

中邮悦享 6 个月持有期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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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

§ 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	5
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	8
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	9
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	10
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 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	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44
7.12 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§ 9 开放式基金份额变动	46
§ 10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	47
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	47
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
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	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金	
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	
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	242,624,547.48 份	
基金合同存续期	不定期	
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	240,118,443.61 份	2,506,103.87 份

2.2 基金产品说明

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>

2、个股投资策略

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。

（1）定量模型

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：

- 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；

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。

（2）定性模型

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、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

	<p>良好、债券条款优惠的信用类债券进行投资。</p> <p>(六) 资产支持证券投资策略</p> <p>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。</p> <p>(七) 股指期货投资策略</p> <p>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。</p> <p>(八) 国债期货投资策略</p> <p>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。</p>
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	<p>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。</p> <p>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。</p>

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	张立学
	联系电话	010-82295160—157	010-68858113
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	zhanglixue@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	中国证券报
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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 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
本期已实现收益	2,105,364.31	17,505.48
本期利润	14,011,389.49	127,997.20
加权平均基金份额 本期利润	0.0423	0.0388
本期加权平均净 值利润率	4.11%	3.82%
本期基金份额净 值增长率	4.15%	3.89%
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	8,517,775.35	52,777.28
期末可供分配基 金份额利润	0.0355	0.0211
期末基金资产净 值	252,627,122.03	2,599,929.56
期末基金份额净 值	1.0521	1.0374
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	5.21%	3.74%

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

中邮悦享6个月持有期混合A

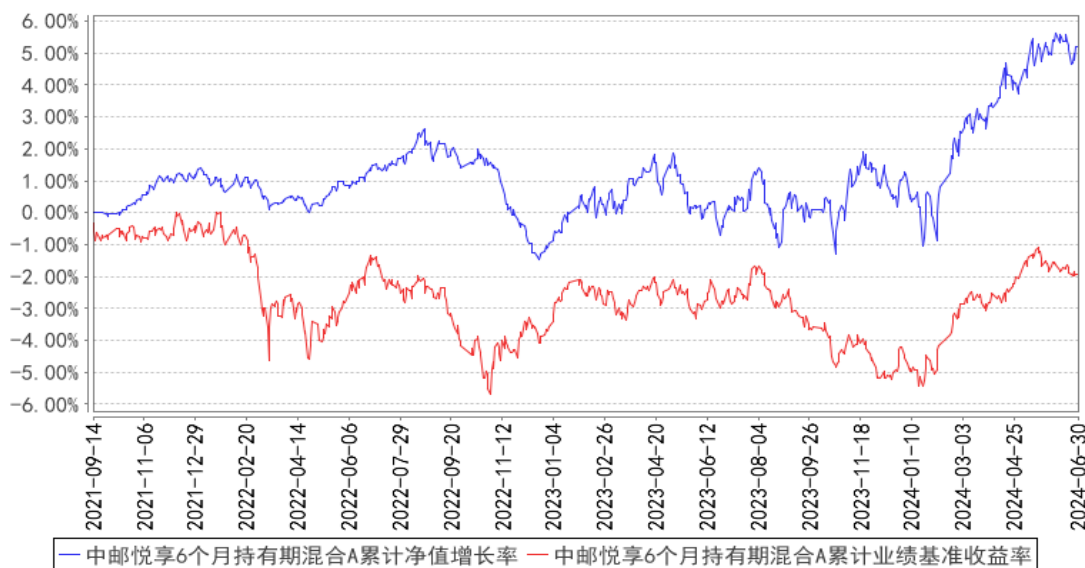
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.19%	0.23%	-0.07%	0.10%	0.26%	0.13%
过去三个月	1.79%	0.28%	0.93%	0.14%	0.86%	0.14%
过去六个月	4.15%	0.32%	2.39%	0.18%	1.76%	0.14%
过去一年	5.34%	0.30%	0.86%	0.18%	4.48%	0.12%
自基金合同生效起至今	5.21%	0.22%	-1.92%	0.21%	7.13%	0.01%

中邮悦享6个月持有期混合C

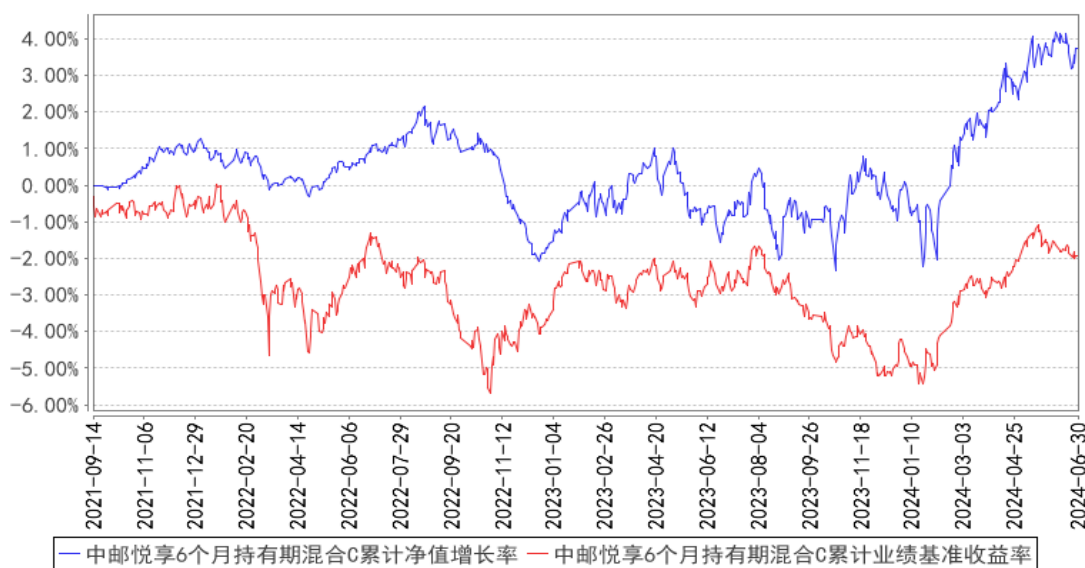
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.14%	0.23%	-0.07%	0.10%	0.21%	0.13%
过去三个月	1.67%	0.28%	0.93%	0.14%	0.74%	0.14%
过去六个月	3.89%	0.32%	2.39%	0.18%	1.50%	0.14%
过去一年	4.80%	0.30%	0.86%	0.18%	3.94%	0.12%
自基金合同生效起至今	3.74%	0.22%	-1.92%	0.21%	5.66%	0.01%

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		
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。
邢儒风	本基金的基金助理	2024 年 2 月 6 日	-	6 年	理学硕士，现任中邮创业基金管理股份有限公司固定收益部研究员，从事宏观利率的研究。

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合规守信情况的说明

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

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，产品保持了票息策略，账户整体采用积极久期和杠杆策略，至二季度后期利差极致压缩后，杠杆效用减弱，转而采用中性杠杆水平，维持积极久期配置。权益方面维持中性仓位，板块选择以公共事业、交运为主的红利资产、港股红利资产以及 TMT 作为弹性仓位。

4.4.2 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 1.0521 元，累计净值为 1.0521 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.15%；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 1.0374 元，累计净值为 1.0374 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.89%；业绩比较基准收益率为 2.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年上半年，市场面临的核心主题是经济基本面的下行，以及价格指标的持续低迷，总量上来看，上半年实际 GDP 增速为 5%，名义 GDP 增速为 4%，名义值的下行幅度更大，不利于资产价格回升，不利于微观主体感受。金融数据来看，社融作为实体经济融资需求的指标，在金融挤水分和实体经济融资需求低迷的背景下，增速持续回落至 8%附近，信用扩张的动力明显不足。结构上来看，地产、金融行业作为旧发展模式，不再受到追捧，新质生产力又尚未为经济注入足够的动力，整体经济活力不足。从风险偏好上来看，社会总体风险偏好持续下降，地产、股票等风险资产总体减持，固收、现金类资产持续增持，宏观条件和投资者行为相互印证。

展望后市，货币政策方面仍需降低实际利率，一方面是银行端的负债成本，另一方面是存量房贷利率以及实体企业特别是民营企业融资成本。财政方面需要增加扩内需方面的措施，以提振消费，从收入效应和财富效应两方面修复居民资产负债表。后续投资上，当前权益市场处于底部区域，将寻求底部反弹的投资机会；债券仍处于资产荒的状态下，短端信用打底，长端利率保持一定久期。

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

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”）在中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金（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：中邮悦享 6 个月持有期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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	55,712.71	52,653.07

结算备付金		11,795,340.75	32,322,687.11
存出保证金		74,129.24	263,544.11
交易性金融资产	6.4.7.2	312,655,962.43	431,252,846.94
其中：股票投资		76,573,434.00	118,934,298.52
基金投资		-	-
债券投资		236,082,528.43	312,318,548.42
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		500,000.00	899,766.57
应收股利		96,432.00	-
应收申购款		797.12	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		325,178,374.25	464,791,497.80
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		68,917,165.60	8,102,946.93
应付清算款		2.08	-
应付赎回款		543,571.90	938,264.30
应付管理人报酬		174,424.45	318,647.00
应付托管费		43,606.13	79,661.74
应付销售服务费		1,105.19	1,841.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,698.19	7,560.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	264,749.12	583,816.58
负债合计		69,951,322.66	10,032,738.38
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	242,624,547.48	450,205,560.52
其他综合收益	6.4.7.11	-	-

未分配利润	6.4.7.12	12,602,504.11	4,553,198.90
净资产合计		255,227,051.59	454,758,759.42
负债和净资产总计		325,178,374.25	464,791,497.80

注：报告截止日2024年06月30日中邮悦享6个月持有期混合A基金份额净值1.0521元，基金份额总额240,118,443.61份；报告截止日2024年06月30日中邮悦享6个月持有期混合C基金份额净值1.0374元，基金份额总额2,506,103.87份；中邮悦享6个月持有期混合份额总额合计为242,624,547.48份。

6.2 利润表

会计主体：中邮悦享6个月持有期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
一、营业总收入		16,496,898.39	17,970,808.33
1. 利息收入		154,697.09	364,825.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	136,574.75	222,376.58
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		18,122.34	142,448.58
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,325,684.40	11,376,358.42
其中：股票投资收益	6.4.7.14	379,098.98	1,562,540.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	3,303,651.90	8,272,758.15
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	642,933.52	1,541,059.97
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	12,016,516.90	6,229,624.75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		2,357,511.70	5,849,987.36
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,376,020.23	3,576,064.10
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	344,005.05	894,016.04
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	8,343.10	16,263.06
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		518,270.36	1,207,139.45
其中：卖出回购金融资产支出		518,270.36	1,207,139.45
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		5,278.13	18,689.97
8. 其他费用	6.4.7.23	105,594.83	137,814.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,139,386.69	12,120,820.97
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,139,386.69	12,120,820.97
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,139,386.69	12,120,820.97

6.3 净资产变动表

会计主体：中邮悦享6个月持有期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	450,205,560.52	-	4,553,198.90	454,758,759.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	450,205,560.52	-	4,553,198.90	454,758,759.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-207,581,013.04	-	8,049,305.21	-199,531,707.83
（一）、综合收益	-	-	14,139,386.69	14,139,386.69

总额				
(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)	-207,581,013.04	-	-6,090,081.48	-213,671,094.52
其中:1.基金申购款	794,154.50	-	30,871.00	825,025.50
2.基金赎回款	-208,375,167.54	-	-6,120,952.48	-214,496,120.02
(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	242,624,547.48	-	12,602,504.11	255,227,051.59
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	1,083,787,184.29	-	-10,250,751.69	1,073,536,432.60
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,083,787,184.29	-	-10,250,751.69	1,073,536,432.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-372,150,316.84	-	9,360,748.86	-362,789,567.98
(一)、综合收益总额	-	-	12,120,820.97	12,120,820.97
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数	-372,150,316.84	-	-2,760,072.11	-374,910,388.95

(净资产减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	258,378.79	-	696.69	259,075.48
2. 基金赎回款	-372,408,695.63	-	-2,760,768.80	-375,169,464.43
(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	711,636,867.45	-	-890,002.83	710,746,864.62

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

中邮悦享 6 个月持有期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[2021]654 号《关于准予中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》批准进行募集，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》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》等有关规定和《中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2021 年 9 月 14 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 4,854,002,858.93 元，业经致同会计师事务所(特殊普通合伙)致同验字(2021)第 110C000636 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《中邮悦享 6 个月持有期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（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、内地与香港股票 市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市 的股票（以下简称“港股通股票”）、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、公开发行的次级债券、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、股指期货、国债期货以及法 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的相关规定）。本基金的 投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0%-30%；港股通标的股票投资 比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的 交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其 中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于同业存单和银行存款的 比例合计不超过基金资产的 20%；投资可转换债券及可交换债券比例合计不超过基金资产的 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

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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记

结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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	55,712.71
等于：本金	55,485.05
加：应计利息	227.66
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	55,712.71

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	70,122,438.98	-	76,573,434.00	6,450,995.02	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	128,843,312.45	1,387,038.74	131,976,788.74	1,746,437.55
	银行间市场	101,196,468.84	1,050,739.69	104,105,739.69	1,858,531.16

	合计	230,039,781.29	2,437,778.43	236,082,528.43	3,604,968.71
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	300,162,220.27	2,437,778.43	312,655,962.43	10,055,963.73

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

本基金本报告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。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	58,224.50
其中：交易所市场	46,998.10
银行间市场	11,226.40
应付利息	-
预提费用	206,524.62
合计	264,749.12

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中邮悦享6个月持有期混合A

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	445,901,510.14	445,901,510.14

本期申购	760,564.30	760,564.30
本期赎回(以“-”号填列)	-206,543,630.83	-206,543,630.83
本期末	240,118,443.61	240,118,443.61

中邮悦享6个月持有期混合C

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	4,304,050.38	4,304,050.38
本期申购	33,590.20	33,590.20
本期赎回(以“-”号填列)	-1,831,536.71	-1,831,536.71
本期末	2,506,103.87	2,506,103.87

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

本基金本期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中邮悦享6个月持有期混合A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,726,271.17	-6,167,184.82	4,559,086.35
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	10,726,271.17	-6,167,184.82	4,559,086.35
本期利润	2,105,364.31	11,906,025.18	14,011,389.49
本期基金份额交易产生的变动数	-4,313,860.13	-1,747,937.29	-6,061,797.42
其中：基金申购款	16,867.89	12,846.06	29,713.95
基金赎回款	-4,330,728.02	-1,760,783.35	-6,091,511.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,517,775.35	3,990,903.07	12,508,678.42

中邮悦享6个月持有期混合C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	53,100.70	-58,988.15	-5,887.45
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	53,100.70	-58,988.15	-5,887.45
本期利润	17,505.48	110,491.72	127,997.20
本期基金份额交易产生的变动数	-17,828.90	-10,455.16	-28,284.06
其中：基金申购款	485.65	671.40	1,157.05

基金赎回款	-18,314.55	-11,126.56	-29,441.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	52,777.28	41,048.41	93,825.69

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	5,262.77	
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	129,976.75	
其他	1,335.23	
合计	136,574.75	

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	379,098.98	
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	379,098.98	

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	105,190,279.20	
减：卖出股票成本总额	104,600,163.07	
减：交易费用	211,017.15	
买卖股票差价收入	379,098.98	

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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入	3,349,919.32	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-46,267.42	

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	3,303,651.90

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	599,040,004.22
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	595,618,147.99
减：应计利息总额	3,455,108.57
减：交易费用	13,015.08
买卖债券差价收入	-46,267.42

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	642,933.52
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	642,933.52

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	12,016,516.90
股票投资	8,122,397.25
债券投资	3,894,119.65
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	12,016,516.90

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	26,852.28
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行结算费用	400.00
上清所债券账户维护费	9,000.00
中债债券账户维护费	9,000.00
深港通证券组合费	62.38
沪港通证券组合费	7.83
其他	600.00
合计	105,594.83

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
中国邮政储蓄银行股份有限公司	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	1,376,020.23	3,576,064.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	648,551.57	1,685,922.93
应支付基金管理人的净管理费	727,468.66	1,890,141.17

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0.80%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 = 前一日的基金资产净值 × 0.80% / 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	344,005.05	894,016.04

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	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	合计
首创证券股份有限公司	-	1.03	1.03
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	8,102.82	8,102.82
合计	-	8,103.85	8,103.85
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	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	合计
首创证券股份有限公司	-	1.81	1.81
中国邮政储蓄银行股份有限公司	-	15,848.46	15,848.46
合计	-	15,850.27	15,850.27

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.50%。

本基金的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.50% 年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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自有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用自有资金投资本基金。

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 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	
	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	55,712.71	5,262.77	4,024,940.18	35,030.97

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/增发证券而于期末流通受限的证券。

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

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

本基金本期末从事证券交易所正回购形成的卖出回购证券款余额 68,917,165.60 元，于 2024 年 7 月 5 日（先后）到期。该类交易要求本基金在回购期内持有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，不低于债券回购的余额。

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	24,037,757.13	30,134,254.10
合计	24,037,757.13	30,134,254.10

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	上年度末
--------	-----	------

	2024年6月30日	2023年12月31日
AAA	153,133,014.21	270,177,189.53
AAA以下	32,641,609.15	12,007,104.79
未评级	26,270,147.94	-
合计	212,044,771.30	282,184,294.32

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 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	55,485.05	-	-	227.66	55,712.71
结算备付金	11,791,030.12	-	-	4,310.63	11,795,340.75
存出保证金	74,099.27	-	-	29.97	74,129.24
交易性金融资产	23,744,510.00	121,169,240.00	88,731,000.00	79,011,212.43	312,655,962.43
应收股利	-	-	-	96,432.00	96,432.00
应收申购款	-	-	-	797.12	797.12
应收清算款	-	-	-	500,000.00	500,000.00
资产总计	35,665,124.44	121,169,240.00	88,731,000.00	79,613,009.81	325,178,374.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	543,571.90	543,571.90
应付管理人报酬	-	-	-	174,424.45	174,424.45
应付托管费	-	-	-	43,606.13	43,606.13
应付清算款	-	-	-	2.08	2.08
卖出回购金融资产款	68,900,000.00	-	-	17,165.60	68,917,165.60
应付销售服务费	-	-	-	1,105.19	1,105.19
应交税费	-	-	-	6,698.19	6,698.19
其他负债	-	-	-	264,749.12	264,749.12
负债总计	68,900,000.00	-	-	1,051,322.66	69,951,322.66
利率敏感度缺口	-33,234,875.56	121,169,240.00	88,731,000.00	78,561,687.15	255,227,051.59
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	52,241.86	-	-	411.21	52,653.07
结算备付金	32,313,359.00	-	-	9,328.11	32,322,687.11
存出保证金	263,425.61	-	-	118.50	263,544.11
交易性金融资产	40,308,000.00	148,024,839.23	121,815,000.00	121,105,007.71	431,252,846.94
应收清算款	-	-	-	899,766.57	899,766.57
资产总计	72,937,026.47	148,024,839.23	121,815,000.00	122,014,632.10	464,791,497.80
负债					
卖出回购金融资产款	8,100,000.00	-	-	2,946.93	8,102,946.93
应付赎回款	-	-	-	938,264.30	938,264.30

应付管理人报酬	-	-	-	318,647.00	318,647.00
应付托管费	-	-	-	79,661.74	79,661.74
应付销售服务费	-	-	-	1,841.14	1,841.14
应交税费	-	-	-	7,560.69	7,560.69
其他负债	-	-	-	583,816.58	583,816.58
负债总计	8,100,000.00	-	-	1,932,738.38	10,032,738.38
利率敏感度缺口	64,837,026.47	148,024,839.23	121,815,000.00	120,081,893.72	454,758,759.42

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	市场利率平移上升 25 个基点且其他市场变量保持不变		
	市场利率平移下降 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 基金净资产变动	-2,680,310.07	-3,471,964.38
2. 基金净资产变动	3,115,095.53	3,507,582.13	

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			合计
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	9,156,300.00	-	9,156,300.00
资产合计	-	9,156,300.00	-	9,156,300.00

以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	9,156,300.00	-	9,156,300.00
项目	上年度末 2023年12月31日			
	美元折合人民币元	港币折合人民币元	其他币种折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量，当港币兑人民币汇率上涨1%		
	固定其它市场变量，当港币兑人民币汇率下跌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. 基金净资产变动	790,112.12	-
	2. 基金净资产变动	-790,112.12	-

6.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、存托凭证、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通股票”）、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、公开发行的次级债券、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、股指期货、国债期货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的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票及存托凭证投资占基金资产的比例为 0% - 30%；港股通标的股票投资比例不超过全部股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于同业存单和银行存款的比例合计不超过基金资产的 20%；投资可转换债券及可交换债券比例合计不超过基金资产的 20%。

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：

6.4.13.4.3.1 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	76,573,434.00	30.00	118,934,298.52	26.15
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	236,082,528.43	92.50	312,318,548.42	68.68
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	312,655,962.43	122.50	431,252,846.94	94.83

6.4.13.4.3.2 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. 基金净资产变动	3,940,721.10	4,266,710.13
	2. 基金净资产变动	-3,940,721.10	-4,266,710.13

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 1.26。

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	116,862,386.34	167,203,122.10
第二层次	195,793,576.09	264,049,724.84
第三层次	-	-
合计	312,655,962.43	431,252,846.94

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	76,573,434.00	23.55
	其中：股票	76,573,434.00	23.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	236,082,528.43	72.60
	其中：债券	236,082,528.43	72.60
	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	11,851,053.46	3.64
8	其他各项资产	671,358.36	0.21
9	合计	325,178,374.25	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	-	-
C	制造业	13,989,480.00	5.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,514,100.00	8.43
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,305,347.00	0.51
G	交通运输、仓储和邮政业	21,125,880.00	8.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,053,327.00	1.59
J	金融业	4,316,000.00	1.69
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	1,113,000.00	0.44
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	67,417,134.00	26.41

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

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	859,000.00	0.34
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	-	-
工业	3,746,500.00	1.47
信息技术	-	-
电信服务	4,550,800.00	1.78
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	9,156,300.00	3.59

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	001965	招商公路	600,000	7,116,000.00	2.79
2	600674	川投能源	270,000	5,062,500.00	1.98
3	600795	国电电力	800,000	4,792,000.00	1.88
4	600642	申能股份	520,000	4,591,600.00	1.80
5	603871	嘉友国际	252,000	4,457,880.00	1.75
6	600377	宁沪高速	350,000	4,410,000.00	1.73
7	600012	皖通高速	300,000	4,191,000.00	1.64
8	600863	内蒙华电	900,000	4,176,000.00	1.64
9	600309	万华化学	50,000	4,043,000.00	1.58
10	02057	中通快递-W	25,000	3,746,500.00	1.47
11	300433	蓝思科技	200,000	3,650,000.00	1.43
12	00700	腾讯控股	10,000	3,398,800.00	1.33
13	600900	长江电力	100,000	2,892,000.00	1.13
14	600718	东软集团	308,100	2,547,987.00	1.00
15	300088	长信科技	488,400	2,295,480.00	0.90
16	601881	中国银河	200,000	2,172,000.00	0.85
17	601878	浙商证券	200,000	2,144,000.00	0.84
18	601233	桐昆股份	100,000	1,596,000.00	0.63
19	002185	华天科技	180,000	1,467,000.00	0.57
20	002867	周大生	99,950	1,305,347.00	0.51
21	00552	中国通信服务	300,000	1,152,000.00	0.45
22	603099	长白山	50,000	1,113,000.00	0.44
23	300674	宇信科技	100,000	1,108,000.00	0.43
24	002928	华夏航空	150,000	951,000.00	0.37
25	002815	崇达技术	100,000	938,000.00	0.37
26	00322	康师傅控股	100,000	859,000.00	0.34
27	688256	寒武纪	2,000	397,340.00	0.16

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	001965	招商公路	6,586,548.00	1.45
2	002352	顺丰控股	6,140,371.00	1.35
3	600674	川投能源	4,894,844.00	1.08
4	02057	中通快递-W	4,321,051.76	0.95
5	000999	华润三九	4,233,052.00	0.93
6	600054	黄山旅游	4,130,061.00	0.91
7	600309	万华化学	3,645,298.00	0.80

8	600009	上海机场	3,605,284.00	0.79
9	00700	腾讯控股	3,386,739.16	0.74
10	603209	兴通股份	2,796,523.80	0.61
11	600426	华鲁恒升	2,578,736.00	0.57
12	002867	周大生	1,729,028.19	0.38
13	601233	桐昆股份	1,446,441.00	0.32
14	00552	中国通信服务	1,134,089.65	0.25
15	002928	华夏航空	1,100,623.00	0.24
16	603099	长白山	1,074,569.00	0.24
17	00322	康师傅控股	965,543.41	0.21
18	688256	寒武纪	348,098.33	0.08

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	601990	南京证券	13,216,293.00	2.91
2	601696	中银证券	8,510,069.00	1.87
3	000999	华润三九	7,661,528.00	1.68
4	002352	顺丰控股	5,879,314.00	1.29
5	600642	申能股份	5,632,017.00	1.24
6	600012	皖通高速	5,540,343.00	1.22
7	600377	宁沪高速	5,411,720.00	1.19
8	600900	长江电力	5,377,865.00	1.18
9	600795	国电电力	5,310,808.00	1.17
10	000709	河钢股份	4,913,000.00	1.08
11	600054	黄山旅游	4,219,445.00	0.93
12	600009	上海机场	3,663,793.00	0.81
13	603209	兴通股份	2,856,444.80	0.63
14	002957	科瑞技术	2,687,593.00	0.59
15	600426	华鲁恒升	2,438,726.00	0.54
16	000066	中国长城	2,434,273.00	0.54
17	002392	北京利尔	2,378,278.00	0.52
18	300348	长亮科技	2,286,590.00	0.50
19	601878	浙商证券	2,283,087.00	0.50
20	300590	移为通信	1,776,234.00	0.39

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	54,116,901.30
卖出股票收入（成交）总额	105,190,279.20

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	9,509,488.46	3.73
2	央行票据	-	-
3	金融债券	93,973,133.13	36.82
	其中：政策性金融债	30,239,699.75	11.85
4	企业债券	82,178,347.94	32.20
5	企业短期融资券	10,132,606.56	3.97
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	40,288,952.34	15.79
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	236,082,528.43	92.50

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	232280003	22 成都银行二级资本债 01	200,000	21,514,393.44	8.43
2	2221006	22 上海农商二级 01	200,000	21,014,616.99	8.23
3	240215	蓝星 YK04	200,000	20,670,372.60	8.10
4	137795	22 中色 01	200,000	20,523,961.64	8.04
5	184311	22 山高 03	200,000	20,248,936.99	7.93

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 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。

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

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。

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 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	74,129.24
2	应收清算款	500,000.00
3	应收股利	96,432.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	797.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	671,358.36

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	113632	鹤21转债	7,080,320.55	2.77
2	113060	浙22转债	5,004,094.25	1.96
3	113065	齐鲁转债	4,559,904.66	1.79
4	128136	立讯转债	4,453,762.60	1.75
5	110067	华安转债	4,436,597.26	1.74
6	113061	拓普转债	4,154,451.10	1.63

7	113623	凤21转债	2,476,923.29	0.97
8	113062	常银转债	2,447,067.40	0.96
9	127020	中金转债	2,408,967.12	0.94
10	127056	中特转债	2,186,770.96	0.86
11	113627	太平转债	1,080,093.15	0.42

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股票。

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

份额级别	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(%)
中邮悦享6个月持有期混合A	6,037	39,774.46	0.00	0.00	240,118,443.61	100.00
中邮悦享6个月持有期混合C	145	17,283.47	0.00	0.00	2,506,103.87	100.00
合计	6,182	39,246.93	0.00	0.00	242,624,547.48	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	中邮悦享6个月持有期混合A	19.98	0.00
	中邮悦享6个月持有期混合C	0.00	0.00
	合计	19.98	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情况

项目	份额级别	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	中邮悦享 6 个月持有期混合 A	0
	中邮悦享 6 个月持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中邮悦享 6 个月持有期混合 A	0
	中邮悦享 6 个月持有期混合 C	0
	合计	0

§ 9 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 A	中邮悦享 6 个月持有期混合 C
基金合同生效日 (2021 年 9 月 14 日) 基金份额总额	4,819,749,730.05	34,253,128.88
本报告期期初基金份额总额	445,901,510.14	4,304,050.38
本报告期基金总申购份额	760,564.30	33,590.20
减：本报告期基金总赎回份额	206,543,630.83	1,831,536.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	240,118,443.61	2,506,103.87

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未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

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员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 (%)	
兴业证券	1	93,773,346.34	58.86	88,556.91	64.32	-
长江证券	1	65,533,834.16	41.14	49,121.58	35.68	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

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

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。基金管理人与被选择的证券公司

签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。

2、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(%)
兴业证券	146,257,853.38	84.26	1,859,400,000.00	100.00	-	-
长江证券	27,320,946.41	15.74	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 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	中邮悦享 6 个月持有期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基金改聘会计师事务所公告	规定媒介	2024 年 01 月 30 日
3	中邮悦享 6 个月持有期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
4	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
5	中邮悦享 6 个月持有期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
6	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
7	中邮悦享 6 个月持有期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 26 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

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

中邮创业基金管理股份有限公司

2024年8月30日