

中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年10月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自2024年07月01日起至2024年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	中邮悦享6个月持有期混合
基金主代码	011872
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年9月14日
报告期末基金份额总额	194,600,076.97份
投资目标	本基金在严格控制投资风险的基础上，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	<p>本基金将采用“自上而下”的大类资产配置策略和“自下而上”的股票投资策略相结合的方法进行投资。</p> <p>(一) 大类资产配置策略</p> <p>本基金在大类资产配置时，将分为战略资产配置和战术资产配置两个层次，并将市场分为趋势型市场和震荡型市场两种类型，并根据不同的资产配置层次和不同的市场类型构建差异化的资产配置策略。</p> <p>首先，本基金将通过定量模型结合基本面分析对未来市场类型进行判断，并针对不同的市场类型灵活应用CPPI、TIPP、Black-Litterman模型以及目标风险模型等数量化投资模型对大类资产进行战略资产配置，确定各大类资产的权重区间。其次，本基金根据量化模型结合技术分析对市场所处阶段进行进一步细分，并在战略配置权重的基础上对资产进行战术调整，确定各类资产的最终权重。</p> <p>(二) A股股票投资策略</p>

	<p>1、行业配置策略</p> <p>本基金将通过定性与定量相结合的方式对股票组合的行业进行配置：</p> <p>定量：通过量化方式构建行业景气度指标，包括研究行业内上市公司财务指标刻画行业整体经营状况，从宏观经济指标、行业特殊数据中寻找预测行业未来发展的先行指标；</p> <p>定性：通过对国家宏观经济运行、产业结构调整、行业自身生命周期、对国民经济发展贡献程度以及行业技术创新等影响行业中长期发展的根本性因素进行分析，从行业对上述因素变化的敏感程度和受益程度入手，筛选处于稳定的中长期发展趋势和预期进入稳定的中长期发展趋势的行业作为重点行业资产进行配置。</p> <p>2、个股投资策略</p> <p>本基金通过定量和定性相结合的研究方法进行股票投资，其中定量模型采用国际通行的量化多因子模型进行选股，定性模型采用“自上而下”和“自下而上”相结合的投资策略。</p> <p>（1）定量模型</p> <p>首先，通过筛选出在A股具备长期超额收益的单因子构建因子池，单因子选择上，既要保证单因子超额收益的稳定性和统计学上的显著，也要保证因子具备一定的投资逻辑。单因子主要基于财务数据和量价数据构建，包括但不限于以下指标：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1) 估值类因子：如市盈率、市净率、市销率等； 2) 盈利类因子：如总资产收益率、净资产收益率等； 3) 成长类因子：营业收入同比、净利润同比、经营现金流同比等； 4) 质量类因子：资产负债率、账面市值比等； 5) 一致预期类因子：预期净利润、预期营业收入等； 6) 动量/反转类因子：20日收益率、240日收益率等； 7) 波动性因子：过去一个月日收益标准差、过去六个月日收益标准差等； 8) 流动性因子：过去一个月日均成交量、过去一个月日均换手率等； 9) 规模类因子：总市值、流动市值等； 10) 其他：如分红类因子、其他技术类因子等； <p>之后，应用 ICIR、机器学习等方法对个股进行打分或收益率预测。</p> <p>（2）定性模型</p> <p>本基金充分发挥基金管理人的研究优势，通过对宏观经济、政策走向、市场利率以及行业发展等进行全面、深入、系统、科学的研究，积极主动构建投资组合，并在实际运作过程中不断进行修正。并以基本面研究和个股挖掘为依据，主要考虑的方面包括上市公司治理结构、</p>
--	---

核心竞争优势、议价能力、市场占有率、成长性、盈利能力、财务结构、现金流情况等公司基本面因素，对上市公司的投资价值进行综合评价，精选具有较高投资价值的上市公司优化投资组合。并根据市场的变化，灵活调整投资组合，从而提高组合收益，降低组合波动。

（三）港股通标的股票投资策略

本基金将采用“自下而上”精选个股的策略。重点关注具有持续领先优势或核心竞争力的公司；盈利能力较高、分红稳定或分红潜力大的公司；与A股同类公司相比具有估值优势的公司。

（四）存托凭证投资策略

本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。

（五）债券投资策略

本基金的债券投资策略主要包括债券投资组合策略、个券选择策略和信用债投资策略。

1、债券投资组合策略

本基金的投资组合策略采用自上而下进行分析，从宏观经济和货币政策等方面，判断未来的利率走势，从而确定债券资产的配置策略；同时，在日常的操作中综合运用久期管理、收益率曲线形变预测等组合手段进行债券日常管理。

（1）久期管理

本基金通过宏观经济及政策形势分析，对未来利率走势进行判断，在充分保证流动性的情况下，确定债券组合久期以及可以调整的范围。

（2）收益率曲线形变预测

收益率曲线形状的变化将直接影响本基金债券组合的收益情况。本基金将根据宏观面、货币政策面等综合因素，对收益率曲线变化进行预测，在保证债券流动性的前提下，适时采用子弹、杠铃或梯形策略构造组合。

2、个券选择策略

在个券选择上，本基金重点考虑个券的流动性，包括是否可以进行质押融资回购等要素，还将根据对未来利率走势的判断，综合运用收益率曲线估值、信用风险分析等方法来评估个券的投资价值。此外，对于可转换债券等内嵌期权的债券，还将通过运用金融工程的方法对期权价值进行判断，最终确定其投资策略。

本基金将重点关注具有以下一项或者多项特征的债券：

（1）信用等级高、流动性好；

（2）资信状况良好、未来信用评级趋于稳定或有明显改善的企业发行的债券；

（3）在剩余期限和信用等级等因素基本一致的前提下，

运用收益率曲线模型或其他相关估值模型进行估值后，市场交易价格被低估的债券；

(4) 公司基本面良好，具备良好的成长空间与潜力，转股溢价率合理、有一定下行保护的可转债。

3、信用债投资策略

(1) 基于信用利差曲线策略

分析宏观经济周期、国家政策、信用债市场容量、市场结构、流动性、信用利差的历史统计区间等因素，进而判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险，以及信用利差曲线的未来趋势，确定信用债券的配置。

(2) 信用债评级策略

本基金将以内部信用评级为主、外部信用评级为辅，密切跟踪企业的信用风险变化，建立信用评级模型对企业进行内部评级。本基金所投资的信用债的信用评级在 AA 及以上，其中本基金投资于信用评级为 AA 的信用债占信用债资产的比例为 0-20%，投资于信用评级为 AA+ 的信用债占信用债资产的比例为 0-70%，投资于信用评级为 AAA 的信用债占信用债资产的比例为 30%-100%。

(3) 信用债个券选择策略

本基金将对债券发行主体的基本面进行研究，以确定债券的违约风险和合理的信用利差水平，判断债券的投资价值。本基金将重点分析债券发行人所处行业的发展前景、市场竞争地位、财务质量（包括资产负债水平、资产变现能力、偿债能力、运营效率以及现金流质量）等要素，综合判断其信用风险，谨慎选择债券发行人基本面良好、债券条款优惠的信用类债券进行投资。

(六) 资产支持证券投资策略

在有效控制风险的前提下，本基金对资产支持证券从以下方面综合定价，选择低估的品种进行投资。主要包括信用因素、流动性因素、利率因素、税收因素和提前还款因素。

(七) 股指期货投资策略

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

(八) 国债期货投资策略

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动

	水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在严控风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳健增值。	
业绩比较基准	沪深300指数收益率×15%+中债综合指数收益率×80%+恒生综合指数收益率(经汇率估值调整)×5%	
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，理论上其预期风险与预期收益水平高于债券型基金和货币市场基金，但低于股票型基金。 本基金的基金资产如投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。	
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	
下属分级基金的基金简称	中邮悦享6个月持有期混合A	中邮悦享6个月持有期混合C
下属分级基金的交易代码	011872	011873
报告期末下属分级基金的份额总额	192,693,263.97份	1,906,813.00份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024年7月1日-2024年9月30日）	
	中邮悦享6个月持有期混合A	中邮悦享6个月持有期混合C
1. 本期已实现收益	3,193,257.54	29,071.80
2. 本期利润	8,546,690.51	79,662.42
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0393	0.0379
4. 期末基金资产净值	211,559,707.07	2,061,778.98
5. 期末基金份额净值	1.0979	1.0813

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。

3.2 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

中邮悦享6个月持有期混合A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	4.35%	0.46%	3.40%	0.25%	0.95%	0.21%

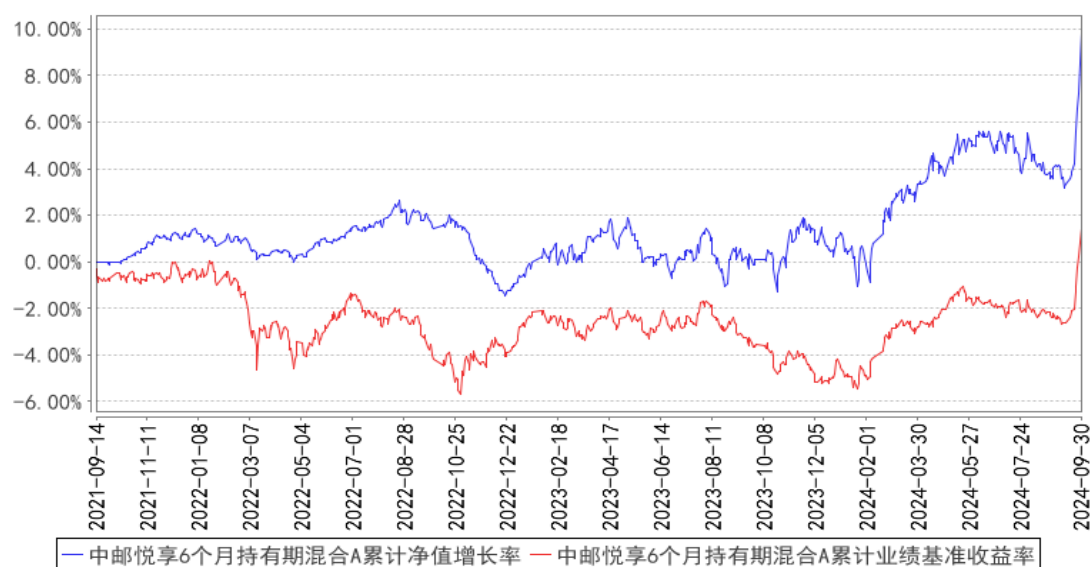
过去六个月	6.22%	0.39%	4.36%	0.21%	1.86%	0.18%
过去一年	9.69%	0.36%	5.16%	0.20%	4.53%	0.16%
过去三年	9.83%	0.25%	2.13%	0.22%	7.70%	0.03%
自基金合同生效起至今	9.79%	0.25%	1.42%	0.22%	8.37%	0.03%

中邮悦享6个月持有期混合C

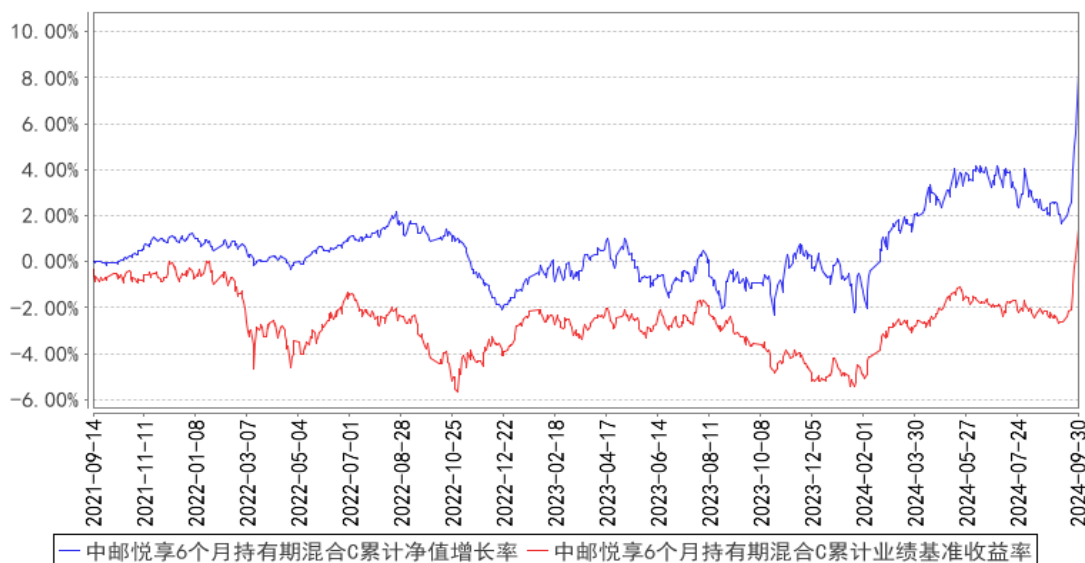
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.23%	0.46%	3.40%	0.25%	0.83%	0.21%
过去六个月	5.97%	0.39%	4.36%	0.21%	1.61%	0.18%
过去一年	9.16%	0.36%	5.16%	0.20%	4.00%	0.16%
过去三年	8.19%	0.25%	2.13%	0.22%	6.06%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.13%	0.25%	1.42%	0.22%	6.71%	0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

中邮悦享6个月持有期混合A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



中邮悦享6个月持有期混合C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规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张悦	本基金的基金经理	2021年9月14日	-	11年	曾任渣打银行（中国）股份有限公司审核与清算岗、民生证券股份有限公司固定收益投资交易部投资经理、光大永明资产管理股份有限公司固定收益投资二部投资经理、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮淳享66个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任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、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、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基金经理注册或变更等通知的日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度市场对于基本面的悲观预期不断发酵，权益市场持续低迷，利率收益率持续走低。直至9月下旬央行出台一揽子宽松政策，力度超市场预期，随后政治局会议上又传递了非常积极的支持经济的政策信号，引发市场预期的全面转变，股债市场出现显著的跷跷板效应。本基金在三季度维持以票息策略为核心，择机进行交易增厚，整体保持了中性久期和杠杆。

展望四季度，股市在一轮情绪推动下的全面快速上涨告一段落，下一阶段大类资产的走势需要财政政策进一步落地的印证。从资产情况来看，股市最悲观的时候已经过去，后续会逐步回归理性，暴涨、普涨行情难以持续，不同品种板块之间会有所分化，调整后需要再次审视不同品种

的上涨逻辑。债券方面，前期过于悲观的预期得到修正，信用债、金融债品种受到理财赎回的扰动，多数券种大幅调整后重新具备显著性价比，尤其是短久期品种。市场在交易预期过后重归交易现实，当前的基本面还处于较弱情形，政策落地效果尚需时间印证。在稳增长的大背景下，货币政策仍将维持呵护状态，一轮激烈调整后的债市开始具备一定的配置价值。四季度产品将择机进行仓位调整，提高流动性资产占比，提高底仓收益，维持中性久期和杠杆水平。转债部分，在当前估值性价比较高阶段，仍维持中高仓位配置，寻找强贝塔、优质的具有估值优势的标的。权益部分，仍维持红利+弹性的配置，以公共事业、交运为核心，其余均配顺周期标的及港股高股息标的。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中邮悦享6个月持有期混合A基金份额净值为1.0979元，累计净值为1.0979元，本报告期基金份额净值增长率为4.35%；截至本报告期末中邮悦享6个月持有期混合C基金份额净值为1.0813元，累计净值为1.0813元，本报告期基金份额净值增长率为4.23%；业绩比较基准收益率为3.40%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	62,426,225.00	22.48
	其中：股票	62,426,225.00	22.48
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	208,710,775.47	75.16
	其中：债券	208,710,775.47	75.16
	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	1,462,360.71	0.53
8	其他资产	5,077,703.42	1.83
9	合计	277,677,064.60	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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
C	制造业	9,834,300.00	4.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,153,300.00	4.28
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	17,360,380.00	8.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,736,345.00	1.75
J	金融业	5,960,000.00	2.79
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	1,523,500.00	0.71
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	47,567,825.00	22.27

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。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	-	-
消费者常用品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	8,767,000.00	4.10
信息技术	1,128,000.00	0.53
电信服务	4,009,400.00	1.88
公用事业	954,000.00	0.45

房地产	-	-
合计	14,858,400.00	6.96

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	603871	嘉友国际	252,000	5,717,880.00	2.68
2	600012	皖通高速	300,000	4,920,000.00	2.30
3	600674	川投能源	250,000	4,712,500.00	2.21
4	600309	万华化学	50,000	4,566,000.00	2.14
5	600642	申能股份	520,000	4,440,800.00	2.08
6	02057	中通快递-W	25,000	4,416,500.00	2.07
7	00700	腾讯控股	10,000	4,009,400.00	1.88
8	600718	东软集团	308,100	3,158,025.00	1.48
9	001965	招商公路	250,000	3,147,500.00	1.47
10	601881	中国银河	200,000	3,078,000.00	1.44

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,794,973.87	3.18
2	央行票据	-	-
3	金融债券	83,674,516.39	39.17
	其中：政策性金融债	41,303,839.58	19.34
4	企业债券	61,461,870.69	28.77
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	36,442,173.42	17.06
8	同业存单	-	-
9	其他	20,337,241.10	9.52
10	合计	208,710,775.47	97.70

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	240205	24 国开 05	200,000	21,007,721.31	9.83
2	232280003	22 成都银行二级资本债 01	100,000	10,730,622.95	5.02
3	232380088	23 苏州银行二级 01	100,000	10,590,626.23	4.96
4	232380089	23 中信银行二级资本债 01A	100,000	10,539,115.85	4.93
5	2221006	22 上海农商二级 01	100,000	10,510,311.78	4.92

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在严控风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳健增值。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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。

5.11.2 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库之内股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	43,139.95
2	应收证券清算款	4,876,132.14
3	应收股利	85,910.30
4	应收利息	-
5	应收申购款	72,521.03
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	5,077,703.42

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙22转债	5,903,733.70	2.76
2	113632	鹤21转债	5,354,864.38	2.51
3	110067	华安转债	4,869,095.89	2.28
4	113061	拓普转债	3,661,016.71	1.71
5	128136	立讯转债	3,483,645.21	1.63
6	113065	齐鲁转债	3,418,148.22	1.60
7	127020	中金转债	2,439,800.00	1.14
8	113623	风21转债	2,275,372.60	1.07
9	127056	中特转债	2,145,400.55	1.00
10	110075	南航转债	1,839,531.78	0.86
11	113627	太平转债	1,051,564.38	0.49

5.11.5 报告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股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中邮悦享6个月持有期混合	中邮悦享6个月持有期混
----	--------------	-------------

	A	合 C
报告期期初基金份额总额	240,118,443.61	2,506,103.87
报告期期间基金总申购份额	551,520.29	22,173.48
减:报告期期间基金总赎回份额	47,976,699.93	621,464.35
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	192,693,263.97	1,906,813.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮悦享 6 个月持有期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

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

9.3 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

2024年10月25日