

中邮创新优势灵活配置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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司（简称：农业银行）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	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
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	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	35
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	37

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	37
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	37
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	37
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	37
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	37
7.12 投资组合报告附注	37
§ 8 基金份额持有人信息	38
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	38
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	38
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	38
§ 9 开放式基金份额变动	38
§ 10 重大事件揭示	39
10.1 基金份额持有人大会决议	39
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	39
10.4 基金投资策略的改变	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	39
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	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	39
10.8 其他重大事件	40
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	42
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	42
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	42
§ 12 备查文件目录	42
12.1 备查文件目录	42
12.2 存放地点	42
12.3 查阅方式	42

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	中邮创新优势灵活配置混合
基金主代码	001275
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 7 月 23 日
基金管理人	中邮创业基金管理股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	120,914,803.78 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过合理的动态资产配置，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，充分挖掘和利用中国科技进步和创新过程中带来的投资机会，谋求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	<p>（一）大类资产配置策略</p> <p>本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>本基金主要投资于具有创新优势的上市公司。具有创新优势的公司通过提供差异性的甚至具有颠覆性的产品或服务为公司创造出广阔的蓝海市场，或者通过工艺流程的改进甚至变革明显提升性能或降低成本从而为公司带来优势的市场份额或者明显高于行业的盈利能力。因而，在市场表现中，能够为投资者带来较高的回报，这类企业是本基金重点投资对象。</p> <p>1、创新优势企业的筛选</p> <p>本基金所指的创新优势，包括技术创新优势和商业创新优势两种类型。技术创新优势是指企业创造和应用新知识和新技术，采用新工艺或新的生产方式，开发生产新产品，提供新的服务，提高产品质量、或降低产品成本，占据市场并实现市场价值的优势。商业创新优势是指企业通过商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等方面的创新，使企业的盈利能力和竞争实力得到持续改善的优势。</p> <p>（1）技术创新优势</p> <p>本基金将重点研究企业技术创新的竞争力及其市场前景，并对企业研发管理体系、研发规划、人才吸引力及激励制度进行分析</p> <p>1) 技术创新的竞争力分析：通过专家访谈、竞争对手调研、产业链上下游公司交流等手段，有效判断企业技术和产品创新的先进程度，被模仿的难易程度，从而有效判断企业技术创新优势的可持续性。</p>

2) 研发投入分析: 公司为保证技术领先地位, 应确保研发资金的规模和持续性; 同时, 确保人力资源投入与经费投入水平适当增长。对企业研发投入的评判, 所采用的主要量化指标包括: 研究开发费用占销售收入的比重, 近三年研究开发费用的规模以及增长情况等

3) 研发能力分析: 本基金从企业专利申请量、发明专利比重、拥有专利数量、专有技术、新产品推出周期等方面对企业的研发能力进行分析。

(2) 商业创新优势

本基金认为商业创新活动是一种节约人力和资本的活动, 即以更少的人力和资本投入取得更大的增长。本基金将辨识企业是否在商业模式、市场营销、管理体系、生产流程等商业行为方面有创新优势。本基金将重点分析商业创新优势的持续性, 分析企业的商业创新优势在商业模式的可复制性, 促进销售收入增长、市场份额增长、成本降低等方面的持续性。

对于传统产业的上市公司, 如果已在或正在管理制度、营销体系、技术开发和生产体系等方面进行创新, 具有较大潜在发展前景和经济效应, 也属于本基金的主要投资范围。

2、创新管理能力分析

对具有创新优势的某些企业而言, 尽管不断有创新活动, 却不能产生利润, 究其原因, 主要在于创新管理能力欠缺, 无法实现创新成果的商业价值。因此, 本基金将对企业的创新管理能力进行分析, 比如: 企业的技术前瞻能力、企业的技术管理能力(是否具有科学规范的研发管理体系、激励和人才培养机制)、企业创新与发展战略的匹配能力、企业的资源整合能力以及企业的市场开拓能力等; 通过市场份额增长、成本降低等各项具体指标对企业的创新管理能力进行评价。

3、创新优势企业产业链

本基金认为除上文所述的创新优势企业之外, 还可以将产业链中可以受益于创新优势企业成长和发展的上下游优秀的上市公司也纳入本基金股票库。这类上市公司虽然分布在创新优势企业的产业链上下游, 但他们将受益于为创新优势企业提供原材料或者应用创新优势企业的新技术新模式获得利润。

(四) 债券投资策略

在债券投资部分, 本基金在债券组合平均久期、期限结构和类属配置的基础上, 对影响个别债券定价的主要因素, 包括流动性、市场供求、信用风险、票息及付息频率、税赋、含权等因素进行分析, 选择具有良好投资价值的债券品种进行投资。

(五) 权证投资策略

本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易, 控制基金组合风险, 获取超额收益。本基金进行权证投资时, 将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上, 结合股价波动率等参数, 运用数量化期权定价模型, 确定其合理内在价值, 从而构建套利交易或避险交易组合。未来, 随着证券市场的发展、金融工具的丰富和交易方式的创新等, 基金还将积极寻求其他投资机会, 履行适当程序后更新和丰富组合投资策略。

	<p>（六）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，提高投资组合的运作效率。</p> <p>（七）中小企业私募债券投资策略</p> <p>中小企业私募债是指中小微型企业在中国境内以非公开方式发行和转让，约定在一定期限还本付息的公司债券。与传统的信用债相比，中小企业私募债具有高风险和高收益的显著特点。</p> <p>目前市场上正在或即将发行的中小企业私募债的期限通常都在三年以下，久期风险较低；其风险点主要集中在信用和流通性。由于发行规模都较小，这在一定程度上决定了其二级市场的流通性有限，换手率不高，所以本基金在涉及中小企业私募债投资时，会将重点放在一级市场，在有效规避信用风险的同时获取信用利差大的个券，并持有到期。</p> <p>对单个券种的分析判断与其它信用类固定收益品种的方法类似。在信用研究方面，本基金将加强自下而上的分析，将机构评级与内部评级相结合，着重通过发行方的财务状况、信用背景、经营能力、行业前景、个体竞争力等方面判断其在期限内的偿付能力，尽可能对发行人进行充分详尽地调研和分析；会倾向于大券商承销的有上市诉求的企业。鉴于其信用风险大，流通性弱，本基金将严格防范风险。所有中小企业私募债在投资前都必须实地调研，研究报告由研究员双人会签，并对投资比例有严格控制。重大投资决策需上报投资委员会。</p> <p>（八）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数×60%+上证国债指数×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中的中等风险品种。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中邮创业基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	侯玉春	任航
	联系电话	010-82295160—157	010-66060069
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		010-58511618	95599
传真		010-82295155	010-68121816
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市东城区建国门内大街 69 号

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-203,300.74
本期利润	-1,723,431.34
加权平均基金份额本期利润	-0.0146
本期加权平均净值利润率	-1.67%
本期基金份额净值增长率	-1.41%
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	-10,660,940.29
期末可供分配基金份额利润	-0.0882
期末基金资产净值	110,253,863.49
期末基金份额净值	0.912
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	-8.80%

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

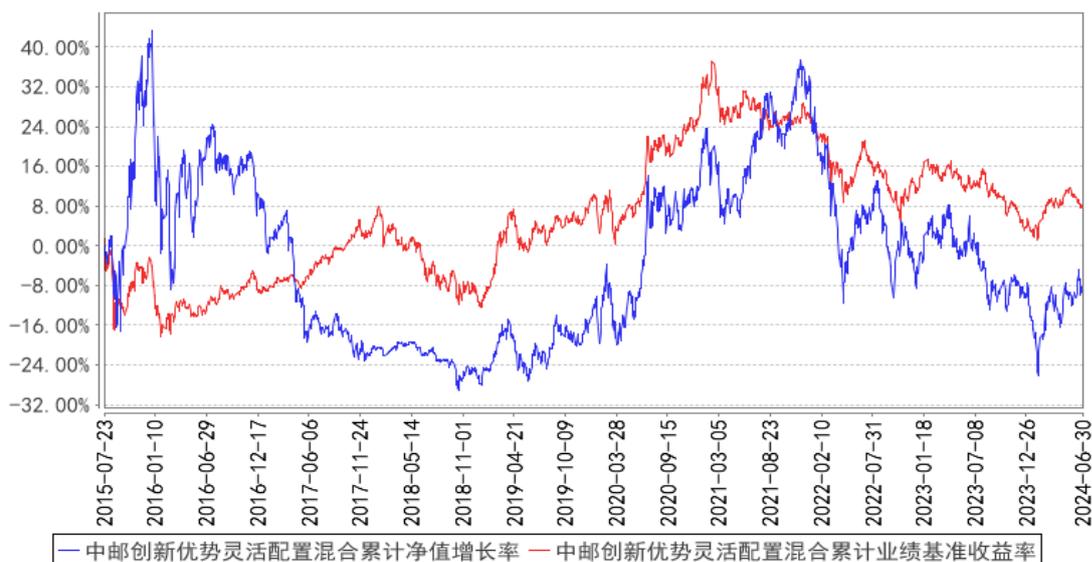
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.24%	1.08%	-1.72%	0.29%	3.96%	0.79%
过去三个月	3.28%	1.27%	-0.49%	0.45%	3.77%	0.82%
过去六个月	-1.41%	1.53%	2.22%	0.53%	-3.63%	1.00%
过去一年	-9.88%	1.32%	-3.78%	0.52%	-6.10%	0.80%

过去三年	-25.55%	1.39%	-16.70%	0.63%	-8.85%	0.76%
自基金合同生效起至今	-8.80%	1.54%	7.86%	0.77%	-16.66%	0.77%

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

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

中邮创新优势灵活配置混合累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 07 月 23 日。按照基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司成立于 2006 年 5 月 8 日，截至 2024 年 6 月 30 日，本公司共管理 55 只开放式基金产品，分别为中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮核心成长混合型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、中邮中证 500 指数增强型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮核心竞争力灵活配置混合型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮核心科技灵活配置混合型证

券投资基金、中邮趋势精选灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮信息产业灵活配置混合型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金、中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置混合型证券投资基金、中邮低碳经济灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮健康文娱灵活配置混合型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮未来成长混合型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、中邮鑫溢中短债债券型证券投资基金、中邮兴荣价值一年持有期混合型证券投资基金、中邮能源革新混合型发起式证券投资基金、中邮睿泽一年持有期债券型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金、中邮专精特新一年持有期混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李沐曦	本基金的基金经理	2023 年 5 月 11 日	-	7 年	理学硕士。曾任美国微软公司数据科学家、华夏基金管理有限公司科技行业研究员、昆仑万维科技股份有限公司基金经理、中邮创业基金管理股份有限公司基金经理助理。现任中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：基金经理的任职日期及离任日期均依据基金成立日期或中国证券投资基金业协会下发的《关于基金经理注册通知》、《关于基金经理变更通知》、《关于基金经理注销通知》日期。

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

2024 年上半年，市场经历了极度悲观、政策呵护、经济修复预期抬升并再次证伪的过程，进入二季度后，经济数据持续走弱，对进一步政策释放的预期也较弱，使得市场表现再次陷入疲软。5 月地产政策的放松带来了房地产交易数据的暂时性回升，但参照历史经验，距离真正的企稳尚需时间，并且虽然房贷利率有所下降，但绝对水平角度仍然偏高，作为投资者仍然需要保持耐心。

选股角度，中邮创新优势组合持仓中的人工智能行业相关持仓，如沪电股份、生益科技等，在 2024 年上半年表现亮眼，获得了较多的相对收益。苹果手机链的相关标的也有不俗表现，例如立讯精密等，主要受益于苹果公司手机 AI 工具的发布，投资者看好其对手机销量的带动作用。汽

车产业链相关个股表现平淡，主要受中国市场汽车价格战、欧洲对中国汽车出口加关税、特斯拉销量不及预期等事件影响。

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 0.912 元, 累计净值为 0.912 元; 本报告期基金份额净值增长率为-1.41%, 业绩比较基准收益率为 2.22%。

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，宏观层面比较乐观的方面是领导人对于经济修复明显更加重视，已经出台了不少针对宏观经济的刺激政策，预计未来仍有加码空间。但不可否认的是，现实经济的修复速度确实比较慢，企业、居民信心整体较弱，宏观刺激政策至今并未展现出明显效果，距离经济的明显修复还存在较大距离，我们仍然需要保持耐心。

行业角度，我们依然坚持持有 AI 产业相关公司，英伟达将在下半年出货新一代 GPU 产品，预计行业景气度仍可持续。苹果产业链公司经过一轮上涨，估值得以修复，进一步上涨需要看到出货量的真实提升，但由于相关公司的估值依然不高，我们选择继续持有。汽车产业链相关公司受到下游车企内卷、欧洲关税增加的影响，年初至今表现欠佳，但中国制造业的优势是确定的，行业替代的趋势是确定的，欧洲加关税等事件只是这一趋势中的波折，会延缓趋势的发生，但并不影响趋势的走向。我们相信随着汽车产业链公司针对国际形势完成相关业务调整，其全球替代趋势还是可以在业绩与股价中体现出来。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——中邮创业基金管理股份有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中邮创新优势灵活配置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	15,295,355.59	28,524,836.55
结算备付金		33,756.35	115,510.35
存出保证金		13,874.50	47,074.97
交易性金融资产	6.4.7.2	95,345,718.67	81,772,758.86
其中：股票投资		95,345,718.67	81,772,758.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-

资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		17,556.35	3,217.30
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		110,706,261.46	110,463,398.03
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,598.42	29,248.21
应付管理人报酬		106,133.17	110,069.59
应付托管费		17,688.84	18,344.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	324,977.54	450,982.78
负债合计		452,397.97	608,645.51
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	120,914,803.78	118,752,367.57
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-10,660,940.29	-8,897,615.05
净资产合计		110,253,863.49	109,854,752.52
负债和净资产总计		110,706,261.46	110,463,398.03

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.912 元，基金份额总额 120,914,803.78 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮创新优势灵活配置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		-921,357.44	8,900,693.71
1. 利息收入		112,474.27	195,971.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	112,474.27	195,971.40
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		482,308.86	-1,036,902.36
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-653,891.57	-1,472,039.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,136,200.43	435,137.02
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	-1,520,130.60	9,738,485.26
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	3,990.03	3,139.41
减：二、营业总支出		802,073.90	1,102,374.10
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	615,740.86	840,665.15
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	102,623.54	140,110.85
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	83,709.50	121,598.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,723,431.34	7,798,319.61
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,723,431.34	7,798,319.61
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,723,431.34	7,798,319.61

6.3 净资产变动表

会计主体：中邮创新优势灵活配置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	118,752,367.57	-	-8,897,615.05	109,854,752.52
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	118,752,367.57	-	-8,897,615.05	109,854,752.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,162,436.21	-	-1,763,325.24	399,110.97
（一）、综合收益总额	-	-	-1,723,431.34	-1,723,431.34
（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）	2,162,436.21	-	-39,893.90	2,122,542.31
其中：1. 基金申购款	7,375,601.26	-	-644,965.86	6,730,635.40
2. 基金赎回	-5,213,165.05	-	605,071.96	-4,608,093.09

回款				
(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	120,914,803.78	-	-10,660,940.29	110,253,863.49
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	111,911,308.75	-	-6,384,039.71	105,527,269.04
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	111,911,308.75	-	-6,384,039.71	105,527,269.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,726,408.55	-	7,737,916.70	5,011,508.15
(一)、综合收益总额	-	-	7,798,319.61	7,798,319.61
(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)	-2,726,408.55	-	-60,402.91	-2,786,811.46
其中：1. 基金申购款	2,382,685.16	-	47,668.70	2,430,353.86
2. 基金赎回款	-5,109,093.71	-	-108,071.61	-5,217,165.32
(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	109,184,900.20	-	1,353,876.99	110,538,777.19

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>张志名</u>	<u>李小振</u>	<u>佟姍</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可〔2015〕682号《关于核准中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》核准，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》发起，并于2015年7月23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807,996,396.11元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2015)第110ZC0324号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、可转换债券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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：本基金股票投资占基金资产的比例为0%~95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%~100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为0%~3%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后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%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基

金资产净值的 10%。

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基金净值变动等有关信息。

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、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

无。

6.4.6 税项

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

1. 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入及基金取得的以下利息收入免

征增值税：a) 同业存款；b) 买入返售金融资产（质押式、买断式）；c) 国债、地方政府债；d) 金融债券。

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

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

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

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

4. 基金卖出股票缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	15,295,355.59
等于：本金	15,289,953.84
加：应计利息	5,401.75
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	15,295,355.59

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	96,246,485.41	-	95,345,718.67	-900,766.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	96,246,485.41	-	95,345,718.67	-900,766.74

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

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告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 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	1,326.68
其中：交易所市场	1,326.68
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	323,650.86
合计	324,977.54

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	118,752,367.57	118,752,367.57
本期申购	7,375,601.26	7,375,601.26
本期赎回（以“-”号填列）	-5,213,165.05	-5,213,165.05
本期末	120,914,803.78	120,914,803.78

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

无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年	6,405,440.88	-15,303,055.93	-8,897,615.05

度末			
加： 会计 政策 变更	-	-	-
前 期差 错更 正	-	-	-
其他	-	-	-
本期 期初	6,405,440.88	-15,303,055.93	-8,897,615.05
本期 利润	-203,300.74	-1,520,130.60	-1,723,431.34
本期 基金 份额 交易 产生 的变 动数	113,741.72	-153,635.62	-39,893.90
其 中： 基金 申购 款	347,425.72	-992,391.58	-644,965.86
金赎 回款	-233,684.00	838,755.96	605,071.96
本期 已分 配利 润	-	-	-
本期 末	6,315,881.86	-16,976,822.15	-10,660,940.29

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	111,801.15
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	445.33

其他	227.79
合计	112,474.27

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	-653,891.57
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	-653,891.57

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	12,022,521.87
减：卖出股票成本总额	12,630,258.76
减：交易费用	46,154.68
买卖股票差价收入	-653,891.57

6.4.7.15 债券投资收益

本报告期间，本基金无债券投资。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本期本基金无资产支持证券投资。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本期本基金无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

本期本基金无衍生工具。

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	1,136,200.43
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	1,136,200.43

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	-1,520,130.60
股票投资	-1,520,130.60
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-1,520,130.60

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	3,990.03
合计	3,990.03

注：本基金赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。本基金赎回费率最高不超过赎回金额的5%，随持有期限的增加而递减。赎回费用由赎回基金份额持有人承担，对持续持有期少于7日（不含7日）的投资人收取不低于1.5%的赎回费，对持续持有期长于7日（含7日）但少于30日（不含30日）的投资人收取不低于0.75%的赎回费，并将上述赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于30日（含30日）但少于93日（不含93日）的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的75%计入基金财产；对持续持有期长于93日（含93日）但少于186日（不含186日）的投资人收取不低于0.5%的赎回费，并将不低于赎回费总额的50%计入基金财产；对持续持有期长于186日（含186日）的投资人，应当将不低于赎回费总额的25%计入基金财产。其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	23,869.30
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行结算费用	1,458.64
上清所债券账户维护费	9,600.00
中债债券账户维护费	9,000.00
合计	83,709.50

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，本基金无须作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
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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	615,740.86	840,665.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	276,633.65	376,530.52
应支付基金管理人的净管理费	339,107.21	464,134.63

注：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的 1.20% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	102,623.54	140,110.85

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值的 0.20% 计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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
中国农业银行股份有限公司	15,295,355.59	111,801.15	32,298,485.17	193,719.08

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在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本期本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本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

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內。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的信用风险状况进行评级，并对交易对手设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金在报告期内的运作过程中未发生过流动性风险情况。在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于基金合同约定的具有良好流动性的金融工具。公司每日跟踪监测本基金持有资产的交易量、持仓集中度、流通受限资产占比、可流通资产变现天数、7 日可变现资产比例、信用债券和逆回购质押券最新主体及债项评级、利率债券组合久期、基金杠杆率等涉及资产流动性风险的指标，并设置合理有效的风控阈值进行持续监测。

在负债端，基金管理人详细分析本基金投资者类型、投资者结构、投资者风险偏好和历史申购与赎回数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者赎回需求，制定了健全有效的流动性风险压力测试方法。当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整基金投资策略，预留充足现金头寸、确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如遇到极端市场情形或发生巨额赎回情形，基金管理人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	15,289,953.84	-	-	5,401.75	15,295,355.59
结算备付金	33,756.35	-	-	-	33,756.35
存出保证金	13,868.83	-	-	5.67	13,874.50
交易性金融资产	-	-	-	95,345,718.67	95,345,718.67
应收申购款	-	-	-	17,556.35	17,556.35
资产总计	15,337,579.02	-	-	95,368,682.44	110,706,261.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,598.42	3,598.42
应付管理人报酬	-	-	-	106,133.17	106,133.17
应付托管费	-	-	-	17,688.84	17,688.84
其他负债	-	-	-	324,977.54	324,977.54
负债总计	-	-	-	452,397.97	452,397.97
利率敏感度缺口	15,337,579.02	-	-	94,916,284.47	110,253,863.49
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	28,511,377.22	-	-	13,459.33	28,524,836.55
结算备付金	115,473.55	-	-	36.80	115,510.35

存出保证金	47,053.77	-	-	21.20	47,074.97
交易性金融资产	-	-	-	81,772,758.86	81,772,758.86
应收申购款	-	-	-	3,217.30	3,217.30
资产总计	28,673,904.54	-	-	81,789,493.49	110,463,398.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,248.21	29,248.21
应付管理人报酬	-	-	-	110,069.59	110,069.59
应付托管费	-	-	-	18,344.93	18,344.93
其他负债	-	-	-	450,982.78	450,982.78
负债总计	-	-	-	608,645.51	608,645.51
利率敏感度缺口	28,673,904.54	-	-	81,180,847.98	109,854,752.52

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 其他价格风险

市场价格风险

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债券）、可转换债券、银行存款、货币市场工具、权证、股指期货、资产支持证券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）。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：本基金股票投资占基金资产的比例为0%~95%，投资于债券、银行存款、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%~100%，其中权证投资占基金资产净值的比例为0%~3%；扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后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%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等；本基金持有的单只中小企业私募债券，其市值不得超过基金资产净值的10%。本基金参与股指期货交易，应符合法律法规规定和基金合同约定的投资限制

并遵守相关期货交易所的业务规则。

于 2024 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 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	95,345,718.67	86.48	81,772,758.86	74.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	95,345,718.67	86.48	81,772,758.86	74.44

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量，当本基金基准上升 1%		
	固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	基金净资产变动	2,040,285.50	1,095,191.52
基金净资产变动	-2,040,285.50	-1,095,191.52	

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 2.14。

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	95,345,718.67	81,772,758.86
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	95,345,718.67	81,772,758.86

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	95,345,718.67	86.12
	其中：股票	95,345,718.67	86.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	15,329,111.94	13.85
8	其他各项资产	31,430.85	0.03
9	合计	110,706,261.46	100.00

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	92,488,434.67	83.89
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	-	-
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	2,857,284.00	2.59
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	95,345,718.67	86.48

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投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002463	沪电股份	285,000	10,402,500.00	9.44
2	002475	立讯精密	218,400	8,585,304.00	7.79
3	002415	海康威视	230,000	7,109,300.00	6.45
4	600183	生益科技	275,000	5,791,500.00	5.25
5	300661	圣邦股份	66,140	5,475,069.20	4.97
6	603997	继峰股份	458,300	4,688,409.00	4.25
7	002916	深南电路	37,900	4,008,683.00	3.64
8	000100	TCL 科技	870,000	3,758,400.00	3.41
9	600584	长电科技	115,100	3,649,821.00	3.31
10	300408	三环集团	116,000	3,386,040.00	3.07
11	002920	德赛西威	37,500	3,265,875.00	2.96
12	002674	兴业科技	308,700	3,154,914.00	2.86
13	601689	拓普集团	58,000	3,109,380.00	2.82
14	000725	京东方 A	734,900	3,005,741.00	2.73
15	688052	纳芯微	27,800	2,857,284.00	2.59
16	603179	新泉股份	68,205	2,676,364.20	2.43
17	300990	同飞股份	93,300	2,622,663.00	2.38
18	002859	洁美科技	130,200	2,614,416.00	2.37
19	300782	卓胜微	30,500	2,371,070.00	2.15
20	688008	澜起科技	40,768	2,330,298.88	2.11
21	300628	亿联网络	60,697	2,231,828.69	2.02
22	603296	华勤技术	39,760	2,195,944.80	1.99
23	688378	奥来德	60,315	1,414,989.90	1.28
24	603786	科博达	16,100	1,032,815.00	0.94
25	300760	迈瑞医疗	3,400	989,094.00	0.90
26	688376	美埃科技	28,900	906,304.00	0.82
27	002906	华阳集团	29,000	776,040.00	0.70
28	300545	联得装备	21,000	515,550.00	0.47
29	301589	诺瓦星云	2,160	420,120.00	0.38

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	688052	纳芯微	5,181,590.67	4.72
2	600183	生益科技	5,156,845.00	4.69
3	300782	卓胜微	3,513,274.00	3.20
4	603296	华勤技术	2,720,398.24	2.48
5	601689	拓普集团	2,090,102.00	1.90
6	688376	美埃科技	1,099,662.74	1.00
7	301489	思泉新材	1,093,504.50	1.00
8	603786	科博达	1,001,736.00	0.91
9	300760	迈瑞医疗	1,001,360.00	0.91
10	300545	联得装备	968,538.00	0.88
11	002920	德赛西威	837,861.00	0.76
12	603997	继峰股份	746,715.00	0.68
13	002674	兴业科技	548,590.00	0.50
14	301589	诺瓦星云	529,197.00	0.48
15	688008	澜起科技	512,854.02	0.47
16	002415	海康威视	498,825.00	0.45
17	300661	圣邦股份	222,296.00	0.20

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	002463	沪电股份	4,235,251.50	3.86
2	688052	纳芯微	1,754,986.37	1.60
3	300990	同飞股份	1,209,066.00	1.10
4	002920	德赛西威	951,247.00	0.87
5	600183	生益科技	834,221.00	0.76
6	601689	拓普集团	693,001.00	0.63
7	301489	思泉新材	584,396.00	0.53
8	300628	亿联网络	533,600.00	0.49
9	603296	华勤技术	446,271.00	0.41
10	300545	联得装备	425,250.00	0.39
11	300782	卓胜微	355,232.00	0.32

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	27,723,349.17
卖出股票收入（成交）总额	12,022,521.87

注：买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相

关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本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

本报告期末本基金未持有股指期货。

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

本报告期末本基金未持有国债期货。

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	13,874.50
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	17,556.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,430.85

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)
5,608	21,561.13	39,352.93	0.03	120,875,450.85	99.97

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	88,087.12	0.07

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

注：无。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2015 年 7 月 23 日) 基金份额总额	807,996,396.11
本报告期期初基金份额总额	118,752,367.57
本报告期基金总申购份额	7,375,601.26

减：本报告期基金总赎回份额	5,213,165.05
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	120,914,803.78

§ 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

本基金管理人、托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

报告期内，本基金托管人及其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 (%)	
中信建投证券	1	22,238,383.04	55.95	21,035.47	55.95	-
兴业证券	1	17,507,488.00	44.05	16,560.13	44.05	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	中邮创新优势灵活配置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	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在华泰证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024 年 01 月 30 日
4	中邮创业基金管理股份有限公司关于基金经理休假期间由他人代为履职的公告	规定媒介	2024 年 03 月 12 日
5	中邮创新优势灵活配置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
6	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
7	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在中国中金财富证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2024 年 04 月 16 日
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加光大证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2024 年 04 月 17 日
9	中邮创新优势灵活配置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
10	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
11	中邮创业基金管理股份有限公司关于在兴业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定媒介	2024 年 05 月 17 日
12	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在东兴证券股份有限公司开通定投业务并调整其申购及定投起点金额、最低赎回份额、最低持有份额的公告	规定媒介	2024 年 05 月 29 日
13	中邮创新优势灵活配置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 24 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创新优势灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮创新优势灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在规定媒介上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：www.postfund.com.cn

中邮创业基金管理股份有限公司

2024 年 8 月 30 日