

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  
2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司（简称：邮储银行）根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>15</b>
6.1 资产负债表.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	37
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.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	43
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.....	43
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.....	43
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.....	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	46
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>47</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>51</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.....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>52</b>
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	中邮价值优选一年定期开放混合
基金主代码	008890
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 9 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,000,300.03 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制投资组合风险的前提下，优选具备估值优势或成长潜力的公司进行投资，谋求基金资产的长期稳健增值，力争为基金投资人谋取稳定的投资回报。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金通过对宏观经济运行状况、货币政策、利率走势和证券市场政策分析等宏观基本面研究，结合对各大类资产的预期收益率、波动性及流动性等因素的评估，合理确定本基金在股票、债券、现金等金融工具上的投资比例。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1) 宏观经济及政策分析</li> <li>2) 行业研究</li> <li>3) 公司研究</li> </ol> <p>（三）债券投资策略</p> <p>债券投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用策略和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。</p> <p>（四）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在利率基本面分析、市场流动性分析和信用评级支持的基础上，辅以与国债、企业债等债券品种的相对价值比较，审慎投资资产支持证券类资产。</p> <p>（五）可转换债券投资策略</p> <p>可转换债券兼具权益类证券与固定收益类证券的特性，具有抵御下行风险、分享股票价格上涨收益的特点。本基金将精选发行人基本面优秀、标的股票上涨潜力较高的可转换债券进行投资。积极参与其中发行条款较好、申购收益较高的可转换债券的一级申购；同时综合运用多种策略进行二级市场投资，在有效控</p>

	制风险的前提下博取相对更高的回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×40%+中债综合指数收益率×60%
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。

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	韩笑微
	联系电话	010-82295160—157	010-68858113
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	hanxiaowei@psbcoa.com.cn
客户服务电话		010-58511618	95580
传真		010-82295155	010-68858120
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		100013	100808
法定代表人		毕劲松	刘建军

### 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住所。

### 2.5 其他相关资料

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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	-709,608.94
本期利润	176,674.23
加权平均基金份额本期利润	0.0147
本期加权平均净值利润率	1.47%
本期基金份额净值增长率	1.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-606,477.24
期末可供分配基金份额利润	-0.0505
期末基金资产净值	11,765,098.62
期末基金份额净值	0.9804
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-1.96%

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

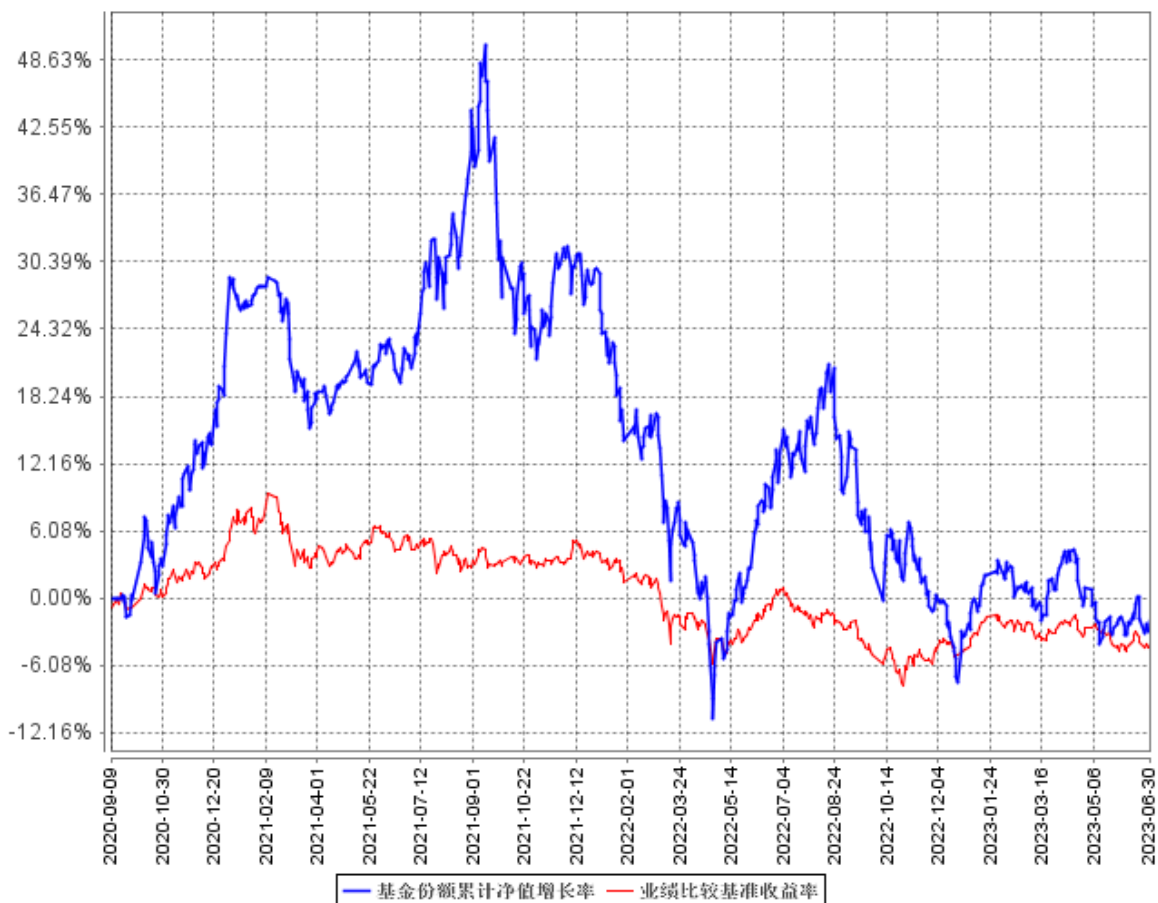
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-0.05%	0.85%	0.58%	0.34%	-0.63%	0.51%
过去三个月	-3.89%	0.81%	-1.49%	0.33%	-2.40%	0.48%
过去六个月	1.52%	0.78%	0.53%	0.33%	0.99%	0.45%
过去一年	-12.50%	1.05%	-4.96%	0.39%	-7.54%	0.66%
自基金合同生效起至今	-1.96%	1.20%	-4.19%	0.46%	2.23%	0.74%



### 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 2023 年 6 月 30 日，本公司共管理 56 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮未来成长混合型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金、中邮兴荣价值一年持有期混合型证券投资基金、中邮能源革新混合型发起式证券投资基金、中邮睿泽一年持有期债券型证

券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金、中邮专精特新一年持有期混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王高	基金经理	2021年2月18日	-	8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、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基金经理。现担任中邮中证500指数增强型证券投资基金、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、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。

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

今年上半年，A 股整体呈现震荡格局，不同板块行情分化加剧。在人工智能科技浪潮的带动下，相关的算力硬件、模型开发、AI 应用等子板块和个股大幅上涨，成交金额急剧放大，行情火热；受到风险偏好下行及国企改革政策利好的双重影响，以“中特估”为代表的盈利稳定、估值偏低的确定性高的资产受到市场追捧，相关个股出现了“拔估值”的行情；与前两个主题呈现明显对比的是，基金重仓的传统板块如大消费、新能源、医药等行业表现较弱，震荡下行。上半年从风格上来讲，成长风格普遍表现不佳，尤其是大盘成长不断下跌，而估值、低波类风格表现较好，小市值风格表现强劲。

上半年本基金主要投资方向聚焦在具有长期增长潜力的行业，投资重点放在行业内未来业绩确定性高、估值合理的优秀公司，从业绩增长与估值匹配角度精选个股和可转债进行投资，同时降低行业和个券的集中度，分散配置。

#### 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 0.9804 元，累计净值为 0.9804 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.52%，业绩比较基准收益率为 0.53%。

### 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，海内外流动性将边际趋于宽松，而国内经济支持政策逐步出台，经济增长及消费预期将迎来一定修复，企业盈利将逐步见底；另一方面当下市场对未来盈利端的预期反应过于悲观，如果基本面好转，A 股将迎来不错的反弹机会。

#### 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在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（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

### 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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,324,876.10	1,468,961.50
结算备付金		31,526.97	8,028.58
存出保证金		7,966.51	7,874.57
交易性金融资产	6.4.7.2	10,445,283.47	10,134,807.98
其中：股票投资		7,471,996.00	7,434,554.00
基金投资		-	-
债券投资		2,973,287.47	2,700,253.98
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		11,809,653.05	11,619,672.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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		149.14	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,837.19	4,958.60
应付托管费		1,934.87	1,983.43
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		43.48	49.90
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	37,589.75	24,256.31
负债合计		44,554.43	31,248.24
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	12,000,300.03	12,000,300.03
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-235,201.41	-411,875.64
净资产合计		11,765,098.62	11,588,424.39
负债和净资产总计		11,809,653.05	11,619,672.63

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9804 元，基金份额总额 12,000,300.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		232,370.83	-2,068,149.76
1.利息收入		6,118.88	2,125.14
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,118.88	2,125.14
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-660,031.22	-2,486,246.43
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-634,230.30	-2,432,122.14
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-45,618.64	-111,370.00
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	19,817.72	57,245.71
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	886,283.17	415,971.53
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	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		55,696.60	63,754.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	29,794.04	32,321.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,917.62	12,928.43
3. 销售服务费		-	-
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		25.54	45.46
8. 其他费用	6.4.7.23	13,959.40	18,459.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		176,674.23	-2,131,904.07
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		176,674.23	-2,131,904.07
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		176,674.23	-2,131,904.07

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	12,000,300.03	-	-411,875.64	11,588,424.39
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）	12,000,300.03	-	-411,875.64	11,588,424.39

三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	176,674.23	176,674.23
(一)、综合收益总额	-	-	176,674.23	176,674.23
(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)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	12,000,300.03	-	-235,201.41	11,765,098.62
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	12,000,300.03	-	3,577,929.03	15,578,229.06
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)	12,000,300.03	-	3,577,929.03	15,578,229.06
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-	-	-2,131,904.07	-2,131,904.07
(一)、综合收益总额	-	-	-2,131,904.07	-2,131,904.07
(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)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-

2.基金赎回款	-	-	-	-
(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）	12,000,300.03	-	1,446,024.96	13,446,324.99

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中邮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（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会证监许可[2019] 2736 号《关于准予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》、《公开募集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基金合同》发起，并于 2020 年 9 月 9 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及利息共计 12,000,300.03 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2020)第 110ZC00327 号验资报告予以验证。《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基金合同》于 2020 年 9 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 12,000,300.03 份基金份额。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资

产支持证券、银行存款、债券回购、同业存单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）。基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%。开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。开放期内，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%；封闭期内，本基金不受该比例的限制；前述现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于银行存款与同业存单的比例合计不得超过基金资产的 20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

#### 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。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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额；（2）转让股票、债券、基金、非货物期货，按照实际买入价计算销售额。

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,324,876.10
等于：本金	1,324,619.97
加：应计利息	256.13
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：	1,324,876.10

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	7,220,775.03	-	7,471,996.00	251,220.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	2,844,308.14	8,924.47	2,973,287.47	120,054.86
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,844,308.14	8,924.47	2,973,287.47	120,054.86
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	10,065,083.17	8,924.47	10,445,283.47	371,275.83	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本期末未持有黄金衍生品。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有买断式逆回购金融资产。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

本基金本期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,130.35
其中：交易所市场	18,130.35
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	19,459.40
合计	37,589.75

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,000,300.03	12,000,300.03
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 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	12,000,300.03	12,000,300.03

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

本基金本报告期内无其他综合收益。

#### 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	103,131.70	-515,007.34	-411,875.64
本期利润	-709,608.94	886,283.17	176,674.23
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-606,477.24	371,275.83	-235,201.41

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	236.08
其他	56.68
合计	6,118.88



## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	23,725,713.79
减：卖出股票成本总额	24,297,809.55
减：交易费用	62,134.54
买卖股票差价收入	-634,230.30

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	10,571.25
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-56,189.89
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	-45,618.64

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,835,977.28
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,885,987.47
减：应计利息总额	6,029.16
减：交易费用	150.54
买卖债券差价收入	-56,189.89

## 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

本报告期内本基金无贵金属投资。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

本报告期内本基金无衍生工具投资。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,817.72
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	19,817.72

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	886,283.17
——股票投资	643,325.68
——债券投资	242,957.49
——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	886,283.17

**6.4.7.21 其他收入**

本报告期内本基金无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期内无信用减值损失。

### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	4,959.40
信息披露费	-
证券出借违约金	-
债券帐户维护费	9,000.00
合计	13,959.40

### 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 2023 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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人

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

本报告期及上年度可比期间本基金未发生通过关联方交易单元进行交易的情况。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
----	--------------------------------	---------------------------------

当期发生的基金应支付的管理费	29,794.04	32,321.02
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。管理费的计算方法如下：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,917.62	12,928.43

注：支付基金托管人中国邮政储蓄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，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日

	月 30 日	日
基金合同生效日（2020 年 9 月 9 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	12,000,300.03	12,000,300.03
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	12,000,300.03	12,000,300.03
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	100.00%	100.00%

#### 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末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	1,324,876.10	5,826.12	919,508.80	1,604.01

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

本报告期及上年度可比期间本基金未发生在承销期内参与认购关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

本基金本期末未持有认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告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债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本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	上年度末
--------	-----	------

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	86,253.26	-
合计	86,253.26	-

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	627,136.52	676,857.38
AAA 以下	2,259,897.69	2,023,396.60
未评级	-	-
合计	2,887,034.21	2,700,253.98

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 2023年6月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,324,619.97	-	-	256.13	1,324,876.10
结算备付金	31,514.19	-	-	12.78	31,526.97
存出保证金	7,963.27	-	-	3.24	7,966.51
交易性金融资产	-	2,665,906.00	298,457.00	7,480,920.47	10,445,283.47
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,364,097.43	2,665,906.00	298,457.00	7,481,192.62	11,809,653.05
负债					
应付清算款	-	-	-	149.14	149.14
应付管理人报酬	-	-	-	4,837.19	4,837.19
应付托管费	-	-	-	1,934.87	1,934.87



应交税费	-	-	-	43.48	43.48
其他负债	-	-	-	37,589.75	37,589.75
负债总计	-	-	-	44,554.43	44,554.43
利率敏感度缺口	1,364,097.43	2,665,906.00	298,457.00	7,436,638.19	11,765,098.62
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,468,682.68	-	-	278.82	1,468,961.50
结算备付金	8,024.98	-	-	3.60	8,028.58
存出保证金	7,870.97	-	-	3.60	7,874.57
交易性金融资产	-	2,506,282.00	186,088.00	7,442,437.98	10,134,807.98
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	1,484,578.63	2,506,282.00	186,088.00	7,442,724.00	11,619,672.63
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	4,958.60	4,958.60
应付托管费	-	-	-	1,983.43	1,983.43
应交税费	-	-	-	49.90	49.90
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	24,256.31	24,256.31
负债总计	-	-	-	31,248.24	31,248.24
利率敏感度缺口	1,484,578.63	2,506,282.00	186,088.00	7,411,475.76	11,588,424.39

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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 基金净资产变动	-25,016.54	-23,758.60
	2. 基金净资产变动	25,642.42	24,348.72

#### 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（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、银行存款、债券回购、同业存单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）。基金的投资组合比例为：封闭期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—100%。开放期内，股票资产占基金资产的比例为 0%—95%。开放期内，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%；封闭期内，本基金不受该比例的限制；前述现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。本基金投资于银行存款与同业存单的比例合计不得超过基金资产的 20%。如法律法规或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。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	7,471,996.00	63.51	7,434,554.00	64.16
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	2,973,287.47	25.27	2,700,253.98	23.30
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	10,445,283.47	88.78	10,134,807.98	87.46

#### 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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	1. 基金净资产变动	168,810.42	210,330.24
	2. 基金净资产变动	-168,810.42	-210,330.24

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果，其中，利用 2023 年 1 月 1 日以来基金日收益率与基金基准日收益率计算得到基金的 Beta 系数为 1.62。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	10,445,283.47	10,134,807.98
第二层次	-	-

第三层次	-	-
合计	10,445,283.47	10,134,807.98

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	7,471,996.00	63.27
	其中：股票	7,471,996.00	63.27
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,973,287.47	25.18
	其中：债券	2,973,287.47	25.18
	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	1,356,403.07	11.49
8	其他各项资产	7,966.51	0.07
9	合计	11,809,653.05	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	266,040.00	2.26
B	采矿业	1,603,240.00	13.63
C	制造业	4,952,706.00	42.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	216,850.00	1.84
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	433,160.00	3.68
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	-	-

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,471,996.00	63.51

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

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未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	占基金资产净值比例（%）
1	600276	恒瑞医药	10,000	479,000.00	4.07
2	002409	雅克科技	6,000	437,280.00	3.72
3	000960	锡业股份	28,000	435,400.00	3.70
4	002908	德生科技	28,000	433,160.00	3.68
5	600547	山东黄金	18,000	422,640.00	3.59
6	600489	中金黄金	40,000	413,200.00	3.51
7	600326	西藏天路	58,000	390,340.00	3.32
8	300604	长川科技	8,000	379,920.00	3.23
9	300223	北京君正	4,000	353,240.00	3.00
10	601899	紫金矿业	30,000	341,100.00	2.90
11	600862	中航高科	12,000	303,720.00	2.58
12	002600	领益智造	40,000	276,400.00	2.35
13	000738	航发控制	11,000	268,400.00	2.28
14	000426	兴业银锡	30,000	266,400.00	2.26
15	300972	万辰生物	6,000	266,040.00	2.26
16	600150	中国船舶	8,000	263,280.00	2.24
17	600363	联创光电	7,000	259,700.00	2.21
18	002463	沪电股份	12,000	251,280.00	2.14
19	000837	秦川机床	15,000	244,200.00	2.08
20	000963	华东医药	5,000	216,850.00	1.84
21	603986	兆易创新	2,000	212,500.00	1.81
22	688082	盛美上海	1,500	165,600.00	1.41
23	603993	洛阳钼业	30,000	159,900.00	1.36
24	603773	沃格光电	5,000	157,800.00	1.34

25	688008	澜起科技	1,300	74,646.00	0.63
----	--------	------	-------	-----------	------

## 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	002185	华天科技	580,030.00	5.01
2	603885	吉祥航空	567,071.00	4.89
3	600276	恒瑞医药	563,147.00	4.86
4	603986	兆易创新	546,040.00	4.71
5	300223	北京君正	524,713.00	4.53
6	600760	中航沈飞	502,302.00	4.33
7	000876	新希望	473,721.09	4.09
8	600862	中航高科	473,337.00	4.08
9	300775	三角防务	459,223.00	3.96
10	601186	中国铁建	436,300.00	3.76
11	300604	长川科技	434,782.80	3.75
12	600803	新奥股份	419,831.50	3.62
13	600489	中金黄金	415,462.00	3.59
14	002409	雅克科技	415,380.00	3.58
15	000960	锡业股份	412,757.00	3.56
16	002028	思源电气	406,247.00	3.51
17	000977	浪潮信息	402,119.00	3.47
18	600547	山东黄金	396,510.00	3.42
19	600326	西藏天路	381,800.00	3.29
20	002755	奥赛康	376,581.00	3.25
21	600363	联创光电	376,034.00	3.24
22	300702	天宇股份	366,586.00	3.16
23	300454	深信服	366,563.00	3.16
24	600975	新五丰	365,233.00	3.15
25	601899	紫金矿业	359,540.00	3.10
26	603605	珀莱雅	359,471.00	3.10
27	688082	盛美上海	357,309.44	3.08
28	000831	中国稀土	350,750.00	3.03

29	300308	中际旭创	340,519.00	2.94
30	002908	德生科技	339,280.00	2.93
31	002415	海康威视	338,036.00	2.92
32	688100	威胜信息	332,322.00	2.87
33	300592	华凯易佰	330,800.00	2.85
34	688126	沪硅产业	311,590.60	2.69
35	600435	北方导航	307,612.00	2.65
36	002714	牧原股份	303,245.00	2.62
37	603993	洛阳钼业	297,850.00	2.57
38	300855	图南股份	295,952.00	2.55
39	300842	帝科股份	293,000.00	2.53
40	002865	钧达股份	288,900.00	2.49
41	301302	华如科技	288,350.00	2.49
42	300017	网宿科技	276,400.00	2.39
43	603069	海汽集团	269,000.00	2.32
44	000915	华特达因	266,656.00	2.30
45	002600	领益智造	265,800.00	2.29
46	000738	航发控制	264,110.00	2.28
47	688107	安路科技	261,637.87	2.26
48	300725	药石科技	259,305.00	2.24
49	601390	中国中铁	257,644.00	2.22
50	000837	秦川机床	255,450.00	2.20
51	000519	中兵红箭	254,500.00	2.20
52	600710	苏美达	248,676.00	2.15
53	002597	金禾实业	244,915.00	2.11
54	000426	兴业银锡	244,180.00	2.11
55	688559	海目星	241,953.27	2.09
56	002463	沪电股份	241,942.00	2.09
57	600150	中国船舶	239,200.00	2.06
58	601800	中国交建	239,000.00	2.06
59	688281	华秦科技	235,254.12	2.03
60	300972	万辰生物	234,857.00	2.03

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	002185	华天科技	580,800.00	5.01
2	300347	泰格医药	577,287.00	4.98
3	600276	恒瑞医药	568,725.00	4.91
4	603127	昭衍新药	566,747.00	4.89
5	603885	吉祥航空	561,665.00	4.85
6	300308	中际旭创	554,141.00	4.78
7	688559	海目星	525,061.91	4.53
8	300438	鹏辉能源	493,481.00	4.26
9	000977	浪潮信息	475,588.00	4.10
10	002025	航天电器	474,676.00	4.10
11	300592	华凯易佰	470,531.00	4.06
12	600760	中航沈飞	468,254.00	4.04
13	600348	华阳股份	453,440.00	3.91
14	000876	新希望	440,275.00	3.80
15	002028	思源电气	428,010.00	3.69
16	000915	华特达因	425,066.00	3.67
17	601186	中国铁建	423,600.00	3.66
18	300443	金雷股份	420,993.00	3.63
19	300775	三角防务	411,900.00	3.55
20	600803	新奥股份	399,726.00	3.45
21	000831	中国稀土	373,202.00	3.22
22	300702	天宇股份	359,923.00	3.11
23	688680	海优新材	355,401.14	3.07
24	688768	容知日新	348,618.69	3.01
25	603800	道森股份	342,753.00	2.96
26	688126	沪硅产业	342,000.00	2.95
27	603605	珀莱雅	339,858.00	2.93
28	300842	帝科股份	337,404.00	2.91
29	300124	汇川技术	336,236.00	2.90
30	603986	兆易创新	332,026.00	2.87
31	301155	海力风电	330,697.00	2.85
32	002460	赣锋锂业	330,504.00	2.85
33	002755	奥赛康	328,065.00	2.83
34	688100	威胜信息	322,577.18	2.78
35	300454	深信服	314,364.00	2.71
36	301080	百普赛斯	295,181.00	2.55

37	600975	新五丰	292,909.00	2.53
38	002714	牧原股份	291,588.38	2.52
39	300017	网宿科技	288,000.00	2.49
40	002415	海康威视	282,433.00	2.44
41	600435	北方导航	273,000.00	2.36
42	300003	乐普医疗	267,960.00	2.31
43	603069	海汽集团	264,796.00	2.29
44	300855	图南股份	263,204.00	2.27
45	002865	钧达股份	261,681.13	2.26
46	688107	安路科技	260,503.82	2.25
47	002728	特一药业	257,910.00	2.23
48	300763	锦浪科技	256,125.00	2.21
49	301302	华如科技	255,874.30	2.21
50	300777	中简科技	252,110.00	2.18
51	300217	东方电热	239,600.00	2.07

注：卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	23,691,925.87
卖出股票收入（成交）总额	23,725,713.79

### 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	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,973,287.47	25.27
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,973,287.47	25.27

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。

**7.6 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	127036	三花转债	1,600	229,119.12	1.95
2	110060	天路转债	1,200	166,066.52	1.41
3	127029	中钢转债	800	155,061.41	1.32
4	113588	润达转债	900	131,243.42	1.12
5	110068	龙净转债	700	129,790.84	1.10

**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投资。

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

本报告期末本基金未持有权证。

**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**

本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，无在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	7,966.51
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,966.51

#### 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	127036	三花转债	229,119.12	1.95
2	110060	天路转债	166,066.52	1.41
3	127029	中钢转债	155,061.41	1.32
4	113588	润达转债	131,243.42	1.12
5	110068	龙净转债	129,790.84	1.10
6	113025	明泰转债	129,245.67	1.10
7	110045	海澜转债	125,795.81	1.07
8	123107	温氏转债	125,596.03	1.07
9	110061	川投转债	122,431.92	1.04
10	113063	赛轮转债	109,734.77	0.93
11	113044	大秦转债	103,964.55	0.88
12	128081	海亮转债	102,039.89	0.87
13	127020	中金转债	101,380.01	0.86
14	110053	苏银转债	100,572.93	0.85
15	113641	华友转债	98,164.21	0.83
16	110059	浦发转债	97,283.05	0.83
17	113626	伯特转债	96,781.75	0.82
18	113061	拓普转债	94,517.01	0.80
19	127058	科伦转债	94,486.03	0.80
20	113563	柳药转债	91,144.03	0.77
21	113602	景 20 转债	88,915.15	0.76
22	127005	长证转债	86,253.26	0.73
23	113615	金诚转债	85,627.93	0.73
24	113648	巨星转债	83,290.87	0.71
25	110083	苏租转债	77,288.04	0.66
26	128141	旺能转债	74,279.75	0.63

27	110072	广汇转债	73,213.50	0.62
----	--------	------	-----------	------

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (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
1	12,000,300.03	12,000,300.03	100.00%	0.00	0.00%

### 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	0.00	0.00%

### 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

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额总数	发起份额占 基金总份 额比例（%）	发起份额承 诺持有期限
基金管理人固有 资金	12,000,300.03	100.00	12,000,300.03	100.00	不少于3年
基金管理人高级 管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	12,000,300.03	100.00	12,000,300.03	100.00	不少于3年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年9月9日）基金份额总额	12,000,300.03
本报告期期初基金份额总额	12,000,300.03
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	-
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	12,000,300.03

## § 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

本报告期内，本基金管理人、托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期管理人及其高级管理人员无受到稽查或处罚情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中邮证券	2	23,725,357.96	50.03%	17,350.87	50.04%	-
长江证券	1	23,692,281.70	49.97%	17,326.28	49.96%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	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、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
中邮证券	2,486,280.20	66.18%	-	-	-	-
长江证券	1,270,395.79	33.82%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

### 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 2023 年第 2 季度报告	规定媒介	2023 年 7 月 21 日
2	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 2023 年第 1 季度报告	规定媒介	2023 年 4 月 22 日
3	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	规定媒介	2023 年 3 月 30 日

	2022 年年度报告		
4	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 2022 年第 4 季度报告	规定媒介	2023 年 1 月 20 日

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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 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	20230101-20230630	12,000,300.03	-	-	12,000,300.03	100.00%
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募集的文件
2. 《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基金合同》
3. 《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托管协议》
4. 《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住所。

### 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

2023 年 8 月 31 日