员和基金经理对主题进行评估，综合考虑主题发展阶段、主题催化因素、主题市场容量、主题估值水平等因素，确定每个主题的配置权重范围，从而进行主题配置。

### (3) 个股选择

本基金通过主题投资策略和核心投资策略相结合的方法构建股票备选库和精选库，重点投资核心主题企业。核心主题企业是指与本基金确立的投资主题相符且具有核心竞争力的企业。核心投资策略是指对企业核心竞争力的综合评价方法，主要从公司盈利模式、政策环境、财务状况、治理结构以及市场估值等方面进行评估。通过定性和定量分析相结合的方法筛选出具有如下特质的上市公司进行投资：主营业务突出，发展战略明晰，具有良好的创新能力，信息披露透明；主要股东资信良好，持股结构相对稳定，注重中小股东利益，无非经营性占款；管理规范，企业家素质突出，具有合理的管理层激励与约束机制，建立科学的管理与组织架构；具有持续经营能力和偿债能力，资产负债率合理；业务稳定运行，收入及利润保持合理增长，资产盈利能力较高，净资产收益率处在领先水平；财务管理能力较强，现金收支安排有序；股东回报良好，分红比例稳定。

#### 备选库的构建

在确立投资主题及投资主题配置比例之后，本基金将选择与投资主题相关联的股票进入备选库，并依据个股的“主题相关度”排序。本基金主要根据企业能够受惠于投资主题的程度来确定“主题相关度”。具体来说，就是由研究员衡量主题因素对企业的主营业务收入、主营业务利润等财务指标的影响程度并打分，作为企业和投资主题的相关度标准。打分的依据主要有以下几个方面：

公司所处行业受宏观经济环境和国家产业政策的影响程度。

公司主营业务收入和利润受此主题驱动的变动幅度。

公司的盈利模式。

公司竞争力分析，包括管理者素质、市场营销能力、技术创新能力、专有技术、特许权、品牌、重要客户等。

公司财务状况及财务管理能力，包括财务安全性指标，反映行业特性的主要财务指标、公司股权与债权融资能力与成本分析、公司再投资收益率分析等。

#### 精选库的构建

在备选库的基础上，精选主题相关度得分高、流动性好、市场估值合理且具有核心竞争力的优质上市公司构成本基金的精选库。

主题相关度由研究员根据公司业绩受主题驱动弹性的大小进行打分确定；

流动性指标主要参考流动市值、总市值和日均成交金额等指标；

	<p>估值指标选用市盈率、市净率和市销率；</p> <p>企业核心竞争力的评价采用核心投资策略，兼顾价值和成长因素，采用定性和定量相结合的方法配合研究员实地调研结果筛选公司发展战略明晰、具备比较优势、治理结构良好的企业。具体而言，应从以下方面精选个股：</p> <p>公司主营业务突出，发展战略明晰，具有良好的创新能力和优良的核心竞争力，信息披露透明。</p> <p>主要股东资信良好，持股结构相对稳定，注重中小股东利益，无非经营性占款；管理规范，企业家素质突出，具有合理的管理层激励与约束机制，建立科学的管理与组织架构。</p> <p>具有持续经营能力和偿债能力，资产负债率合理。主营业务稳定运行，收入及利润保持合理增长，资产盈利能力较高。净资产收益率处在领先水平。</p> <p>财务管理能力较强，现金收支安排有序。</p> <p>股东回报良好，分红比例较为稳定。</p> <p>3. 债券投资策略</p> <p>(1) 平均久期配置</p> <p>本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，在控制债券组合风险的基础上提高组合收益。</p> <p>(2) 期限结构配置</p> <p>结合对宏观经济形势和政策的判断，运用统计和数量分析技术，本基金对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析，预测收益率曲线的变化趋势，制定组合的期限结构配置策略。</p> <p>(3) 类属配置</p> <p>本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋水平等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。</p> <p>(4) 回购套利</p> <p>本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内，适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率，比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险的套利操作。</p> <p>4. 权证投资策略</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×80%+上证国债指数×20%
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	招商银行股份有限公司	
信息披露 负责人	姓名	侯玉春	张姗
	联系电话	010-82295160—157	400-61-95555
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话	010-58511618	400-61-95555	
传真	010-82295155	0755-83195201	
注册地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
办公地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦	
邮政编码	100013	518040	
法定代表人	毕劲松	缪建民	

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.postfund.com.cn">http://www.postfund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	5,698,002.66
本期利润	43,015,714.23
加权平均基金份额本期利润	0.2118
本期加权平均净值利润率	11.85%
本期基金份额净值增长率	12.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	174,739,907.35
期末可供分配基金份额利润	0.8675
期末基金资产净值	376,172,202.01
期末基金份额净值	1.867
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	115.75%

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, 不是当期发生额)。

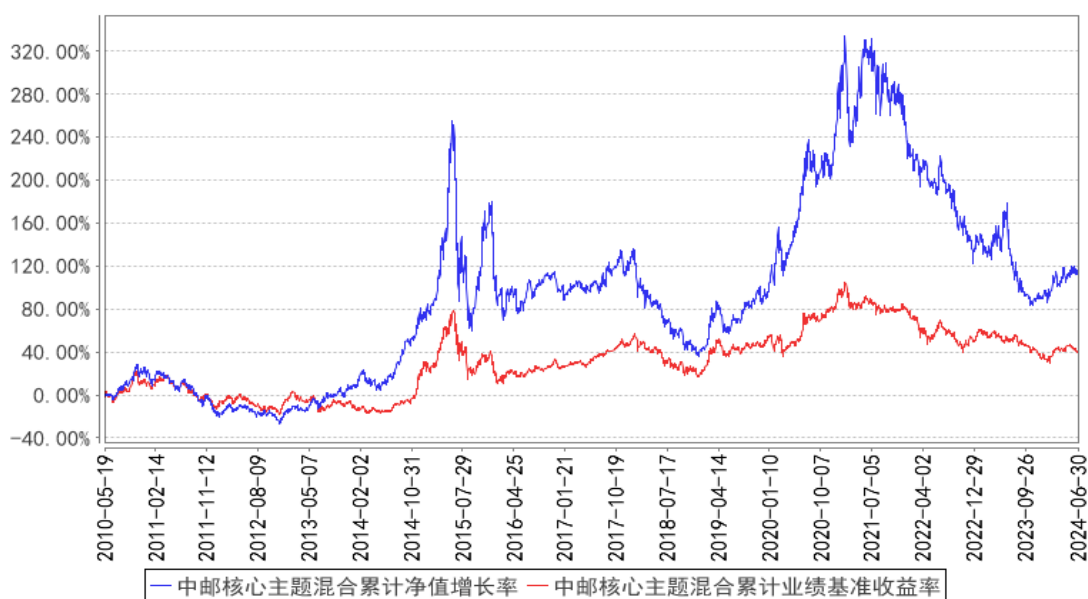
## 3.2 基金净值表现

### 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	-0.69%	1.17%	-2.52%	0.38%	1.83%	0.79%
过去三个月	4.54%	1.14%	-1.31%	0.60%	5.85%	0.54%
过去六个月	12.74%	1.22%	1.57%	0.72%	11.17%	0.50%
过去一年	-14.00%	1.31%	-6.86%	0.70%	-7.14%	0.61%
过去三年	-49.32%	1.64%	-25.58%	0.84%	-23.74%	0.80%
自基金合同生效起至今	115.75%	1.64%	40.15%	1.09%	75.60%	0.55%

### 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

中邮核心主题混合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：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 2024 年 6 月 30

日，本公司共管理 55 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮未来成长混合型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金、中邮兴荣价值一年持有期混合型证券投资基金、中邮能源革新混合型发起式证券投资基金、中邮睿泽一年持有期债券型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金、中邮专精特新一年持有期混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈梁	本基金的	2015 年 3	-	15 年	曾任大连实德集团市场专员、华夏基金管

	基金经理	月 13 日			理有限公司行业研究员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、中邮乐享收益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、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司权益投资部总经理、中邮核心主题混合型证券投资基金、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。

#### 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

开年市场整体延续了从 23 年 11 月份以来的走势。市场整体呈现调整状态，并阶段性出现了一定的流动性压力，在 23 年表现较好的微盘股在 1 月中下旬出现了闪崩。

2 月初随着维稳资金的发力，市场快速企稳反弹，成长方向和主题进行了强演绎。上证综指从最低 2635 点，快速反弹至 3000 点以上。市场热点纷呈，光模块、算力、KIMI、低空经济等主题，你方唱罢我登场。从 2 月初的最低点，各主题阶段性反弹幅度达到 60-100%。

3 月中下旬随着两会的结束，市场整体进入震荡状态。虽然阶段性有各主题的演绎，但宽基指数表现较为平稳。随着 430 政治局会议的表态和 517 地产新政的陆续推出，5 月市场整体走强。伴随着利好兑现，以及下半年对美国总统选举进程中不确定因素的顾虑，6 月份市场再度进入调整阶段。

24 年上半年 A 股整体调整，Wind 全 A 下跌 8%，宽基指数中表现最好的是红利方向，上涨 11-12%；价值方向的宽基基本持平，比如上证、中证 100 和沪深 300；23 年领涨的微盘股跌幅巨大，达到了 25.4%，成长方向整体偏弱，科创 50 下跌 16.4%，科创 100 下跌 25.3%。

在行业层面上，红利/周期相关的板块表现最佳（银行+19.2%、煤炭+12.8%、石油石化+11.4%、家电+10.8%、公用事业+10%、有色+5.9%和交运+5.7%）。科技方向上延续了 23 年的主线，通信表现较强（+4.4%）。内需和成长整体偏弱（综合-37.1%、社服-23.8%、计算机-21.6%、商贸零售-21.5%、传媒-21.5%）。

在组合的操作上，上半年我们重点配置了“能赚钱、能分钱”的红利方向，这构成我们组合的核心方向。从实际效果看，红利方向实现了较好的回报。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.867 元，累计净值为 2.027 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.74%，业绩比较基准收益率为 1.57%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后续，国内在债务、人口和供应链重构的大背景下持续面临内需偏弱的压力，而美债利率虽然经过多轮预期反复，但大概率会延续目前高利率的水平，年内美联储可能仅有降息预期波

动，但难有实际行为发生。

在市场的三大方向中我们更倾向于投资“能赚钱、能分钱”的红利方向，这构成我们组合的核心方向。从实际效果看，上半年红利方向实现了较好的回报。我们在中期维度仍将重点配置在供给具有壁垒的国央企红利资产上。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，本基金未进行利润分配。

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

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：中邮核心主题混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	27,985,817.46	23,657,185.35
结算备付金		323,760.03	1,468,769.63
存出保证金		142,406.64	227,058.89
交易性金融资产	6.4.7.2	350,520,774.76	315,458,600.04
其中：股票投资		350,520,774.76	315,458,600.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		66,905.25	63,397.44
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		379,039,664.14	340,875,011.35
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,678,828.74	-
应付赎回款		114,080.47	127,027.11

应付管理人报酬		371,163.60	359,337.02
应付托管费		61,860.62	59,889.49
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	641,528.70	1,347,182.75
负债合计		2,867,462.13	1,893,436.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	201,432,294.66	204,682,402.65
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	174,739,907.35	134,299,172.33
净资产合计		376,172,202.01	338,981,574.98
负债和净资产总计		379,039,664.14	340,875,011.35

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.867 元，基金份额总额 201,432,294.66 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮核心主题混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		45,640,866.17	34,841,968.69
1. 利息收入		278,435.85	269,836.81
其中：存款利息收入	6.4.7.13	278,435.85	269,836.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		8,033,550.06	-21,059,048.05
其中：股票投资收益	6.4.7.14	3,155,527.26	-23,505,206.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
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	4,878,022.80	2,446,158.78
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	37,317,711.57	55,453,211.09
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	11,168.69	177,968.84
<b>减：二、营业总支出</b>		2,625,151.94	4,340,103.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,164,253.80	3,614,357.53
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	360,708.94	602,392.89
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	100,189.20	123,353.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		43,015,714.23	30,501,865.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		43,015,714.23	30,501,865.14
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		43,015,714.23	30,501,865.14

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中邮核心主题混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	204,682,402.65	-	134,299,172.33	338,981,574.98
加：会计政策变	-	-	-	-



更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	204,682,402.65	-	134,299,172.33	338,981,574.98
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,250,107.99	-	40,440,735.02	37,190,627.03
(一)、综合收益总额	-	-	43,015,714.23	43,015,714.23
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,250,107.99	-	-2,574,979.21	-5,825,087.20
其中：1. 基金申购款	5,957,723.87	-	4,704,005.41	10,661,729.28
2. 基金赎回款	-9,207,831.86	-	-7,278,984.62	-16,486,816.48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	201,432,294.66	-	174,739,907.35	376,172,202.01
项目	上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	272,285,218.16	-	279,123,770.63	551,408,988.79
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	272,285,218.16	-	279,123,770.63	551,408,988.79

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-39,443,661.88	-	-6,387,629.45	-45,831,291.33
(一)、综合收益总额	-	-	30,501,865.14	30,501,865.14
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-39,443,661.88	-	-36,889,494.59	-76,333,156.47
其中：1. 基金申购款	48,058,560.20	-	58,171,489.48	106,230,049.68
2. 基金赎回款	-87,502,222.08	-	-95,060,984.07	-182,563,206.15
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	232,841,556.28	-	272,736,141.18	505,577,697.46

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

李小振

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

中邮核心主题混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2010] 319 号《关于核准中邮核心主题股票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《中邮核心主题股票型证券投资基金基金合同》发起，并于 2010 年 5 月 19 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 2,233,879,213.39 元，业经京都天华会计

师事务所有限公司京都天华验字（2010）第 057 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，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮核心主题混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板）、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。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比例为 60%~95%，债券资产占基金资产的比例为 0%~40%，权证的投资比例为基金资产净值的 0%~3%，并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于核心主题企业的股票比例不低于基金股票资产的 80%。

根据中邮创业基金管理股份有限公司 2015 年 8 月 7 日发布的《中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金更名的公告》，本基金自 2015 年 8 月 7 日起变更为混合型证券投资基金，基金代码保持不变，更名前基金全称为“中邮核心主题股票型证券投资基金”，更名后基金全称为“中邮核心主题混合型证券投资基金”。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 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

无。

### 6.4.6 税项

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

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

基金增值税应税行为包括贷款服务和金融商品转让。采用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。基金管理人运营基金提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（1）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（2）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

3、基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；

持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；对个人持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	27,985,817.46
等于：本金	27,976,301.91
加：应计利息	9,515.55
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	27,985,817.46

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	308,673,783.61	-	350,520,774.76	41,846,991.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	308,673,783.61	-	350,520,774.76	41,846,991.15
----	----------------	---	----------------	---------------

#### 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

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

本基金本期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	72.83
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	267,914.23
其中：交易所市场	267,914.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	373,541.64
合计	641,528.70

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	204,682,402.65	204,682,402.65
本期申购	5,957,723.87	5,957,723.87
本期赎回（以“-”号填列）	-9,207,831.86	-9,207,831.86
本期末	201,432,294.66	201,432,294.66

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 6.4.7.11 其他综合收益

本报告期内本基金无其他综合收益。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	229,547,449.85	-95,248,277.52	134,299,172.33
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	229,547,449.85	-95,248,277.52	134,299,172.33
本期利润	5,698,002.66	37,317,711.57	43,015,714.23
本期基金份额交易产生的变动数	-3,650,293.77	1,075,314.56	-2,574,979.21
其中：基金申购款	6,690,321.81	-1,986,316.40	4,704,005.41
金赎回款	-10,340,615.58	3,061,630.96	-7,278,984.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	231,595,158.74	-56,855,251.39	174,739,907.35

**6.4.7.13 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	268,974.91
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	7,772.40
其他	1,688.54
合计	278,435.85

**6.4.7.14 股票投资收益****6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,155,527.26
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,155,527.26

**6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	545,243,221.05
减：卖出股票成本总额	540,720,518.05
减：交易费用	1,367,175.74
买卖股票差价收入	3,155,527.26

**6.4.7.15 债券投资收益**

本基金本报告期内无债券投资。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券投资。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

本基金本报告期内无衍生工具投资。



## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,878,022.80
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	4,878,022.80

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	37,317,711.57
股票投资	37,317,711.57
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	37,317,711.57

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10,401.37
基金转换费收入	767.32
合计	11,168.69

注：本基金赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。本基金对持续持有期少于 7 日的投资者收取 1.5% 的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产。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，不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产，其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

## 6.4.7.22 信用减值损失

本报告期内本基金无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	23,869.30
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行结算费用	7,047.56
上清所债券账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	100,189.20

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截止 2024 年 08 月 29 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

2024 年 1 月 3 日，本公司收到中国证监会出具的《关于核准中邮创业基金管理股份有限公司变更主要股东的批复》，核准中邮证券有限责任公司（以下简称“中邮证券”）成为本公司主要股东，中邮证券依法受让本公司 8,700 万股出资（占公司股份总数 28.61%），中国邮政集团有限公司拟通过特定事项协议转让方式，减持挂牌公司 8700 万股，直接持股比例从 28.61%拟变为 0%。

全国中小企业股份转让系统有限责任公司于 2024 年 3 月 13 日出具了《关于中邮基金特定事项协议转让申请的确认函》（（股转函【2024】383 号）；中国证券登记结算有限责任公司北京分公司于 2024 年 4 月 19 日办理完成了上述特定事项协议转让相关过户手续，出具了《证券过户登记确认书》。本次特定事项协议转让已完成。

##### 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、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期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。

## 6.4.10.2 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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,164,253.80	3,614,357.53
其中：应支付销售机构的客户维护费	900,439.46	1,351,349.80
应支付基金管理人的净管理费	1,263,814.34	2,263,007.73

注：支付基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	360,708.94	602,392.89

注：支付基金托管人招商银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年6月30日	2023年1月1日至2023年6月30日
基金合同生效日（2010年5月19日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,332,322.36	4,332,322.36
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	4,332,322.36	4,332,322.36
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.15%	1.86%

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

本报告期末及上年度可比期间除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

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

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	27,985,817.46	268,974.91	34,802,863.81	249,453.21

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内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

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

##### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

##### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

###### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 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

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 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 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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	27,976,301.91	-	-	9,515.55	27,985,817.46
结算备付金	323,614.33	-	-	145.70	323,760.03
存出保证金	142,342.64	-	-	64.00	142,406.64
交易性金融资产	-	-	-	350,520,774.76	350,520,774.76
应收申购款	-	-	-	66,905.25	66,905.25

资产总计	28,442,258.88	-	-	-350,597,405.26	379,039,664.14
负债					
应付赎回款	-	-	-	114,080.47	114,080.47
应付管理人报酬	-	-	-	371,163.60	371,163.60
应付托管费	-	-	-	61,860.62	61,860.62
应付清算款	-	-	-	1,678,828.74	1,678,828.74
其他负债	-	-	-	641,528.70	641,528.70
负债总计	-	-	-	2,867,462.13	2,867,462.13
利率敏感度缺口	28,442,258.88	-	-	-347,729,943.13	376,172,202.01
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	23,636,064.39	-	-	21,120.96	23,657,185.35
结算备付金	1,468,042.97	-	-	726.66	1,468,769.63
存出保证金	226,946.47	-	-	112.42	227,058.89
交易性金融资产	-	-	-	-315,458,600.04	315,458,600.04
应收申购款	-	-	-	63,397.44	63,397.44
资产总计	25,331,053.83	-	-	-315,543,957.52	340,875,011.35
负债					
应付赎回款	-	-	-	127,027.11	127,027.11
应付管理人报酬	-	-	-	359,337.02	359,337.02
应付托管费	-	-	-	59,889.49	59,889.49
其他负债	-	-	-	1,347,182.75	1,347,182.75
负债总计	-	-	-	1,893,436.37	1,893,436.37
利率敏感度缺口	25,331,053.83	-	-	-313,650,521.15	338,981,574.98

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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（包括创业

板)、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60%~95%,债券资产占基金资产的0%~40%,权证占基金资产净值的0%~3%,并保持现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于核心主题企业的股票比例不低于基金股票资产的80%。

于2024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 2024年6月30日		上年度末 2023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	350,520,774.76	93.18	315,458,600.04	93.06
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	350,520,774.76	93.18	315,458,600.04	93.06

注:由于四舍五入的原因本报告期末及上年度末各项资产公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

#### 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量,当本基金基准上升1%		
	固定其它市场变量,当本基金基准下跌1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2024年6月30日)	上年度末(2023年12月31日)
	1. 基金净资产变	1,604,237.64	2,147,168.66



	动		
	2. 基金净资产变动	-1,604,237.64	-2,147,168.66

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，利用 2024 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 0.46。

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	350,520,774.76	315,458,600.04
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	350,520,774.76	315,458,600.04

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金不以公允价值计量的金融资产和金融负债主要包括：货币资金、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、卖出回购金融资产和其他各类应收应付款项等，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	350,520,774.76	92.48
	其中：股票	350,520,774.76	92.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,309,577.49	7.47
8	其他各项资产	209,311.89	0.06
9	合计	379,039,664.14	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 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	-	-
B	采矿业	209,043,400.00	55.57
C	制造业	22,474,400.00	5.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,081,400.00	5.07
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	99,921,574.76	26.56
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	350,520,774.76	93.18

注：由于四舍五入原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601918	新集能源	3,000,000	29,250,000.00	7.78
2	600938	中国海油	820,000	27,060,000.00	7.19
3	601088	中国神华	600,000	26,622,000.00	7.08
4	601225	陕西煤业	1,000,000	25,770,000.00	6.85
5	601898	中煤能源	2,000,000	24,960,000.00	6.64
6	601899	紫金矿业	1,300,000	22,841,000.00	6.07
7	001965	招商公路	1,720,000	20,399,200.00	5.42
8	000429	粤高速 A	1,900,036	19,779,374.76	5.26
9	600012	皖通高速	1,400,000	19,558,000.00	5.20
10	601985	中国核电	1,790,000	19,081,400.00	5.07
11	600377	宁沪高速	1,300,000	16,380,000.00	4.35
12	600350	山东高速	1,800,000	15,930,000.00	4.23
13	600188	兖矿能源	680,000	15,456,400.00	4.11
14	601600	中国铝业	2,000,000	15,260,000.00	4.06
15	601001	晋控煤业	900,000	14,868,000.00	3.95
16	600546	山煤国际	1,000,000	14,620,000.00	3.89
17	601107	四川成渝	1,500,000	7,875,000.00	2.09
18	002128	电投能源	360,000	7,596,000.00	2.02
19	600873	梅花生物	720,000	7,214,400.00	1.92

## 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	600938	中国海油	46,523,889.99	13.72
2	601898	中煤能源	40,933,477.00	12.08
3	601699	潞安环能	25,126,845.60	7.41
4	600023	浙能电力	24,466,941.65	7.22
5	600546	山煤国际	20,736,372.96	6.12
6	601001	晋控煤业	20,668,792.14	6.10
7	600012	皖通高速	19,483,286.00	5.75
8	600873	梅花生物	19,320,513.00	5.70
9	601985	中国核电	18,415,764.00	5.43
10	600377	宁沪高速	18,173,017.00	5.36
11	001965	招商公路	18,054,032.61	5.33
12	301193	家联科技	17,776,429.01	5.24
13	000429	粤高速 A	17,357,313.89	5.12
14	601600	中国铝业	16,190,548.00	4.78
15	600350	山东高速	15,215,927.00	4.49
16	600941	中国移动	14,841,464.00	4.38
17	601939	建设银行	14,083,056.00	4.15
18	601398	工商银行	13,873,000.00	4.09
19	601918	新集能源	13,133,099.00	3.87
20	600256	广汇能源	12,090,694.00	3.57
21	002001	新和成	11,722,875.26	3.46
22	601006	大秦铁路	11,269,500.00	3.32
23	002039	黔源电力	10,884,280.60	3.21
24	300979	华利集团	10,478,223.00	3.09
25	601088	中国神华	10,090,067.00	2.98
26	002372	伟星新材	10,050,812.00	2.97
27	601666	平煤股份	9,395,193.61	2.77
28	002128	电投能源	8,345,196.00	2.46
29	000543	皖能电力	7,793,343.20	2.30

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	601699	潞安环能	32,502,716.40	9.59
2	600941	中国移动	31,866,200.00	9.40
3	600256	广汇能源	30,132,392.00	8.89

4	601857	中国石油	26,152,439.00	7.72
5	600938	中国海油	25,539,708.01	7.53
6	600023	浙能电力	24,145,083.80	7.12
7	600985	淮北矿业	22,892,863.24	6.75
8	600546	山煤国际	22,244,010.00	6.56
9	601898	中煤能源	19,850,517.00	5.86
10	601666	平煤股份	19,806,181.08	5.84
11	600348	华阳股份	19,194,043.82	5.66
12	300158	振东制药	16,665,933.00	4.92
13	300138	晨光生物	16,317,396.00	4.81
14	300972	万辰集团	15,377,000.06	4.54
15	603558	健盛集团	15,264,303.00	4.50
16	301193	家联科技	14,596,907.90	4.31
17	601939	建设银行	14,282,925.00	4.21
18	601398	工商银行	14,167,500.00	4.18
19	002001	新和成	11,745,587.67	3.46
20	600873	梅花生物	11,337,530.00	3.34
21	300979	华利集团	11,237,923.00	3.32
22	601006	大秦铁路	11,216,500.00	3.31
23	002039	黔源电力	10,826,734.00	3.19
24	002372	伟星新材	10,385,846.00	3.06
25	000983	山西焦煤	9,625,297.00	2.84
26	601899	紫金矿业	9,540,475.00	2.81
27	600276	恒瑞医药	8,455,274.00	2.49
28	600519	贵州茅台	8,232,000.00	2.43
29	601088	中国神华	7,945,578.00	2.34
30	000543	皖能电力	7,401,742.00	2.18

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	538,464,981.20
卖出股票收入（成交）总额	545,243,221.05

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 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投资。

**7.11.2 本期国债期货投资评价****7.12 投资组合报告附注****7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形**

本报告期内本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是否超出基金合同规定的备选股票库**

基金投资的前十名股票均为基金合同规定备选股票股库之内股票。

**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	142,406.64
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	66,905.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	209,311.89

**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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

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 (%)
24,772	8,131.45	4,502,775.93	2.24	196,929,518.73	97.76

### 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	32,393.27	0.02

### 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情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 5 月 19 日) 基金份额总额	2,233,879,213.39
本报告期期初基金份额总额	204,682,402.65
本报告期基金总申购份额	5,957,723.87
减：本报告期基金总赎回份额	9,207,831.86
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	201,432,294.66

## § 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**

本基金管理人、托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期基金投资策略没有改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

自 2024 年 1 月 29 日起, 改聘中审亚太会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金进行审计。

**10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期管理人及其高级管理人员无受到稽查或处罚情况。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内, 基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

**10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位: 人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	1	474,557,746.16	43.79	448,878.94	43.79	-
华泰证券	1	350,360,199.71	32.33	331,409.11	32.33	-
方正证券	2	226,731,861.38	20.92	214,468.88	20.92	-
海通证券	1	32,058,395.00	2.96	30,324.11	2.96	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-



首创证券	1	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

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

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

2、按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

华创证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源证券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中邮核心主题混合型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	规定媒介	2024 年 01 月 22 日
2	中邮创业基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金增加深圳前海微众银行 股份有限公司为代销机构及开通相关 业务的公告	规定媒介	2024 年 01 月 29 日
3	中邮创业基金管理股份有限公司基金 改聘会计师事务所公告	规定媒介	2024 年 01 月 30 日
4	中邮创业基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金在华泰证券股份有限公 司开通定投业务并参加其费率优惠活 动的公告	规定媒介	2024 年 01 月 30 日
5	中邮创业基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金在东方证券股份 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	2024 年 02 月 02 日
6	中邮创业基金管理股份有限公司关于 调整中邮核心主题混合型证券投资基 金在东方财富证券股份有限公司申购 及定投起点金额的公告	规定媒介	2024 年 03 月 05 日
7	中邮核心主题混合型证券投资基金 2023 年年度报告	规定媒介	2024 年 03 月 28 日
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金增加万联证券股份有限 公司为代销机构并参加其费率优惠活 动的公告	规定媒介	2024 年 04 月 15 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金在中国中金财富证券有 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	2024 年 04 月 16 日
10	中邮创业基金管理股份有限公司关于 旗下部分基金参加光大证券股份有限	规定媒介	2024 年 04 月 17 日

	公司费率优惠活动的公告		
11	中邮核心主题混合型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	规定媒介	2024 年 04 月 22 日
12	中邮创业基金管理股份有限公司关于 在中国邮政储蓄银行股份有限公司开 通基金转换业务及参加转换补差费率 优惠活动的公告	规定媒介	2024 年 04 月 25 日
13	中邮创业基金管理股份有限公司关于 在兴业银行股份有限公司开通基金转 换业务的公告	规定媒介	2024 年 05 月 17 日
14	中邮核心主题混合型证券投资基金基 金产品资料概要（更新）	规定媒介	2024 年 06 月 17 日

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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮核心主题混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮核心主题混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮核心主题混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮核心主题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媒介上披露的各项公告

### 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](http://www.postfund.com.cn)

中邮创业基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 30 日