

# 中邮未来成长混合型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 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：浙商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人浙商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 27 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。

本报告财务资料已经审计，致同会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</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.....	11
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	15
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>16</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	18
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.....	19
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	21
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	21
4.10 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.....	21
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>22</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	22
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.....	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	22
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>23</b>
6.1 审计报告基本信息.....	23
6.2 审计报告的基本内容.....	23
<b>§7 年度财务报表</b> .....	<b>26</b>
7.1 资产负债表.....	26
7.2 利润表.....	27
7.3 净资产变动表.....	28
7.4 报表附注.....	30
<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>59</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 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.....	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81

8.6 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 .....	81
8.7 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 .....	81
8.8 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 .....	81
8.9 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 .....	81
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	82
8.12 投资组合报告附注 .....	82
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>83</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
9.3 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 .....	83
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	错误！未定义书签。
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>84</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>85</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	85
11.2 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 .....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
11.4 基金投资策略的改变 .....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	85
11.8 其他重大事件 .....	86
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>90</b>
12.1 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 .....	90
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>91</b>
13.1 备查文件目录 .....	91
13.2 存放地点 .....	91
13.3 查阅方式 .....	91

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮未来成长混合型证券投资基金	
基金简称	中邮未来成长混合	
基金主代码	010447	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 4 月 8 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	浙商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	568,618,470.78 份	
下属分级基金的基金简称:	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C
下属分级基金的交易代码:	010447	010448
报告期末下属分级基金的份额总额	245,476,487.09 份	323,141,983.69 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于未来成长主题相关股票，通过精选个股和风险控制，力争实现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>1、未来成长主题的界定</p> <p>我国经济正处于历史发展的新阶段，过去经济增长主要依赖人口红利、地产基建等支撑，未来增长更多的将源自科技、消费等产业革命带来的新成长动能。本基金将重点投资受益于新经济主题的具有成长优势、竞争优势且估值合理的上市公司，更好地分享未来中国经济健康稳定发展的成果。本基金定义的未来成长指：未来在中国经济转型中提供可持续成长动能的产业，具体行业和领域包括：</p> <p>(1) 新科技、新技术领域：计算机、电子、通信、医药生物等</p> <p>(2) 新制造、新产品领域：国防军工、机械设备、新能源、新材料等；</p> <p>(3) 新消费、新服务领域：传媒、消费者服务、食品饮料、家用电器、交通运输和金融等。</p> <p>2、行业配置策略</p> <p>本基金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>对于国家宏观经济运行过程中产生的阶段性焦点行业，本基金通过对经济运行</p>

	<p>周期、行业竞争态势以及国家产业政策调整等影响行业短期运行情况的因素进行分析和研究，筛选具有短期重点发展趋势的行业资产进行配置，并依据上述因素的短期变化对行业配置权重进行动态调整。</p> <p>3、个股投资策略</p> <p>本基金管理人通过定量及定性分析，筛选出未来成长主题领域的优质上市公司进行投资：</p> <p>（1）定性分析</p> <p>1) 公司的战略：考察公司是否具备合理、清晰、可行性强且符合国家政策导向的发展战略；</p> <p>2) 公司的竞争优势：考察公司在技术、产品、营销渠道及议价能力等方面的优势；</p> <p>3) 公司的业务模式：考察公司的业务模式是否具备可持续性和不可复制性；考察公司的业务模式是否能带来持续的盈利及业绩的快速增长；</p> <p>4) 公司的治理：考察公司的管理层是否经验丰富，团结高效。</p> <p>（2）定量分析</p> <p>1) 成长性指标：主营业务收入增长率、净利润增长率等；</p> <p>2) 财务指标：毛利率、净利率、净资产收益率等；</p> <p>3) 估值指标：市盈率、市净率、市销率等。</p> <p>（三）港股通标的股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>（四）债券投资策略</p> <p>1、一般债券投资策略</p> <p>结合对未来市场利率预期运用久期调整策略、收益率曲线配置策略、债券类属配置策略、利差轮动策略等多种积极管理策略，通过严谨的研究发现价值被低估的债券和市场投资机会，构建收益稳定、流动性良好的债券组合。</p> <p>2、可转换公司债券投资策略</p> <p>本基金将着重对可转债对应的基础股票进行分析与研究，对那些有着较好盈利能力或成长前景的上市公司的可转债进行重点选择，并在对应可转债估值合理的前提下集中投资，以分享正股上涨带来的收益。</p> <p>（五）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> <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>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×60%+中债综合全价指数收益率×35%+恒生综合指数收益率(经汇率估值调整)×5%</p>
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>

	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 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	浙商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春	朱巍
	联系电话	010-82295160—157	0571-87659806
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	zhuwei@czbank.com
客户服务电话		010-58511618	95527
传真		010-82295155	0571-88268688
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	杭州市萧山区鸿宁路 1788 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	杭州市拱墅区环城西路 76 号
邮政编码		100013	310006
法定代表人		毕劲松	陆建强

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.postfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	致同会计师事务所(特殊普通合伙)	中国北京朝阳区建国门外大街 22 号 赛特广场 5 层
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2023 年		2022 年		2021 年 4 月 8 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日	
	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C
本期已实现收益	7,229,732.19	7,463,336.50	-2,679,445.54	-829,287.44	2,829,210.16	971,837.44
本期利润	3,618,617.45	-16,601,193.37	-4,861,039.09	-1,144,008.30	2,500,986.25	1,613,756.83
加权平均基金份额本期利润	0.0252	-0.0702	-0.0977	-0.1475	0.0512	0.0468
本期加权平均	2.35%	-6.48%	-11.05%	-16.68%	4.85%	4.46%



净值利润率						
本期基金份额净值增长率	18.86%	18.62%	-13.98%	-14.19%	4.48%	4.27%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
期末可供分配利润	16,745,765.75	19,821,655.29	-5,435,494.73	-739,077.11	1,839,003.26	336,331.65
期末可供分配基金份额利润	0.0682	0.0613	-0.1013	-0.1053	0.0448	0.0427

期末基金资产净值	262,222,252.84	342,963,638.98	48,244,168.75	6,282,141.97	42,899,790.69	8,205,280.68
期末基金份额净值	1.0682	1.0613	0.8987	0.8947	1.0448	1.0427
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
基金份额累计净值增长率	6.82%	6.13%	-10.13%	-10.53%	4.48%	4.27%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生额）。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中邮未来成长混合 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
过去三个月	-0.95%	0.96%	-4.21%	0.52%	3.26%	0.44%
过去六个月	-3.25%	0.91%	-6.71%	0.56%	3.46%	0.35%
过去一年	18.86%	0.92%	-6.71%	0.55%	25.57%	0.37%
自基金合同生效起至今	6.82%	1.20%	-21.08%	0.70%	27.90%	0.50%

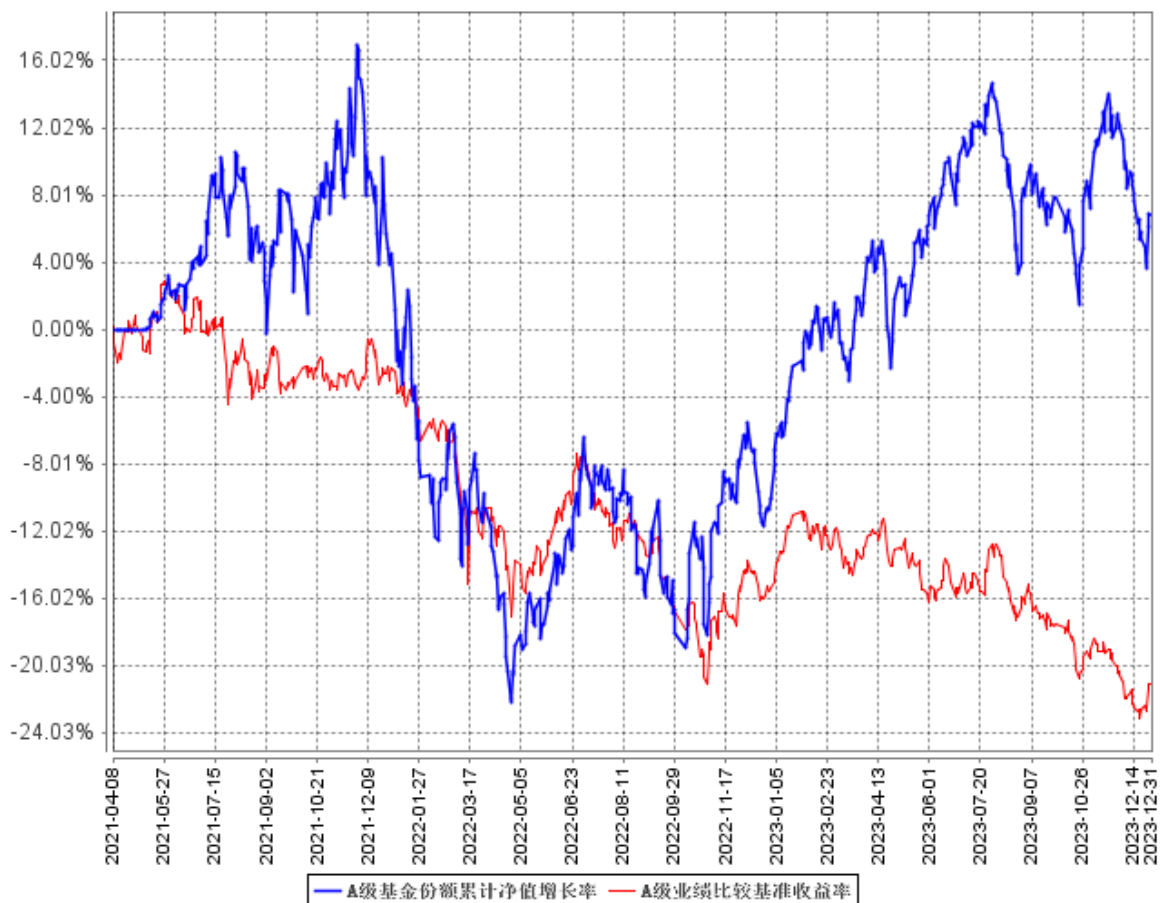
中邮未来成长混合 C

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
过去三个月	-1.01%	0.96%	-4.21%	0.52%	3.20%	0.44%
过去六个月	-3.38%	0.91%	-6.71%	0.56%	3.33%	0.35%
过去一年	18.62%	0.92%	-6.71%	0.55%	25.33%	0.37%
自基金合同生效起至今	6.13%	1.20%	-21.08%	0.70%	27.21%	0.50%

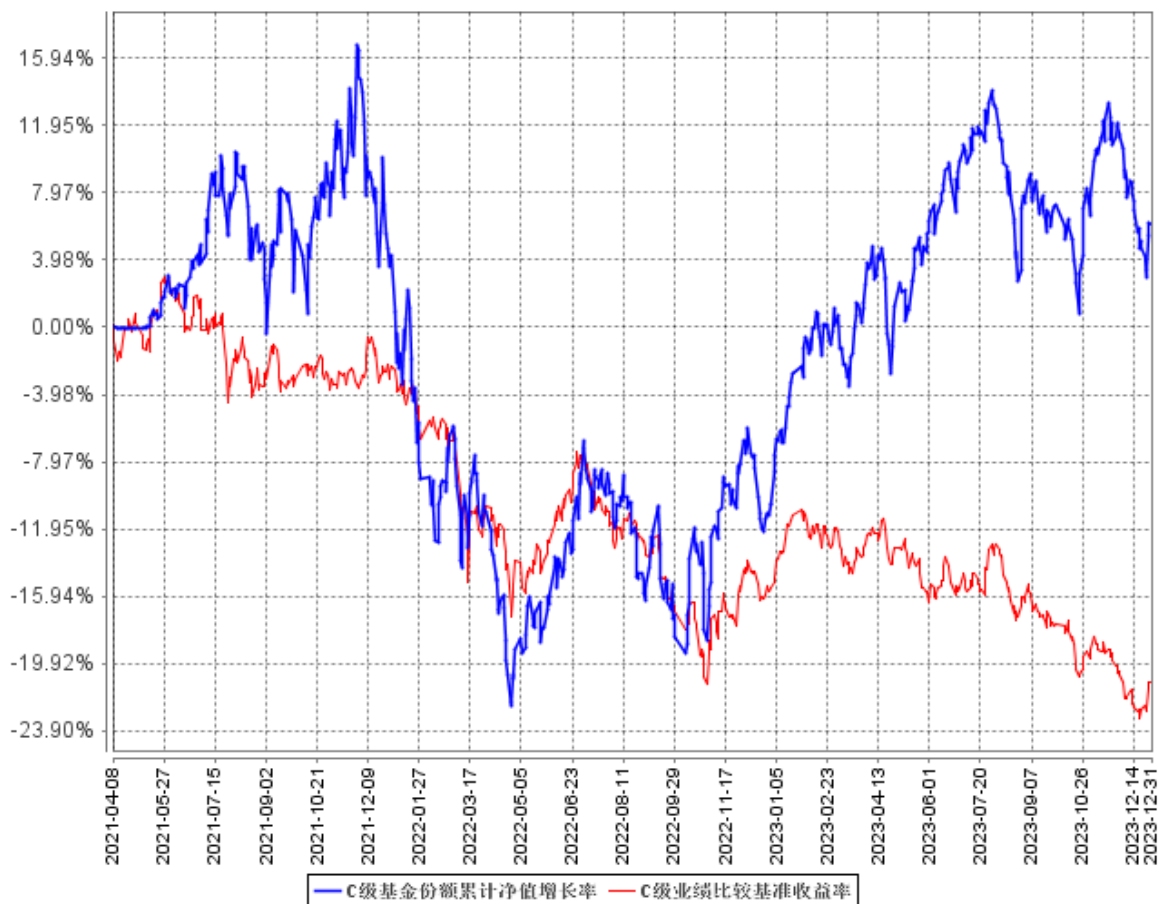
注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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

A级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

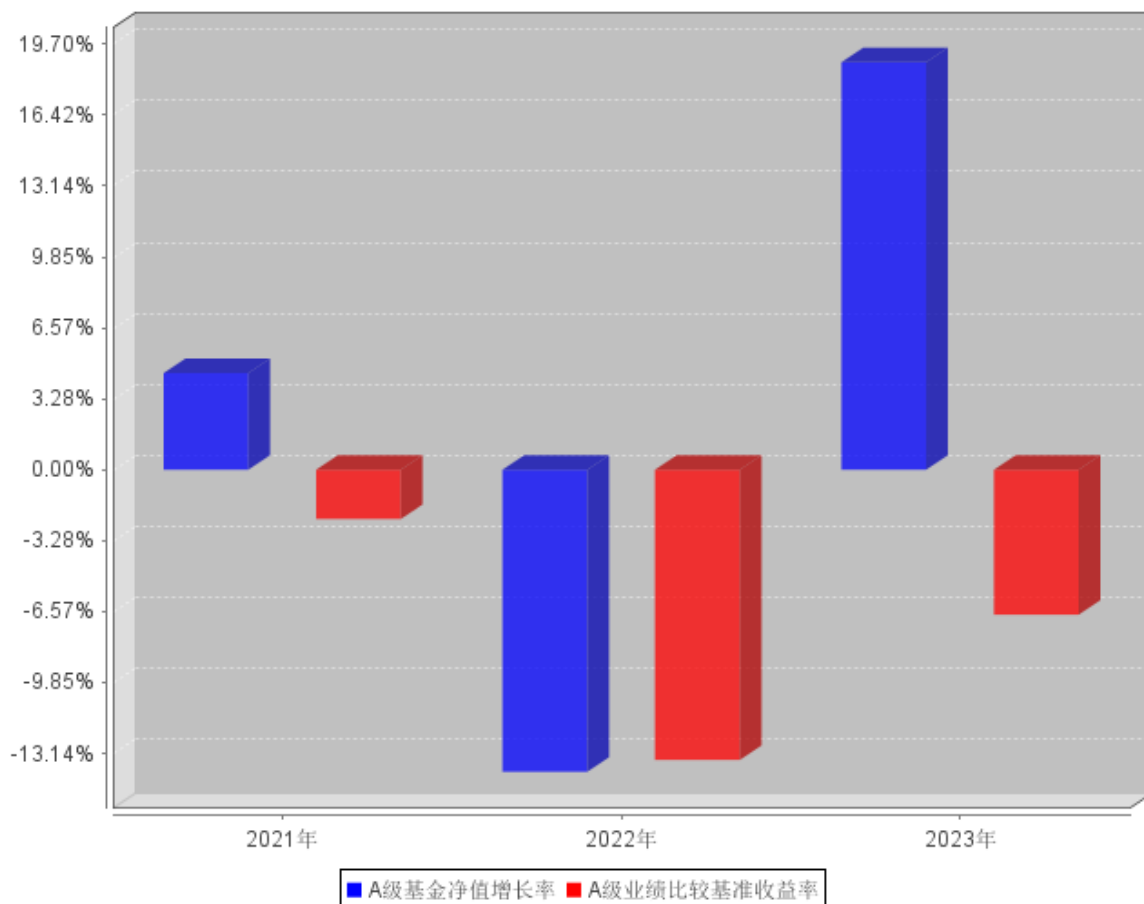


C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

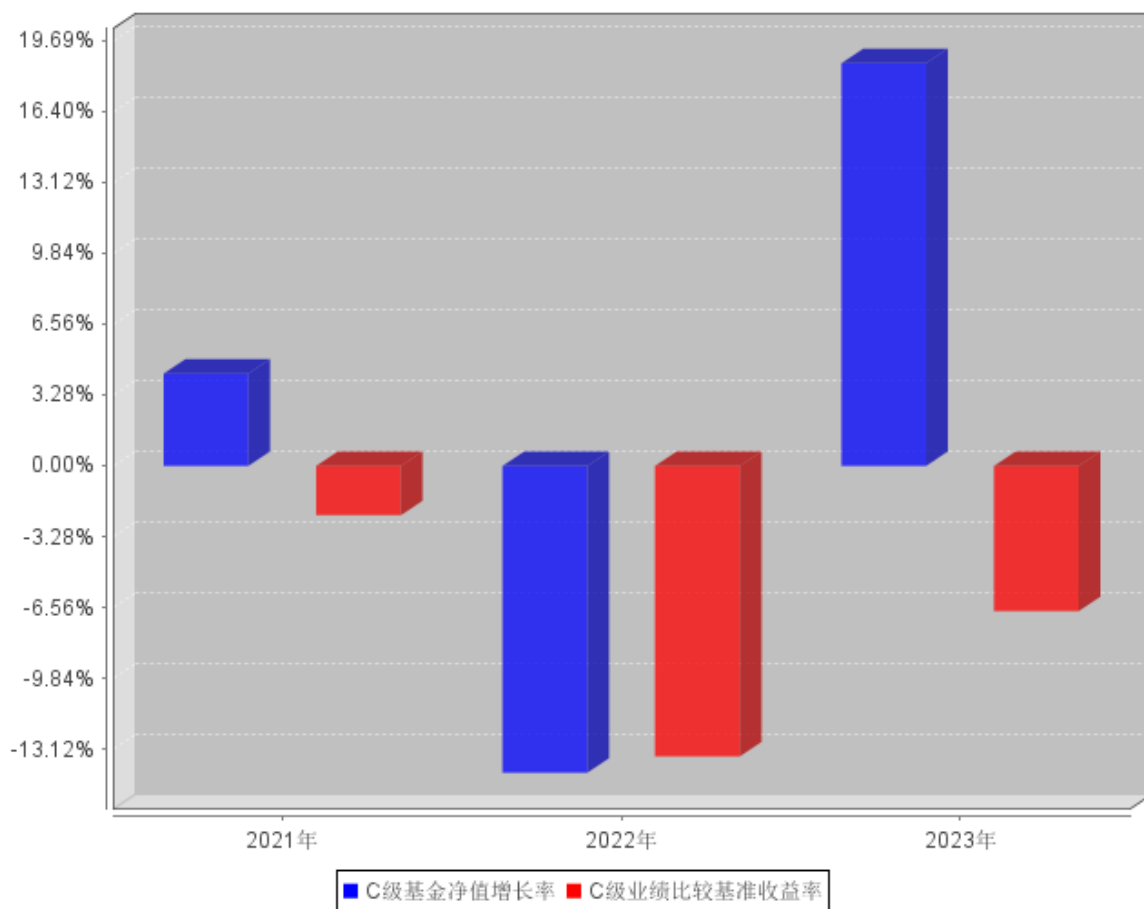


### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金未实施利润分配。

## § 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 12 月 31 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		
金振振	基金经理	2022 年 8 月 22 日	-	8 年	理学硕士。曾任中邮创业基金管理股份有限公司研究员、中邮核心成长混合型证券投资基金基金经理助理、中邮新思路灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中邮研究精选混合型证券投资基金基金经理助理、中邮未来新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金经理助理、中邮科技创新精选混合型证券投资基金基金经理助理、中邮医药健康灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮未来成长混合型证券投资基金基金经理。

#### 4.1.3 基金经理薪酬机制

公司用职级职等管理办法作为薪酬管理机制，根据员工不同的工作内容及工作表现，设立不同序列、不同职级以及不同职等。基金经理作为公司运营的核心，设立单独职级序列。基金经理薪酬严格按照职级职等管理办法进行管理。

#### 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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规，制定了《中邮基金管理股份有限公司公平交易制度》。从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。

#### 4.3.2 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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

基金经理严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司公平交易相关制度要求执行，对公平交易进行管理，独立确定投资组合的交易价格和数量。报告期内，不存在违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.3 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

在投资策略方面，本基金今年依然秉承绝对收益的投资思路，在相对底部和低估的行业当中选择优质公司。同时结合宏观经济的情况，优先选择相对有优势的行业。2023 年对于基金产品保持了逆周期的配置思路，同时持续自下而上寻找细分领域的个股投资机会。

在行业配置方面，逆周期行业作为主要的配置。在此基础上，我们依然配置了较多自下而上筛选的个股。主要寻找的是估值合理、景气度较高同时具有长期有成长空间的个股，而这类股票往往存在于小市值公司当中，需要不断的挖掘。小市值公司在 2023 年获得了较好的超额收益，以中证 2000 和微盘股为代表的指数大幅跑赢了沪深 300 指数，本基金希望能够寻找出真正有业绩兑现的优秀公司。同时，很多大白马经过了 3 年时间的下跌，估值非常便宜，本基金对于宏观环境保持高度警觉，在适当的时候做出相应调整。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中邮未来成长混合 A 基金份额净值为 1.0682 元，累计值为 1.0682 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.86%；截至本报告期末中邮未来成长混合 C 基金份额净值为 1.0613 元，累计净值为 1.0613 元，本报告期基金份额净值增长率为 18.62%；同期业绩比较基准收益率为-6.71%。

## 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 年开年的 1 个月，A 股市场冰火两重天，以中证 2000 为代表的小市值公司和红利为代表的大市值公司，走出了截然不同的走势，其背后是一方面是去年极致分化行情下的修复，另一方面也体现了风险偏好的极度下降。展望 2024 年，国内的房地产下行压力并未解除，消费和出口都进入疲弱期。宏观大环境整进入到了一个关键时期，而政策对于信心和宏观起着举足轻重的作用，这一点将会对于 2024 年的权益市场起到决定性影响。在并未看到明确的信号之前，本基金尽量均衡配置，精选具有安全性的个股和行业。未来一段时间，本基金寻找以下五类投资机会：第一类，之前因为一些短期因素下跌较多，即将迎来自身经营周期拐点的公司。第二类，具备第二成长曲线，但未被充分挖掘的公司。第三类，行业供给出清，供求关系在未来有望出现反转的行业。第四类，行业的估值具备长期性价比，同时长期增长逻辑依然存在的行业。此外仍需要高频观测宏观经济的变化趋势，从而及时做出调整。第五类，低位主题。

同时适度配置逆周期板块，以对冲宏观经济的不确定性。此外仍需要高频观测宏观经济的变化趋势，从而及时做出调整。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，本基金管理人致力于建立和健全公司内部控制制度，努力防范和化解公司各项经营管理活动中的风险，促进公司诚信、合法、有效经营，切实保障基金份额持有人的利益。

公司建立了督察长制度，督察长全权负责公司的监察与稽核工作，对基金运作的合法合规性进行全面检查与监督，遇有重大风险事件立即向公司董事长和中国证监会报告。公司设立了独立于各业务部门的监察稽核部，由督察长直接领导。监察稽核部按照规定的权限和程序，通过日常实时监控、现场专项检查、定期监察稽核评估等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促相关部门进行整改，同时定期向公司董事和管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人主要内部监察稽核工作如下：

##### 1. 制度建设不断完善

基金管理人进一步健全公司内控体系，保持了良好的内控环境、完善了内部控制的三道防线，并根据公司实际业务情况细化了岗位风险控制。在制订部门规章制度和业务流程时，将内控要求融入到各业务规范当中。同时根据公司业务的发展及监管部门法律法规的更新，对公司和部门制度进行持续的完善、修订及补充。制定了《中邮创业基金管理股份有限公司重大事项报告制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司总经理办公会议事规则》、《中邮创业基金管理股份有限公司数据资产管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司自有资金投资管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司洗钱和恐怖融资风险自评估制度》等，修改并完善了《中邮创业基金管理股份有限公司廉洁从业管理制度》、《中邮创业基金管理股份有限公司危机处理实施办法》、《中邮创业基金管理股份有限公司关联交易管理制度》、《中邮创业基金合规管理手册》等，进一步完善了公司的制度体系。

##### 2. 日常监察稽核工作

为规范基金投资运作、防范风险、更好的保护基金份额持有人的利益，对基金投资运作进行日常的监察工作，保障研究、投资决策、交易执行等环节严格执行法律法规及基金合同的有关规定。在日常实时电脑监控中，对基金投资及相关业务进行事中的风险控制，保障公司管理的基金规范运作。此外对信息技术、基金的注册登记、基金会计、信息披露等业务进行例行检查。

##### 3. 专项监察稽核工作

根据监管部门的要求及公司业务开展情况，对相关业务部门进行专项监察稽核。报告期内，对公司的研究部、权益投资部、固定收益部、信息技术部、营销部、直销柜台等进行了专项稽核，

通过检查发现内部控制薄弱点，及时提出了整改意见及建议。

#### 4. 定期监察稽核及内控检查评估工作

每季度对公司及基金运作的合法合规性及内部控制情况进行检查，对公司各项业务的制度建设、制度执行、风险控制等情况进行评估，发现内控的薄弱环节，并提出相应改进措施，促进公司内部控制和风险管理水平的加强和提高。

在本报告期内，本基金管理人运用基金财产进行投资严格按照招募说明书所披露的投资决策程序进行，无不当内幕交易和关联交易。没有发生重大违法违规行为。

在今后的工作中，本基金管理人将继续坚持内部控制优先原则，不断提高监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

否。

#### 4.10 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金的管理人——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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对中邮创业基金管理股份有限公司编制和披露的中邮未来成长混合型证券投资基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了复核，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	致同审字（2024）第 110A005390 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中邮未来成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了中邮未来成长混合型证券投资基金（以下简称中邮未来成长基金）的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定编制，公允反映了中邮未来成长基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中邮未来成长基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	中邮未来成长基金的基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括中邮未来成长基金 2023 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	基金管理人管理层负责按照企业会计准则及中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、

	<p>执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中邮未来成长基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算中邮未来成长基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中邮未来成长基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险,设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据所获取的审计证据,就可能导致对中邮未来成长基金的持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截</p>



	<p>至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中邮未来成长基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	致同会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	卫俏嫔   吕玉芝
会计师事务所的地址	中国北京朝阳区建国门外大街 22 号赛特广场 5 层
审计报告日期	2024 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：中邮未来成长混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	67,331,421.55	3,561,866.58
结算备付金		3,441,793.19	508,294.99
存出保证金		711,965.33	65,515.63
交易性金融资产	7.4.7.2	554,032,913.00	49,773,484.00
其中：股票投资		554,032,913.00	49,773,484.00
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		11,242,302.68	1,073,629.35
应收股利		-	2,498.84
应收申购款		2,378,445.62	2,146.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		639,138,841.37	54,987,436.17
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		30,308,321.54	-
应付赎回款		959,567.95	2,090.96

应付管理人报酬		650,911.36	72,902.22
应付托管费		108,485.26	12,150.37
应付销售服务费		78,930.45	1,387.73
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	7.4.7.9	1,846,732.99	372,594.17
负债合计		33,952,949.55	461,125.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	568,618,470.78	60,700,882.56
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	36,567,421.04	-6,174,571.84
净资产合计		605,185,891.82	54,526,310.72
负债和净资产总计		639,138,841.37	54,987,436.17

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，中邮未来成长混合 A 基金份额净值 1.0682 元，基金份额总额 245,476,487.09 份；中邮未来成长混合 C 基金份额净值 1.0613 元，基金份额总额 323,141,983.69 份。中邮未来成长混合份额总额合计为 568,618,470.78 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中邮未来成长混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-6,001,762.96	-5,011,148.62
1.利息收入		145,655.08	39,508.76
其中：存款利息收入	7.4.7.13	145,655.08	39,508.76
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）		20,259,157.88	-2,581,115.37
其中：股票投资收益	7.4.7.14	16,652,718.66	-2,876,817.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	19,403.44
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	3,606,439.22	276,298.58

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）	7.4.7.20	-27,675,644.61	-2,496,314.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,269,068.69	26,772.40
<b>减：二、营业总支出</b>		6,980,812.96	993,898.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	5,366,259.61	759,965.42
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	894,376.60	126,660.92
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	629,478.89	17,150.07
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	0.05
8. 其他费用	7.4.7.23	90,697.86	90,122.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-12,982,575.92	-6,005,047.39
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-12,982,575.92	-6,005,047.39
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-12,982,575.92	-6,005,047.39

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中邮未来成长混合型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31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	60,700,882.56	-	-6,174,571.84	54,526,310.72
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	60,700,882.56	-	-6,174,571.84	54,526,310.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	507,917,588.22	-	42,741,992.88	550,659,581.10
（一）、综合收益总额	-	-	-12,982,575.92	-12,982,575.92
（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）	507,917,588.22	-	55,724,568.80	563,642,157.02
其中：1.基金申购款	1,044,933,825.50	-	91,756,101.08	1,136,689,926.58
2.基金赎回款	-537,016,237.28	-	-36,031,532.28	-573,047,769.56
（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	568,618,470.78	-	36,567,421.04	605,185,891.82
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	48,929,736.46	-	2,175,334.91	51,105,071.37
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	48,929,736.46	-	2,175,334.91	51,105,071.37
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	11,771,146.10	-	-8,349,906.75	3,421,239.35
（一）、综合收益总额	-	-	-6,005,047.39	-6,005,047.39
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产	11,771,146.10	-	-2,344,859.36	9,426,286.74

减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	28,259,744.83	-	-4,195,153.61	24,064,591.22
2.基金赎回款	-16,488,598.73	-	1,850,294.25	-14,638,304.48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	60,700,882.56	-	-6,174,571.84	54,526,310.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

          张志名  李小振  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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中邮未来成长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[2020] 2481 号《关于准予中邮未来成长混合型证券投资基金注册的批复》核准募集，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》等有关规定和《中邮未来成长混合型证券投资基金基金合同》发起，并于 2021 年 4 月 8 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 261,943,159.16 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2021)第 110C000168 号验资报告予以验证。《中邮价值精选混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 4 月 8 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 261,943,159.16 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，基金托管人为浙商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮未来成长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）、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、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、同业存单及其他银行存款)、货币市场工具、股指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相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的 60%-95%,投资于未来成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;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需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于同业存单的比例合计不超过基金资产的 20%。

#### 7.4.2 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。

#### 7.4.3 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。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金采用公历年度,即从每年 1 月 1 日至 12 月 31 日为一个会计期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

根据本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除与权证投资有关的金融资产外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示;与权证投资有关的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示。

本基金持有的股票投资、债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

本基金持有的其他金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产，包括货币资金、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### (2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和以摊余成本计量的金融负债。除与权证投资有关的金融负债外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债在资产负债表中以交易性金融负债列示，与权证投资有关的金融负债在资产负债表中以衍生金融负债列示。

本基金持有的金融负债全部为以摊余成本计量的金融负债，包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资。股票投资成本按交易日股票的公允价值入账，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行清算。

卖出股票于交易日确认股票投资收益。股票投资收益按卖出股票成交总额与其成本、估值增值或减值和相关交易费用的差额入账，同时将原计入该卖出股票的公允价值变动损益转入股票投资收益，卖出股票应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

股票持有期间分派的股票股利，应于除权除息日根据上市公司股东大会决议公告，按股权登记日持有的股数及送股或转增比例，计算确定增加的股票数量，在本账户“数量”栏进行记录。因持有股票而享有的配股权，配股除权日在配股缴款截止日之后的，在除权日按所配的股数确认未流通部分的股票投资，与已流通部分分别核算。配股除权日在配股缴款截止日之前的，按照权证的有关原则进行核算。

股票投资应分派的现金股利，在除息日确认为股利收入。

估值日对持有的股票估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认债券投资；债券投资按交易日债券的公允价值（不含支付价款中所包含的应收利息）入账，应支付的全部价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应作为应计利息单独核算，不构成债券投资成本，应支付的相关交易费用直接计入当期损益。资金



交收日，按实际支付的价款与证券登记结算机构进行资金交收。

持有债券期间，每日确认利息收入，计入应计利息和利息收入科目。

债券派息日，按应计利息金额，与证券登记结算机构进行资金交收。

估值日对持有的债券估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

卖出债券应于交易日确认债券投资收益。债券投资收益按卖出债券应收取的金额与其成本、应计利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该卖出债券的公允价值变动损益转入债券投资收益，卖出债券应逐日结转成本，结转的方法采用移动加权平均法。

到期收回债券本金和利息，债券投资收益按收回债券应收取的金额与其成本、应计利息和估值增值或减值的差额入账。同时将原计入该收回债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

可转换债券转股时，按可转换股票的公允价值计入股票投资科目，按应收取的现金余额返还扣除可转换股票的公允价值后的余额，与可转换债券成本、应计利息和估值增值或减值的差额计入债券投资收益，同时，将原计入该转换债券的公允价值变动损益转入债券投资收益。

### （3）资产支持证券

取得资产支持证券时，按公允价值入账；取得资产支持证券支付的款项时，区分属于资产支持证券投资本金部分和证券投资收益部分，将收到的本金部分冲减成本，将收到的收益部分冲减应计利息（若有）后的差额，记入资产支持证券利息收入，其他与资产支持证券投资相关业务的账务处理比照债券投资。

### （4）股指期货投资

股指期货在买入和卖出合约时，记录初始合约价值。估值日对股指期货估值时，按当日与上一日估值的差额，将估值增值或减值计入公允价值变动损益。

买入合约卖出平仓、卖出合约买入平仓或到期交割时，采用移动加权方法结转平仓合约的初始合约价值。日终结算时，对股指期货进行估值，确认平仓损益，进行当日无负债结算，并对合约占用的交易保证金进行调整。

以摊余成本计量的金融资产

买入返售金融资产

根据返售协议，按照应付和实际支付的金额确认入账；返售前，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息收入；返售日，按照应收或实际收到的金额与账面余额和应计利息的差额，计算确认利息收入。

以摊余成本计量的金融负债

#### (1) 卖出回购金融资产款

根据回购协议，按照应收和实际收到的金额确认入账；融资期限内，按照实际利率逐日计提利息，合同利率与实际利率差异较小的，也可采用合同利率计算确定利息支出；到期回购时，按照应付或实际支付的金额与账面余额和应计利息的差额，计算确认利息支出。

#### (2) 其他金融负债

其他金融负债以公允价值作为初始确认金额，采用实际利率法以摊余成本进行后续计量，终止确认或摊销时的收入或支出计入当期损益，直线法与实际利率法确定的金额差异较小的可采用直线法。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值原则遵循《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告[2017]13号）、《中国基金估值标准 2018》及《关于固定收益品种的估值处理标准》（中基协字〔2022〕566号）中的相关法规，具体估值方法如下：

#### (1) 股票投资

上市交易的股票按其估值日在证券交易所挂牌的市场交易收盘价估值；估值日无市价，且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件，应采用最近交易市价确定公允价值；有充足证据表明最近交易市价不能真实反映公允价值的，应对最近交易的市价进行调整，确定公允价值；如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在 0.25% 以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

港股通投资的股票按其估值日在港交所的收盘价估值；估值日无交易的，以最近交易日的收盘价估值。估值计算中涉及港币或其他外币币种对人民币汇率的，依据当日中国人民银行或其授权机构公布的人民币汇率的中间价或其他可以反映公允价值的汇率进行估值。

在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行的股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售的股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，参考《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（中基协发〔2017〕6号）进行估值。

#### (2) 债券及资产支持证券投资

基金在对各类固定收益品种进行估值、减值计量时，可依据由第三方估值基准服务机构提供的数据。基金管理人、第三方估值基准服务机构根据以下原则确定估值品种公允价值：对于存在活跃市场的固定收益品种，应以活跃市场上未经调整的报价作为计量日的公允价值；对于不存在市场活动或市场活动很少的固定收益品种，应采用当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

对于未上市或未挂牌转让且不存在活跃市场的固定收益品种，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定其公允价值。

### (3) 股指期货投资

本基金投资股指期货合约，一般以估值当日结算价进行估值，估值日无结算价的，且最近交易日后经济环境未发生重大变化的，采用最近交易日结算价估值。

### (4) 估值不能客观反映其公允价值的处理

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值，基金管理人应根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

### (5) 实际投资成本与估值的差异处理

实际投资成本与估值的差异计入“公允价值变动损益”科目。

## 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示不得相互抵销。

## 7.4.4.7 实收基金

本基金单位总额不固定，基金单位总数随时增减。基金合同生效时，实收基金按实际收到的基金单位发行总额入账；基金合同生效后，实收基金应于基金申购、赎回确认日根据基金契约和招募说明书中载明的有关事项进行确认和计量。

## 7.4.4.8 损益平准金

基金管理公司于收到基金投资人申购或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，计算有效申购或转换款中含有的实收基金部分，确认并增加实收基金，按基金申购或转换款与实收基金的差额，确认并增加损益平准金。

基金管理公司于收到基金投资人赎回或转换申请之日起规定的工作日内，对该交易的有效性进行确认。确认日，按实收基金的余额占基金净值的比例，对基金赎回款或转换转出款中含有的实收基金，确认并减少实收基金，按基金赎回款或转换转出款与实收基金的差额，确认并减少损益平准金。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### (1) 股票投资收益

于卖出股票交易日确认，按卖出股票成交总额与其成本及相关交易费用的差额入账。

##### (2) 债券投资收益

于卖出债券交易日确认，按应收取的金额与其成本、应计利息的差额入账。

##### (3) 股利收入

于除息日确认，按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账。

##### (4) 债券利息收入

在债券实际持有期内逐日计提，按摊余成本和实际利率计算确定的金额入账。

##### (5) 存款利息收入

逐日计提，按本金与适用的利率计提的金额入账。

##### (6) 买入返售证券收入

在证券持有期内采用实际利率逐日计提，按计提的金额入账。

##### (7) 公允价值变动损益

于估值日，对采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的损益进行确认；卖出股票、债券、权证等资产时，将原计入该卖出资产的公允价值变动损益转入股票投资收益、债券投资收益、衍生工具收益等科目。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

##### (1) 基金管理人报酬

按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率逐日计提。（根据《中邮创业基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 8 月 25 日起基金管理人的管理费年费率由原费率 1.50% 变更为 1.20%。）

##### (2) 基金托管费

按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率逐日计提。（根据《中邮创业基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 8 月 25 日起基金托管人的托管费年费率由原费率 0.25% 变更为 0.20%。）

##### (3) 销售服务费

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按前一日 C 类基金资产净值 0.25% 的年费率逐日计提。

##### (4) 交易费用

对股票、债券、资产支持证券、权证等交易过程中发生的，可直接归属于取得或处置某项基金资产或承担某项基金负债的新增外部成本，包括支付给交易代理机构的规费、佣金、代征的税金及其他必要的可以正确估算的支出，在资产交易日确认各项交易费用。

#### (5) 利息支出

对银行借款利息支出、交易性金融负债利息支出和卖出回购金融资产支出，在借款期或融资期内按实际利率逐日计提并确认入账。

### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金收益分配方式分为两种：现金分红与红利再投资，基金投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	67,331,421.55	3,561,866.58
等于：本金	67,326,851.89	3,561,461.60
加：应计利息	4,569.66	404.98
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：	67,331,421.55	3,561,866.58

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	583,891,176.54	-	554,032,913.00	-29,858,263.54
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	583,891,176.54	-	554,032,913.00	-29,858,263.54
	项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
	股票	51,956,102.93	-	49,773,484.00	-2,182,618.93
	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	51,956,102.93	-	49,773,484.00	-2,182,618.93

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 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。

#### 7.4.7.3.3 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。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有买断式逆回购金融资产。



#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本期末及上年度末未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本期末及上年度末未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本期末及上年度末未持有其他债权投资。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

本基金本期末及上年度末无其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	2,923.24	2.71
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,753,809.75	192,591.46
其中：交易所市场	1,753,809.75	192,591.46
银行间市场	-	-
-	-	-
应付利息	-	-
预提费用	90,000.00	180,000.00
合计	1,846,732.99	372,594.17

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中邮未来成长混合 A		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,679,663.48	53,679,663.48
本期申购	263,379,762.17	263,379,762.17
本期赎回（以“-”号填列）	-71,582,938.56	-71,582,938.56
- 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	245,476,487.09	245,476,487.09

金额单位：人民币元

中邮未来成长混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,021,219.08	7,021,219.08
本期申购	781,554,063.33	781,554,063.33
本期赎回（以“-”号填列）	-465,433,298.72	-465,433,298.72
- 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	323,141,983.69	323,141,983.69

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

本基金无其他综合收益。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中邮未来成长混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,188,388.68	4,247,106.05	-5,435,494.73
加：会计政策变更 （若有）	-	-	-
前期差错更正	-	-	-

(若有)			
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-1,188,388.68	-4,247,106.05	-5,435,494.73
本期利润	7,229,732.19	-3,611,114.74	3,618,617.45
本期基金份额交易产生的变动数	20,846,840.22	-2,284,197.19	18,562,643.03
其中:基金申购款	28,870,281.53	-5,229,906.94	23,640,374.59
基金赎回款	-8,023,441.31	2,945,709.75	-5,077,731.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,888,183.73	-10,142,417.98	16,745,765.75

单位:人民币元

中邮未来成长混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-185,531.60	-553,545.51	-739,077.11
加:会计政策变更(若有)	-	-	-
前期差错更正(若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-185,531.60	-553,545.51	-739,077.11
本期利润	7,463,336.50	-24,064,529.87	-16,601,193.37
本期基金份额交易产生的变动数	25,719,088.84	11,442,836.93	37,161,925.77
其中:基金申购款	80,231,027.67	-12,115,301.18	68,115,726.49
基金赎回款	-54,511,938.83	23,558,138.11	-30,953,800.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,996,893.74	-13,175,238.45	19,821,655.29

#### 7.4.7.13 存款利息收入

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12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
活期存款利息收入	92,920.92	33,154.48
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	37,053.16	4,723.81
其他	15,681.00	1,630.47
合计	145,655.08	39,508.76

### 7.4.7.14 股票投资收益

#### 7.4.7.14.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
卖出股票成交总额	2,566,789,601.04	328,218,169.32
减：卖出股票成本总额	2,543,105,137.75	330,069,371.25
减：交易费用	7,031,744.63	1,025,615.46
买卖股票差价收入	16,652,718.66	-2,876,817.39

### 7.4.7.15 债券投资收益

#### 7.4.7.15.1 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	-	18.65
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-	19,384.79
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	-	19,403.44

#### 7.4.7.15.2 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	118,404.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	99,000.00
减：应计利息总额	-	19.09
减：交易费用	-	0.12
买卖债券差价收入	-	19,384.79

**7.4.7.16 资产支持证券投资收益**

本报告期内及上年度可比期间本基金无资产支持证券投资。

**7.4.7.17 贵金属投资收益**

本报告期内及上年度可比期间本基金无贵金属投资。

**7.4.7.18 衍生工具收益**

本报告期内及上年度可比期间本基金无衍生工具投资。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,606,439.22	276,298.58
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	3,606,439.22	276,298.58

**7.4.7.20 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12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	-27,675,644.61	-2,496,314.41
——股票投资	-27,675,644.61	-2,496,314.41
——债券投资	-	-
——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	-27,675,644.61	-2,496,314.41

### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	1,269,068.69	26,772.40
合计	1,269,068.69	26,772.40

注：本基金赎回费率按照持有时间递减，赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担。本基金 A 类基金份额，对持续持有期小于 30 日（不含 30 日）的，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 90 日的，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 90 日（含 90 日）但少于 180 日的，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 180 日（含 180 日）的，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产，其余用于注册登记费和其他必要的手续费。本基金 C 类基金份额，对持续持有期小于 30 日（不含 30 日）的投资人收取的赎回费全额计入基金财产；对持续持有期长于 30 日（含 30 日）的，将不低于赎回费总额的 25% 计入基金财产。

### 7.4.7.22 信用减值损失

本报告期内及上年度可比期间本基金无信用减值损失。

### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	50,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
深港通证券组合费	697.86	122.31
其他	-	-
交易费用	-	-
合计	90,697.86	90,122.31

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2024 年 3 月 27 日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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
浙商银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
中国邮政集团有限公司	基金管理人的股东
三井住友银行股份有限公司	基金管理人的股东

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期及上年度可比期间内，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 7.4.10.1 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内，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,366,259.61	759,965.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,392,207.78	190,568.46
应支付基金管理人的净管理费	3,974,051.83	569,396.96

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

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数

（根据《中邮创业基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 8 月 25 日起基金管理人的管理费年费率由原费率 1.50% 变更为 1.20%。）

##### 7.4.10.2.2 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 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	894,376.60	126,660.92

注：支付基金托管人浙商银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月末，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

（根据《中邮创业基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，本基金自 2023 年 8 月 25 日起基金托管人的托管费年费率由原费率 0.25%变更为 0.20%。）

#### 7.4.10.2.3 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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C	合计
中邮创业基金管理股份有限公司	-	142,215.46	142,215.46
浙商银行股份有限公司	-	1,879.94	1,879.94
首创证券股份有限公司	-	940.94	940.94
合计	-	145,036.34	145,036.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C	合计
中邮创业基金管理股份有限公司	-	99.36	99.36
浙商银行股份有限公司	-	1,547.75	1,547.75
首创证券股份有限公司	-	1,009.04	1,009.04
合计	-	2,656.15	2,656.15

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算方法如下：

$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$

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



**7.4.10.3 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。

**7.4.10.4 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****7.4.10.4.1 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固定期限费率的证券出借业务。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 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 2023年1月1日至2023年12月31日	
	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C
基金合同生效日（2021年4月8日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	26,526,744.96	-
报告期间申购/买入总份额	18,407,425.81	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	44,934,170.77	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.90%	-

项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C
基金合同生效日（2021年4月8日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	13,060,780.22	-

报告期间申购/买入总份额	13,465,964.74	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	26,526,744.96	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	43.70%	-

#### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浙商银行股份有限公司	67,331,421.55	92,920.92	3,561,866.58	33,154.48

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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/增发证券而持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 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。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.12.4 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。

## 7.4.13 金融工具风险及管理

### 7.4.13.1 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之内。

### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.2.1 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。

#### 7.4.13.2.2 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。

### 7.4.13.3 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“7.4.12 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	67,326,851.89	-	-	4,569.66	67,331,421.55
结算备付金	3,439,686.09	-	-	2,107.10	3,441,793.19
存出保证金	711,645.02	-	-	320.31	711,965.33
交易性金融资 产	-	-	-	554,032,913.00	554,032,913.00
应收清算款	-	-	-	11,242,302.68	11,242,302.68
应收申购款	-	-	-	2,378,445.62	2,378,445.62
资产总计	71,478,183.00	-	-	567,660,658.37	639,138,841.37
负债					
应付清算款	-	-	-	30,308,321.54	30,308,321.54
应付赎回款	-	-	-	959,567.95	959,567.95
应付管理人报 酬	-	-	-	650,911.36	650,911.36
应付托管费	-	-	-	108,485.26	108,485.26
应付销售服务 费	-	-	-	78,930.45	78,930.45
其他负债	-	-	-	1,846,732.99	1,846,732.99
负债总计	-	-	-	33,952,949.55	33,952,949.55
利率敏感度缺 口	71,478,183.00	-	-	533,707,708.82	605,185,891.82
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					
货币资金	3,561,461.60	-	-	404.98	3,561,866.58
结算备付金	508,104.57	-	-	190.42	508,294.99
存出保证金	65,486.25	-	-	29.38	65,515.63
交易性金融资 产	-	-	-	49,773,484.00	49,773,484.00
应收清算款	-	-	-	1,073,629.35	1,073,629.35
应收股利	-	-	-	2,498.84	2,498.84
应收申购款	-	-	-	2,146.78	2,146.78
资产总计	4,135,052.42	-	-	50,852,383.75	54,987,436.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,090.96	2,090.96
应付管理人报 酬	-	-	-	72,902.22	72,902.22
应付托管费	-	-	-	12,150.37	12,150.37
应付销售服务	-	-	-	1,387.73	1,387.73

费					
其他负债	-	-	-	372,594.17	372,594.17
负债总计	-	-	-	461,125.45	461,125.45
利率敏感度缺口	4,135,052.42	-	-	50,391,258.30	54,526,310.72

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 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。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	13,931,980	-	13,931,980
应收股利	-	-	-	-
资产合计	-	13,931,980	-	13,931,980
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	-	13,931,980	-	13,931,980
项目	上年度末			
	2022 年 12 月 31 日			
	美元	港币	其他币种	合计

	折合人民币	折合人民币	折合人民币	
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	4,259,885.0	-	4,259,885.0
应收股利	-	2,498.84	-	2,498.84
资产合计	-	4,262,383.84	-	4,262,383.84
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	-	4,262,383.84	-	4,262,383.84

#### 7.4.13.4.2.2 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	基金净资产变动	139,319.80	42,623.84
	基金净资产变动	-139,319.80	-42,623.84

#### 7.4.13.4.3 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）、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、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款、同业存单及其他银行存款)、货币市场工具、股指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。

本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产净值的 60%-95%,投资于未来成长主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%;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需缴纳的交易保证金后,本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金投资于同业存单的比例合计不超过基金资产的 20%。

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。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

于 2023 年 12 月 31 日,本基金面临的整体市场价格风险列示如下:

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	554,032,913.00	91.55	49,773,484.00	91.28
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	554,032,913.00	91.55	49,773,484.00	91.28



#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量，当本基金基准上涨 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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	基金净资产变动	6,322,528.98	565,940.47
	基金净资产变动	-6,322,528.98	-565,940.47

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 1.14。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	554,032,913.00	49,773,484.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	554,032,913.00	49,773,484.00

###### 7.4.14.2.2 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。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

本报告期内及上年度可比期间本基金无第三层次金融工具。

#### **7.4.14.3 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。

#### **7.4.14.4 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。

#### **7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

无。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	554,032,913.00	86.68
	其中：股票	554,032,913.00	86.68
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	70,773,214.74	11.07
8	其他各项资产	14,332,713.63	2.24
9	合计	639,138,841.37	100.00

注：由于四舍五入的原因报告期末基金资产组合各项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。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	5,748,645.00	0.95
C	制造业	421,821,280.64	69.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,144,000.00	0.52
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	11,897,902.80	1.97
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	13,489,610.00	2.23
J	金融业	-	-
K	房地产业	4,348,000.00	0.72
L	租赁和商务服务业	29,907,618.00	4.94

M	科学研究和技术服务业	16,272,626.56	2.69
N	水利、环境和公共设施管理业	8,387,500.00	1.39
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	25,083,750.00	4.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	540,100,933.00	89.25

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。

### 8.2.2 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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	13,931,980.00	2.30
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	-	-
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	13,931,980.00	2.30

### 8.3 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	605007	五洲特纸	2,128,000	31,302,880.00	5.17
2	001228	永泰运	939,900	29,907,618.00	4.94
3	002637	赞宇科技	2,537,100	27,223,083.00	4.50
4	688121	卓然股份	1,304,277	26,385,523.71	4.36
5	603301	振德医疗	1,063,600	26,058,200.00	4.31
6	002353	杰瑞股份	750,921	21,108,389.31	3.49
7	603112	华翔股份	1,720,300	20,901,645.00	3.45
8	002695	煌上煌	1,863,300	19,508,751.00	3.22
9	301160	翔楼新材	434,683	18,356,663.09	3.03
10	300244	迪安诊断	770,000	18,333,700.00	3.03
11	603806	福斯特	659,000	15,993,930.00	2.64

12	688065	凯赛生物	273,000	15,009,540.00	2.48
13	300012	华测检测	1,000,000	14,200,000.00	2.35
14	00179	德昌电机控股	1,239,500	13,931,980.00	2.30
15	603868	飞科电器	270,000	13,635,000.00	2.25
16	688093	世华科技	737,481	13,429,529.01	2.22
17	600399	抚顺特钢	1,284,300	12,483,396.00	2.06
18	002390	信邦制药	2,100,000	9,324,000.00	1.54
19	002537	海联金汇	1,399,947	9,323,647.02	1.54
20	688129	东来技术	519,700	8,601,035.00	1.42
21	002034	旺能环境	550,000	8,387,500.00	1.39
22	603520	司太立	541,400	7,622,912.00	1.26
23	688786	悦安新材	164,398	7,305,847.12	1.21
24	300699	光威复材	260,000	6,934,200.00	1.15
25	300348	长亮科技	660,000	6,804,600.00	1.12
26	300143	盈康生命	635,000	6,750,050.00	1.12
27	000768	中航西飞	300,000	6,711,000.00	1.11
28	300496	中科创达	83,500	6,685,010.00	1.10
29	002074	国轩高科	300,000	6,450,000.00	1.07
30	603501	韦尔股份	60,000	6,402,600.00	1.06
31	002402	和而泰	433,216	6,190,656.64	1.02
32	603068	博通集成	208,400	6,074,860.00	1.00
33	603233	大参林	239,972	5,975,302.80	0.99
34	688355	明志科技	294,237	5,855,316.30	0.97
35	603823	百合花	588,800	5,793,792.00	0.96
36	601989	中国重工	1,400,000	5,782,000.00	0.96
37	300775	三角防务	200,000	5,580,000.00	0.92
38	603529	爱玛科技	219,950	5,507,548.00	0.91
39	600366	宁波韵升	700,000	5,439,000.00	0.90
40	300710	万隆光电	200,000	4,864,000.00	0.80
41	603150	万朗磁塑	153,600	4,462,080.00	0.74
42	603506	南都物业	400,000	4,348,000.00	0.72
43	301045	天禄科技	151,300	4,115,360.00	0.68
44	603507	振江股份	150,000	3,886,500.00	0.64
45	603396	金辰股份	70,202	3,836,539.30	0.63
46	300937	药易购	119,600	3,761,420.00	0.62
47	605589	圣泉集团	160,921	3,601,411.98	0.60
48	301349	信德新材	75,750	3,566,310.00	0.59
49	002392	北京利尔	844,300	3,191,454.00	0.53
50	603773	沃格光电	93,800	3,177,006.00	0.52

51	600681	百川能源	800,000	3,144,000.00	0.52
52	600583	海油工程	490,000	2,910,600.00	0.48
53	002562	兄弟科技	704,500	2,846,180.00	0.47
54	603727	博迈科	226,500	2,838,045.00	0.47
55	301189	奥尼电子	80,000	2,312,800.00	0.38
56	000039	中集集团	300,000	2,295,000.00	0.38
57	300464	星徽股份	359,000	2,161,180.00	0.36
58	688293	奥浦迈	37,568	2,072,626.56	0.34
59	688625	呈和科技	49,727	1,950,292.94	0.32
60	688633	星球石墨	45,514	1,421,402.22	0.23

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	688121	卓然股份	45,675,287.34	83.77
2	605007	五洲特纸	41,295,628.06	75.74
3	603301	振德医疗	40,634,704.65	74.52
4	001228	永泰运	40,391,156.21	74.08
5	600483	福能股份	38,804,004.90	71.17
6	002637	赞宇科技	37,178,492.00	68.18
7	002695	煌上煌	36,918,762.44	67.71
8	000002	万科 A	31,716,967.90	58.17
9	002353	杰瑞股份	30,363,458.72	55.69
10	603112	华翔股份	30,125,858.00	55.25
11	301160	翔楼新材	28,121,401.60	51.57
12	688093	世华科技	27,882,565.44	51.14
13	603708	家家悦	26,630,046.00	48.84
14	300937	药易购	26,384,476.00	48.39
15	688786	悦安新材	26,134,495.62	47.93
16	603338	浙江鼎力	25,424,533.00	46.63
17	688355	明志科技	24,047,081.52	44.10
18	002537	海联金汇	23,886,461.98	43.81
19	603823	百合花	23,302,975.30	42.74
20	001979	招商蛇口	22,099,610.00	40.53

21	301045	天禄科技	21,522,780.00	39.47
22	688131	皓元医药	21,306,691.41	39.08
23	603260	合盛硅业	21,130,628.60	38.75
24	300143	盈康生命	20,979,802.73	38.48
25	002780	三夫户外	20,406,275.00	37.42
26	300244	迪安诊断	20,241,290.00	37.12
27	605589	圣泉集团	19,364,231.73	35.51
28	300837	浙矿股份	19,158,071.00	35.14
29	002286	保龄宝	19,126,008.91	35.08
30	600867	通化东宝	19,062,260.71	34.96
31	300873	海晨股份	18,928,948.92	34.72
32	300031	宝通科技	18,279,302.91	33.52
33	603806	福斯特	17,999,882.00	33.01
34	603986	兆易创新	17,927,371.00	32.88
35	603773	沃格光电	17,621,121.56	32.32
36	002402	和而泰	17,502,648.04	32.10
37	002425	凯撒文化	17,013,582.00	31.20
38	002360	同德化工	16,992,080.00	31.16
39	301349	信德新材	16,913,378.17	31.02
40	688313	仕佳光子	16,734,033.44	30.69
41	688065	凯赛生物	16,521,420.38	30.30
42	300759	康龙化成	16,150,445.83	29.62
43	600966	博汇纸业	16,078,104.00	29.49
44	002773	康弘药业	15,989,656.96	29.32
45	002975	博杰股份	15,897,685.60	29.16
46	600201	生物股份	15,857,768.07	29.08
47	603378	亚士创能	15,857,459.38	29.08
48	002185	华天科技	15,561,980.96	28.54
49	688010	福光股份	15,544,085.53	28.51
50	002812	恩捷股份	15,521,428.46	28.47
51	688608	恒玄科技	15,026,691.84	27.56
52	601012	隆基绿能	14,920,837.60	27.36
53	603868	飞科电器	14,791,969.00	27.13
54	300761	立华股份	14,349,864.94	26.32
55	300785	值得买	14,279,791.00	26.19
56	300444	双杰电气	14,258,961.72	26.15

57	300012	华测检测	14,253,350.00	26.14
58	603309	维力医疗	14,113,210.00	25.88
59	002661	克明食品	13,896,258.80	25.49
60	00179	德昌电机控股	13,595,245.60	24.93
61	002521	齐峰新材	13,256,751.00	24.31
62	300953	震裕科技	13,057,377.38	23.95
63	300348	长亮科技	12,971,428.00	23.79
64	300842	帝科股份	12,812,703.00	23.50
65	000926	福星股份	12,755,016.00	23.39
66	600547	山东黄金	12,737,170.80	23.36
67	02380	中国电力	12,552,775.46	23.02
68	688266	泽璟制药	12,315,232.32	22.59
69	600399	抚顺特钢	12,212,664.00	22.40
70	600176	中国巨石	12,202,714.14	22.38
71	300540	蜀道装备	12,050,033.00	22.10
72	688358	祥生医疗	12,026,542.27	22.06
73	002833	弘亚数控	11,995,730.80	22.00
74	002252	上海莱士	11,928,357.00	21.88
75	603087	甘李药业	11,666,931.00	21.40
76	002415	海康威视	11,610,885.03	21.29
77	600642	申能股份	11,541,792.00	21.17
78	688529	豪森智能	11,541,513.19	21.17
79	600433	冠豪高新	11,539,705.00	21.16
80	300792	壹网壹创	11,279,426.00	20.69
81	002484	江海股份	11,250,567.25	20.63
82	603019	中科曙光	11,129,334.00	20.41
83	300123	亚光科技	11,066,818.00	20.30
84	002567	唐人神	10,988,060.00	20.15
85	688680	海优新材	10,881,552.11	19.96
86	688981	中芯国际	10,857,403.61	19.91
87	300122	智飞生物	10,687,660.90	19.60
88	002757	南兴股份	10,565,722.00	19.38
89	003029	吉大正元	10,483,065.00	19.23
90	600711	盛屯矿业	10,464,320.00	19.19
91	603890	春秋电子	10,451,305.00	19.17
92	603869	新智认知	10,343,552.00	18.97



93	002899	英派斯	10,332,985.00	18.95
94	300394	天孚通信	10,329,373.39	18.94
95	002390	信邦制药	10,273,282.00	18.84
96	600570	恒生电子	10,266,475.11	18.83
97	603259	药明康德	10,257,374.00	18.81
98	300404	博济医药	10,204,637.00	18.72
99	688169	石头科技	10,200,881.08	18.71
100	688511	天微电子	10,164,592.18	18.64
101	688669	聚石化学	10,066,778.63	18.46
102	300818	耐普矿机	9,925,268.50	18.20
103	603396	金辰股份	9,895,085.82	18.15
104	002606	大连电瓷	9,626,159.00	17.65
105	600211	西藏药业	9,522,012.41	17.46
106	688633	星球石墨	9,437,410.47	17.31
107	600267	海正药业	9,435,765.03	17.30
108	300058	蓝色光标	9,367,718.00	17.18
109	603233	大参林	9,271,958.46	17.00
110	600460	士兰微	9,214,711.00	16.90
111	002985	北摩高科	9,191,486.40	16.86
112	300280	紫天科技	9,121,004.05	16.73
113	688005	容百科技	9,091,047.12	16.67
114	600351	亚宝药业	9,084,026.00	16.66
115	002034	旺能环境	9,083,530.00	16.66
116	832469	富恒新材	9,060,820.97	16.62
117	000876	新希望	9,058,346.00	16.61
118	603068	博通集成	8,990,118.00	16.49
119	01119	创梦天地	8,943,490.28	16.40
120	688233	神工股份	8,938,679.97	16.39
121	300552	万集科技	8,892,030.00	16.31
122	002036	联创电子	8,885,047.92	16.29
123	301060	兰卫医学	8,854,462.00	16.24
124	688129	东来技术	8,740,145.64	16.03
125	300594	朗进科技	8,732,914.16	16.02
126	688789	宏华数科	8,725,661.58	16.00
127	603520	司太立	8,434,917.20	15.47
128	002572	索菲亚	8,345,851.00	15.31

129	002919	名臣健康	8,332,356.42	15.28
130	300464	星徽股份	8,321,367.00	15.26
131	002895	川恒股份	8,292,455.00	15.21
132	002352	顺丰控股	8,275,043.95	15.18
133	300243	瑞丰高材	8,219,642.00	15.07
134	603900	莱绅通灵	8,209,487.60	15.06
135	002465	海格通信	8,200,111.00	15.04
136	300238	冠昊生物	8,131,257.76	14.91
137	688508	芯朋微	8,123,788.56	14.90
138	002373	千方科技	8,117,280.00	14.89
139	603529	爱玛科技	8,040,375.00	14.75
140	300055	万邦达	8,037,809.00	14.74
141	301127	天源环保	7,980,510.33	14.64
142	002460	赣锋锂业	7,948,505.00	14.58
143	688498	源杰科技	7,936,908.55	14.56
144	688071	华依科技	7,867,301.82	14.43
145	600021	上海电力	7,838,057.80	14.37
146	600567	山鹰国际	7,787,645.00	14.28
147	300145	中金环境	7,783,533.00	14.27
148	002709	天赐材料	7,783,148.20	14.27
149	603020	爱普股份	7,746,503.00	14.21
150	300919	中伟股份	7,691,853.00	14.11
151	600258	首旅酒店	7,683,200.00	14.09
152	300872	天阳科技	7,667,882.80	14.06
153	601390	中国中铁	7,625,908.00	13.99
154	688466	金科环境	7,613,282.75	13.96
155	000672	上峰水泥	7,598,086.00	13.93
156	000966	长源电力	7,524,798.68	13.80
157	600596	新安股份	7,449,094.00	13.66
158	002675	东诚药业	7,444,725.00	13.65
159	002582	好想你	7,434,637.00	13.63
160	605068	明新旭腾	7,430,219.00	13.63
161	300219	鸿利智汇	7,427,160.00	13.62
162	300624	万兴科技	7,362,277.00	13.50
163	300007	汉威科技	7,301,914.54	13.39
164	002487	大金重工	7,249,709.00	13.30

165	600718	东软集团	7,207,169.00	13.22
166	300762	上海瀚讯	7,196,883.40	13.20
167	601186	中国铁建	7,194,042.71	13.19
168	300102	乾照光电	7,119,480.00	13.06
169	002078	太阳纸业	7,089,847.96	13.00
170	601601	中国太保	7,058,042.00	12.94
171	300308	中际旭创	7,050,647.00	12.93
172	688312	燕麦科技	7,003,406.45	12.84
173	300379	东方通	6,972,724.18	12.79
174	300496	中科创达	6,956,596.00	12.76
175	300775	三角防务	6,934,806.00	12.72
176	600215	派斯林	6,904,339.00	12.66
177	300699	光威复材	6,903,268.00	12.66
178	688229	博睿数据	6,898,013.68	12.65
179	301220	亚香股份	6,847,808.00	12.56
180	09992	泡泡玛特	6,791,078.24	12.45
181	002142	宁波银行	6,722,489.00	12.33
182	300802	矩子科技	6,697,832.80	12.28
183	002074	国轩高科	6,695,069.00	12.28
184	000768	中航西飞	6,655,138.00	12.21
185	000710	贝瑞基因	6,617,215.00	12.14
186	03690	美团-W	6,584,277.17	12.08
187	603501	韦尔股份	6,520,046.00	11.96
188	002541	鸿路钢构	6,478,730.40	11.88
189	688329	艾隆科技	6,446,548.51	11.82
190	688152	麒麟信安	6,399,549.63	11.74
191	600583	海油工程	6,373,470.00	11.69
192	688116	天奈科技	6,334,524.36	11.62
193	000403	派林生物	6,235,982.00	11.44
194	688039	当虹科技	6,172,369.32	11.32
195	000735	罗牛山	6,083,468.00	11.16
196	688028	沃尔德	5,979,007.56	10.97
197	002933	新兴装备	5,934,870.00	10.88
198	002372	伟星新材	5,931,012.00	10.88
199	688580	伟思医疗	5,929,766.48	10.88
200	002127	南极电商	5,869,114.00	10.76

201	600346	恒力石化	5,853,304.00	10.73
202	601989	中国重工	5,699,719.00	10.45
203	688012	中微公司	5,633,631.18	10.33
204	600079	人福医药	5,547,609.00	10.17
205	002151	北斗星通	5,518,923.00	10.12
206	300251	光线传媒	5,510,294.52	10.11
207	600366	宁波韵升	5,439,928.00	9.98
208	688766	普冉股份	5,397,057.87	9.90
209	688521	芯原股份	5,326,794.68	9.77
210	300026	红日药业	5,309,000.00	9.74
211	300710	万隆光电	5,280,511.00	9.68
212	601066	中信建投	5,239,596.00	9.61
213	300375	鹏翎股份	5,213,322.00	9.56
214	603218	日月股份	5,211,605.00	9.56
215	600141	兴发集团	5,127,873.00	9.40
216	300570	太辰光	5,047,291.00	9.26
217	300158	振东制药	5,024,647.75	9.22
218	600563	法拉电子	4,974,703.00	9.12
219	605377	华旺科技	4,972,273.00	9.12
220	000887	中鼎股份	4,942,796.00	9.06
221	000952	广济药业	4,884,694.60	8.96
222	688336	三生国健	4,845,262.03	8.89
223	600009	上海机场	4,842,545.00	8.88
224	300193	佳士科技	4,842,462.00	8.88
225	002970	锐明技术	4,834,746.00	8.87
226	688609	九联科技	4,820,421.26	8.84
227	603813	原尚股份	4,761,090.00	8.73
228	688170	德龙激光	4,709,523.40	8.64
229	688787	海天瑞声	4,709,044.16	8.64
230	301149	隆华新材	4,679,229.00	8.58
231	002819	东方中科	4,641,094.00	8.51
232	688046	药康生物	4,629,901.44	8.49
233	600810	神马股份	4,505,359.20	8.26
234	688011	新光光电	4,499,706.27	8.25
235	603506	南都物业	4,496,190.00	8.25
236	300078	思创医惠	4,471,235.00	8.20

237	603150	万朗磁塑	4,438,379.00	8.14
238	601800	中国交建	4,402,056.00	8.07
239	000950	重药控股	4,350,446.00	7.98
240	300994	久祺股份	4,340,292.00	7.96
241	001311	多利科技	4,242,307.50	7.78
242	601688	华泰证券	3,964,300.00	7.27
243	300443	金雷股份	3,935,621.00	7.22
244	603600	永艺股份	3,853,496.00	7.07
245	603225	新凤鸣	3,752,528.24	6.88
246	688598	金博股份	3,725,848.13	6.83
247	601236	红塔证券	3,714,081.80	6.81
248	002977	天箭科技	3,698,824.40	6.78
249	600795	国电电力	3,694,000.00	6.77
250	601865	福莱特	3,678,214.00	6.75
251	603220	中贝通信	3,651,806.00	6.70
252	600746	江苏索普	3,651,312.02	6.70
253	00700	腾讯控股	3,641,724.61	6.68
254	603507	振江股份	3,612,375.00	6.63
255	300578	会畅通讯	3,590,002.00	6.58
256	605178	时空科技	3,578,510.60	6.56
257	301283	聚胶股份	3,556,594.00	6.52
258	001223	欧克科技	3,530,031.00	6.47
259	688073	毕得医药	3,527,114.03	6.47
260	600557	康缘药业	3,504,352.00	6.43
261	002101	广东鸿图	3,498,039.00	6.42
262	601888	中国中免	3,478,027.20	6.38
263	300976	达瑞电子	3,470,500.90	6.36
264	002317	众生药业	3,419,580.00	6.27
265	688316	青云科技	3,409,433.86	6.25
266	603882	金域医学	3,380,461.00	6.20
267	300809	华辰装备	3,268,802.00	5.99
268	600681	百川能源	3,264,315.00	5.99
269	603313	梦百合	3,212,663.60	5.89
270	600489	中金黄金	3,156,818.00	5.79
271	002938	鹏鼎控股	3,135,692.00	5.75
272	002392	北京利尔	3,124,103.00	5.73

273	600383	金地集团	3,027,498.00	5.55
274	603081	大丰实业	3,011,875.00	5.52
275	301155	海力风电	3,006,672.98	5.51
276	300129	泰胜风能	2,988,311.00	5.48
277	688356	键凯科技	2,957,137.09	5.42
278	603727	博迈科	2,941,045.00	5.39
279	300959	线上线下	2,933,320.00	5.38
280	002562	兄弟科技	2,921,701.00	5.36
281	300196	长海股份	2,882,197.00	5.29
282	300353	东土科技	2,830,797.00	5.19
283	600376	首开股份	2,828,423.00	5.19
284	06049	保利物业	2,753,450.51	5.05
285	600115	中国东航	2,748,283.00	5.04
286	301548	崇德科技	2,741,149.00	5.03
287	688270	臻镭科技	2,725,665.60	5.00
288	688081	兴图新科	2,721,400.53	4.99
289	688097	博众精工	2,702,312.30	4.96
290	688772	珠海冠宇	2,622,028.02	4.81
291	300846	首都在线	2,609,842.00	4.79
292	300320	海达股份	2,567,800.00	4.71
293	603296	华勤技术	2,557,816.00	4.69
294	300763	锦浪科技	2,539,308.00	4.66
295	300223	北京君正	2,498,545.00	4.58
296	300166	东方国信	2,427,082.00	4.45
297	000039	中集集团	2,331,000.00	4.28
298	301189	奥尼电子	2,328,547.00	4.27
299	300701	森霸传感	2,282,799.00	4.19
300	300254	仟源医药	2,264,027.00	4.15
301	400193	嘉凯城 3	2,224,960.58	4.08
302	600152	维科技术	2,208,683.00	4.05
303	688282	理工导航	2,162,768.00	3.97
304	601500	通用股份	2,157,464.00	3.96
305	603881	数据港	2,154,879.00	3.95
306	300322	硕贝德	2,135,627.00	3.92
307	301035	润丰股份	2,121,562.00	3.89
308	300408	三环集团	2,112,905.00	3.88

309	605081	太和水	2,080,047.00	3.81
310	300323	华灿光电	2,072,068.00	3.80
311	688293	奥浦迈	2,058,050.11	3.77
312	688075	安旭生物	2,056,901.13	3.77
313	000923	河钢资源	2,031,138.00	3.73
314	688793	倍轻松	2,026,053.15	3.72
315	605166	聚合顺	2,009,454.00	3.69
316	688625	呈和科技	1,979,241.63	3.63
317	301013	利和兴	1,958,093.00	3.59
318	300897	山科智能	1,843,945.00	3.38
319	688115	思林杰	1,822,589.78	3.34
320	002065	东华软件	1,775,868.00	3.26
321	688418	震有科技	1,755,884.33	3.22
322	600802	福建水泥	1,709,527.60	3.14
323	301062	上海艾录	1,682,602.00	3.09
324	300661	圣邦股份	1,625,266.00	2.98
325	02137	腾盛博药-B	1,607,848.09	2.95
326	002670	国盛金控	1,576,527.00	2.89
327	300099	尤洛卡	1,511,732.00	2.77
328	605018	长华集团	1,502,909.00	2.76
329	603416	信捷电气	1,498,609.00	2.75
330	600977	中国电影	1,488,182.00	2.73
331	600536	中国软件	1,487,580.00	2.73
332	688223	晶科能源	1,474,761.48	2.70
333	600986	浙文互联	1,462,000.00	2.68
334	600138	中青旅	1,454,251.00	2.67
335	601127	赛力斯	1,449,114.00	2.66
336	600200	江苏吴中	1,426,921.63	2.62
337	688159	有方科技	1,379,466.86	2.53
338	300853	申昊科技	1,357,855.00	2.49
339	300482	万孚生物	1,331,658.00	2.44
340	002968	新大正	1,299,982.00	2.38
341	300773	拉卡拉	1,280,600.00	2.35
342	300059	东方财富	1,258,200.00	2.31
343	600398	海澜之家	1,244,400.00	2.28
344	300965	恒宇信通	1,221,689.00	2.24

345	600481	双良节能	1,207,430.00	2.21
346	300471	厚普股份	1,182,158.00	2.17
347	002419	天虹股份	1,180,891.93	2.17
348	09996	沛嘉医疗-B	1,173,249.87	2.15
349	00388	香港交易所	1,167,662.66	2.14
350	600326	西藏天路	1,156,872.99	2.12
351	300841	康华生物	1,151,791.24	2.11
352	600859	王府井	1,132,272.00	2.08
353	688175	高凌信息	1,126,010.80	2.07
354	300253	卫宁健康	1,125,327.00	2.06
355	600918	中泰证券	1,119,434.00	2.05
356	601088	中国神华	1,111,200.00	2.04
357	002745	木林森	1,105,200.00	2.03
358	688030	山石网科	1,093,174.00	2.00

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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600483	福能股份	42,155,118.48	77.31
2	000002	万科 A	31,388,517.58	57.57
3	603708	家家悦	29,205,238.28	53.56
4	300937	药易购	26,651,435.30	48.88
5	603338	浙江鼎力	23,801,105.00	43.65
6	688131	皓元医药	22,610,958.13	41.47
7	001979	招商蛇口	21,440,342.00	39.32
8	600867	通化东宝	20,597,832.48	37.78
9	301045	天禄科技	19,544,219.00	35.84
10	002780	三夫户外	19,387,213.00	35.56
11	688786	悦安新材	18,961,166.06	34.77
12	300031	宝通科技	18,898,797.00	34.66
13	002286	保龄宝	18,685,928.00	34.27
14	688313	仕佳光子	18,427,254.82	33.80
15	603378	亚士创能	18,054,876.04	33.11
16	300873	海晨股份	17,941,027.51	32.90
17	300444	双杰电气	17,929,973.06	32.88
18	603260	合盛硅业	17,717,447.00	32.49



19	603986	兆易创新	17,443,492.72	31.99
20	600966	博汇纸业	17,097,097.86	31.36
21	603773	沃格光电	16,481,539.70	30.23
22	605589	圣泉集团	16,426,179.00	30.13
23	002975	博杰股份	16,386,056.40	30.05
24	300837	浙矿股份	16,380,024.00	30.04
25	002360	同德化工	16,080,118.00	29.49
26	600201	生物股份	15,993,048.00	29.33
27	002695	煌上煌	15,847,854.82	29.06
28	688355	明志科技	15,739,073.22	28.87
29	002425	凯撒文化	15,687,320.00	28.77
30	300759	康龙化成	15,504,520.50	28.43
31	002812	恩捷股份	15,469,453.25	28.37
32	002521	齐峰新材	15,464,320.00	28.36
33	688608	恒玄科技	15,407,538.75	28.26
34	600547	山东黄金	15,316,162.28	28.09
35	002185	华天科技	15,061,134.72	27.62
36	301160	翔楼新材	15,050,785.00	27.60
37	603309	维力医疗	14,954,874.70	27.43
38	603823	百合花	14,941,843.74	27.40
39	300761	立华股份	14,675,962.20	26.92
40	002415	海康威视	14,659,773.00	26.89
41	688010	福光股份	14,286,962.14	26.20
42	688093	世华科技	14,216,390.07	26.07
43	002773	康弘药业	14,096,250.49	25.85
44	002537	海联金汇	14,006,735.00	25.69
45	603087	甘李药业	13,930,275.00	25.55
46	301349	信德新材	13,925,319.00	25.54
47	300785	值得买	13,625,094.00	24.99
48	002833	弘亚数控	13,571,775.52	24.89
49	601012	隆基绿能	13,486,859.00	24.73
50	300143	盈康生命	13,327,104.00	24.44
51	688266	泽璟制药	13,288,272.29	24.37
52	300842	帝科股份	13,161,804.05	24.14
53	02380	中国电力	12,789,574.89	23.46
54	002661	克明食品	12,496,768.30	22.92
55	000926	福星股份	12,458,503.00	22.85
56	600433	冠豪高新	12,412,313.00	22.76

57	300540	蜀道装备	12,311,337.00	22.58
58	600642	申能股份	12,207,160.09	22.39
59	002252	上海莱士	11,981,234.00	21.97
60	688358	祥生医疗	11,948,755.84	21.91
61	300818	耐普矿机	11,939,320.00	21.90
62	002757	南兴股份	11,933,498.23	21.89
63	300122	智飞生物	11,872,423.00	21.77
64	600176	中国巨石	11,673,513.28	21.41
65	603019	中科曙光	11,584,234.00	21.25
66	832469	富恒新材	11,508,974.87	21.11
67	002567	唐人神	11,299,956.00	20.72
68	300123	亚光科技	11,049,646.00	20.26
69	688169	石头科技	10,841,824.16	19.88
70	603259	药明康德	10,841,817.78	19.88
71	300404	博济医药	10,708,039.40	19.64
72	002899	英派斯	10,593,008.00	19.43
73	300953	震裕科技	10,521,267.00	19.30
74	002484	江海股份	10,499,204.15	19.26
75	300238	冠昊生物	10,488,267.00	19.24
76	688529	豪森智能	10,468,516.42	19.20
77	300792	壹网壹创	10,463,907.00	19.19
78	300394	天孚通信	10,452,725.00	19.17
79	603301	振德医疗	10,431,149.00	19.13
80	688981	中芯国际	10,349,189.70	18.98
81	300058	蓝色光标	10,304,000.00	18.90
82	603869	新智认知	10,296,265.00	18.88
83	300552	万集科技	10,270,701.82	18.84
84	603890	春秋电子	10,114,228.00	18.55
85	600711	盛屯矿业	10,077,573.00	18.48
86	605007	五洲特纸	10,060,439.00	18.45
87	002402	和而泰	9,842,033.00	18.05
88	300280	紫天科技	9,818,573.00	18.01
89	002606	大连电瓷	9,801,805.96	17.98
90	600211	西藏药业	9,781,111.00	17.94
91	688669	聚石化学	9,776,334.39	17.93
92	003029	吉大正元	9,702,542.00	17.79
93	688511	天微电子	9,574,626.11	17.56
94	002465	海格通信	9,549,422.00	17.51

95	600570	恒生电子	9,513,317.56	17.45
96	603112	华翔股份	9,510,339.00	17.44
97	002637	赞宇科技	9,417,517.00	17.27
98	688680	海优新材	9,409,514.67	17.26
99	688233	神工股份	9,376,846.81	17.20
100	002572	索菲亚	9,245,927.00	16.96
101	600351	亚宝药业	9,224,623.00	16.92
102	688005	容百科技	8,947,900.47	16.41
103	000876	新希望	8,892,080.00	16.31
104	002353	杰瑞股份	8,849,338.00	16.23
105	603900	莱绅通灵	8,829,100.00	16.19
106	600267	海正药业	8,782,621.49	16.11
107	688071	华依科技	8,661,025.14	15.88
108	688789	宏华数科	8,641,084.08	15.85
109	600215	派斯林	8,634,288.00	15.84
110	002919	名臣健康	8,632,176.52	15.83
111	002985	北摩高科	8,620,814.74	15.81
112	301060	兰卫医学	8,591,806.11	15.76
113	300762	上海瀚讯	8,514,142.00	15.61
114	688329	艾隆科技	8,473,401.16	15.54
115	301127	天源环保	8,451,662.61	15.50
116	688498	源杰科技	8,434,989.92	15.47
117	002036	联创电子	8,417,739.00	15.44
118	300243	瑞丰高材	8,379,221.00	15.37
119	688633	星球石墨	8,359,178.59	15.33
120	002352	顺丰控股	8,306,958.00	15.23
121	688466	金科环境	8,304,304.58	15.23
122	300007	汉威科技	8,284,636.00	15.19
123	000672	上峰水泥	8,227,515.40	15.09
124	002460	赣锋锂业	8,189,970.00	15.02
125	300594	朗进科技	8,109,775.00	14.87
126	688121	卓然股份	8,051,673.65	14.77
127	000966	长源电力	8,008,223.96	14.69
128	300055	万邦达	8,005,897.00	14.68
129	002373	千方科技	7,991,244.00	14.66
130	002582	好想你	7,962,688.00	14.60
131	01119	创梦天地	7,894,557.21	14.48
132	300145	中金环境	7,875,349.00	14.44

133	688229	博睿数据	7,869,363.51	14.43
134	600021	上海电力	7,861,959.74	14.42
135	300624	万兴科技	7,823,651.41	14.35
136	600460	士兰微	7,727,779.00	14.17
137	300102	乾照光电	7,717,082.00	14.15
138	002487	大金重工	7,715,409.00	14.15
139	002895	川恒股份	7,707,690.00	14.14
140	300308	中际旭创	7,686,502.64	14.10
141	601390	中国中铁	7,679,642.00	14.08
142	002142	宁波银行	7,626,200.80	13.99
143	603020	爱普股份	7,616,659.00	13.97
144	002709	天赐材料	7,486,671.00	13.73
145	600567	山鹰国际	7,475,685.00	13.71
146	688116	天奈科技	7,452,680.69	13.67
147	605068	明新旭腾	7,451,902.00	13.67
148	600258	首旅酒店	7,447,411.00	13.66
149	300802	矩子科技	7,446,893.76	13.66
150	300919	中伟股份	7,373,091.00	13.52
151	688508	芯朋微	7,359,207.58	13.50
152	09992	泡泡玛特	7,350,209.12	13.48
153	601186	中国铁建	7,305,319.00	13.40
154	03690	美团-W	7,294,943.15	13.38
155	002675	东诚药业	7,257,196.00	13.31
156	600596	新安股份	7,160,796.00	13.13
157	301220	亚香股份	7,120,005.88	13.06
158	601601	中国太保	7,113,691.00	13.05
159	300872	天阳科技	7,097,520.99	13.02
160	000710	贝瑞基因	7,038,376.00	12.91
161	002078	太阳纸业	7,035,277.00	12.90
162	300219	鸿利智汇	7,034,246.00	12.90
163	600718	东软集团	6,892,074.00	12.64
164	000403	派林生物	6,890,437.29	12.64
165	300379	东方通	6,735,316.12	12.35
166	603396	金辰股份	6,713,771.00	12.31
167	688312	燕麦科技	6,653,403.77	12.20
168	002151	北斗星通	6,602,364.00	12.11
169	688152	麒麟信安	6,568,007.17	12.05
170	300375	鹏翎股份	6,561,123.00	12.03

171	688028	沃尔德	6,446,649.36	11.82
172	002933	新兴装备	6,239,211.00	11.44
173	002970	锐明技术	6,194,006.00	11.36
174	002541	鸿路钢构	6,134,610.68	11.25
175	300464	星徽股份	6,118,538.00	11.22
176	600346	恒力石化	6,094,110.00	11.18
177	300348	长亮科技	5,989,960.25	10.99
178	688580	伟思医疗	5,911,735.99	10.84
179	000735	罗牛山	5,858,280.00	10.74
180	002127	南极电商	5,824,171.00	10.68
181	600079	人福医药	5,795,795.00	10.63
182	300251	光线传媒	5,793,370.84	10.62
183	002372	伟星新材	5,764,559.00	10.57
184	600141	兴发集团	5,559,108.00	10.20
185	688609	九联科技	5,542,331.03	10.16
186	688012	中微公司	5,401,837.38	9.91
187	688336	三生国健	5,279,954.54	9.68
188	300158	振东制药	5,245,242.42	9.62
189	002819	东方中科	5,164,568.00	9.47
190	601066	中信建投	5,141,815.00	9.43
191	300570	太辰光	5,106,746.00	9.37
192	688039	当虹科技	5,088,317.75	9.33
193	688521	芯原股份	5,083,689.39	9.32
194	300193	佳士科技	5,062,040.00	9.28
195	301149	隆华新材	4,984,137.00	9.14
196	603813	原尚股份	4,933,803.00	9.05
197	001228	永泰运	4,872,551.00	8.94
198	688787	海天瑞声	4,785,530.80	8.78
199	688046	药康生物	4,775,767.05	8.76
200	688170	德龙激光	4,741,643.91	8.70
201	000952	广济药业	4,738,394.00	8.69
202	603218	日月股份	4,723,416.00	8.66
203	000887	中鼎股份	4,694,861.00	8.61
204	300078	思创医惠	4,627,934.00	8.49
205	605377	华旺科技	4,625,811.00	8.48
206	600009	上海机场	4,609,254.00	8.45
207	600810	神马股份	4,529,705.80	8.31
208	300994	久祺股份	4,483,416.20	8.22

209	688766	普冉股份	4,467,498.04	8.19
210	601800	中国交建	4,417,414.00	8.10
211	688011	新光光电	4,404,154.81	8.08
212	000950	重药控股	4,373,672.00	8.02
213	300026	红日药业	4,341,209.00	7.96
214	601236	红塔证券	4,210,579.59	7.72
215	600563	法拉电子	4,149,550.00	7.61
216	603225	新凤鸣	4,087,914.34	7.50
217	603600	永艺股份	4,048,017.58	7.42
218	00700	腾讯控股	3,980,491.33	7.30
219	600557	康缘药业	3,965,569.00	7.27
220	605178	时空科技	3,949,461.20	7.24
221	688316	青云科技	3,923,732.27	7.20
222	300443	金雷股份	3,908,135.00	7.17
223	601688	华泰证券	3,871,192.00	7.10
224	001311	多利科技	3,869,412.00	7.10
225	601865	福莱特	3,800,320.00	6.97
226	300578	会畅通讯	3,748,147.00	6.87
227	603529	爱玛科技	3,727,798.00	6.84
228	601888	中国中免	3,711,356.00	6.81
229	600583	海油工程	3,702,104.00	6.79
230	603220	中贝通信	3,675,514.00	6.74
231	688598	金博股份	3,631,503.40	6.66
232	600746	江苏索普	3,619,611.00	6.64
233	002977	天箭科技	3,571,394.28	6.55
234	600795	国电电力	3,544,911.00	6.50
235	300976	达瑞电子	3,536,322.00	6.49
236	688073	毕得医药	3,362,506.34	6.17
237	301283	聚胶股份	3,329,622.55	6.11
238	001223	欧克科技	3,284,561.00	6.02
239	300846	首都在线	3,282,593.18	6.02
240	301155	海力风电	3,266,428.00	5.99
241	002101	广东鸿图	3,212,609.50	5.89
242	603313	梦百合	3,194,098.00	5.86
243	002938	鹏鼎控股	3,192,947.00	5.86
244	300959	线上线下	3,183,423.48	5.84
245	300809	华辰装备	3,177,088.00	5.83
246	600489	中金黄金	3,132,620.00	5.75

247	002317	众生药业	3,123,854.00	5.73
248	300129	泰胜风能	3,102,574.17	5.69
249	688356	键凯科技	3,083,028.13	5.65
250	603882	金域医学	3,053,978.00	5.60
251	688081	兴图新科	3,014,329.12	5.53
252	603081	大丰实业	2,996,616.00	5.50
253	300196	长海股份	2,993,560.00	5.49
254	603233	大参林	2,970,953.00	5.45
255	688097	博众精工	2,970,929.18	5.45
256	301548	崇德科技	2,872,367.00	5.27
257	600376	首开股份	2,852,900.00	5.23
258	300320	海达股份	2,835,678.00	5.20
259	300166	东方国信	2,823,787.00	5.18
260	300353	东土科技	2,800,670.00	5.14
261	603296	华勤技术	2,744,664.78	5.03
262	300223	北京君正	2,721,253.00	4.99
263	300763	锦浪科技	2,692,923.00	4.94
264	600383	金地集团	2,692,442.00	4.94
265	600152	维科技术	2,679,536.00	4.91
266	600115	中国东航	2,647,550.00	4.86
267	688418	震有科技	2,611,572.74	4.79
268	688270	臻镭科技	2,551,329.86	4.68
269	688772	珠海冠宇	2,493,721.02	4.57
270	06049	保利物业	2,488,261.56	4.56
271	603956	威派格	2,436,581.00	4.47
272	688793	倍轻松	2,384,236.30	4.37
273	300254	仟源医药	2,351,641.00	4.31
274	300897	山科智能	2,283,145.00	4.19
275	601500	通用股份	2,269,500.00	4.16
276	603881	数据港	2,232,273.28	4.09
277	603068	博通集成	2,230,644.00	4.09
278	300322	硕贝德	2,184,225.00	4.01
279	688159	有方科技	2,170,958.18	3.98
280	300701	森霸传感	2,145,553.00	3.93
281	00836	华润电力	2,121,650.62	3.89
282	688526	科前生物	2,100,148.94	3.85
283	688075	安旭生物	2,054,570.45	3.77
284	300408	三环集团	2,028,121.00	3.72

285	301013	利和兴	2,028,012.00	3.72
286	688115	思林杰	2,013,390.37	3.69
287	000923	河钢资源	2,000,414.00	3.67
288	600918	中泰证券	1,965,523.00	3.60
289	605166	聚合顺	1,942,717.00	3.56
290	688282	理工导航	1,938,575.50	3.56
291	00688	中国海外发展	1,917,045.78	3.52
292	300323	华灿光电	1,911,026.00	3.50
293	301035	润丰股份	1,875,037.00	3.44
294	605081	太和水	1,853,231.50	3.40
295	002065	东华软件	1,837,300.00	3.37
296	600802	福建水泥	1,803,496.80	3.31
297	300661	圣邦股份	1,778,703.00	3.26
298	002968	新大正	1,679,610.00	3.08
299	605018	长华集团	1,644,783.00	3.02
300	002670	国盛金控	1,631,000.00	2.99
301	600837	海通证券	1,589,960.00	2.92
302	603416	信捷电气	1,566,654.00	2.87
303	301062	上海艾录	1,554,881.00	2.85
304	300853	申昊科技	1,546,181.00	2.84
305	600023	浙能电力	1,516,819.00	2.78
306	600536	中国软件	1,500,582.00	2.75
307	688223	晶科能源	1,500,239.87	2.75
308	600138	中青旅	1,491,660.00	2.74
309	300099	尤洛卡	1,487,973.00	2.73
310	600977	中国电影	1,484,879.00	2.72
311	601696	中银证券	1,449,400.00	2.66
312	300773	拉卡拉	1,432,576.50	2.63
313	000560	我爱我家	1,409,800.00	2.59
314	601127	赛力斯	1,405,484.00	2.58
315	000913	钱江摩托	1,386,922.00	2.54
316	600398	海澜之家	1,374,200.00	2.52
317	300482	万孚生物	1,344,222.92	2.47
318	300775	三角防务	1,342,250.00	2.46
319	000975	银泰黄金	1,341,856.00	2.46
320	300383	光环新网	1,338,100.00	2.45
321	600200	江苏吴中	1,310,094.00	2.40
322	600986	浙文互联	1,239,187.00	2.27



323	600481	双良节能	1,239,076.00	2.27
324	300059	东方财富	1,224,600.00	2.25
325	600098	广州发展	1,219,800.00	2.24
326	300471	厚普股份	1,217,480.00	2.23
327	00388	香港交易所	1,179,024.02	2.16
328	688175	高凌信息	1,155,578.95	2.12
329	002419	天虹股份	1,144,931.00	2.10
330	300965	恒宇信通	1,136,495.00	2.08
331	600326	西藏天路	1,127,941.00	2.07
332	601088	中国神华	1,126,594.00	2.07
333	600859	王府井	1,116,042.00	2.05
334	002745	木林森	1,105,320.00	2.03
335	300841	康华生物	1,099,511.00	2.02

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。

### 8.4.3 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	3,077,265,171.94
卖出股票收入（成交）总额	2,566,789,601.04

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。

### 8.5 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。

### 8.6 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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

本基金本报告期末未持有权证投资。

### 8.10 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，提高投资组合的运作效率。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	711,965.33
2	应收清算款	11,242,302.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,378,445.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,332,713.63

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 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未存在流通受限情况。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
中邮未来成长混合 A	51,127	4,801.31	111,442,059.30	45.40%	134,034,427.79	54.60%
中邮未来成长混合 C	17,246	18,737.21	134,085,874.70	41.49%	189,056,108.99	58.51%
合计	68,373	8,316.42	245,527,934.00	43.18%	323,090,536.78	56.82%

### 9.2 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	中邮未来成长混合 A	1,754,429.90	0.71%
	中邮未来成长混合 C	97,281.56	0.03%
	合计	1,851,711.46	0.33%

### 9.3 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	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	中邮未来成长混合 A	50~100
	中邮未来成长混合 C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	中邮未来成长混合 A	50~100
	中邮未来成长混合 C	0
	合计	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中邮未来成长混合 A	中邮未来成长混合 C
基金合同生效日（2021年4月8日）基金份额总额	77,368,501.28	184,574,657.88
本报告期期初基金份额总额	53,679,663.48	7,021,219.08
本报告期基金总申购份额	263,379,762.17	781,554,063.33
减:本报告期基金总赎回份额	71,582,938.56	465,433,298.72
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	245,476,487.09	323,141,983.69

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 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

基金托管人于 2023 年 5 月 17 日发布公告，自 2023 年 5 月 10 日起丁文忠先生不再担任基金托管部门总经理；自 2023 年 5 月 10 日起聘任赵刚先生为基金托管部门总经理。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。报告期内应支付给会计师事务所的审计费用为人民币肆万元整，目前该会计师事务所已连续为本基金提供审计服务三个会计年度。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对其采取责令整改等行政监管措施，并对公司相关负责人员采取行政监管措施。公司高度重视，已制定并实施相关整改措施，预计 2024 年 3 月可向北京监管局提交整改验收报告。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期托管人及其高级管理人员无受到稽查或处罚情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	
东北证券	2	2,718,883,083.93	48.17%	2,540,203.66	53.81%	-
开源证券	2	1,513,646,228.43	26.82%	1,129,031.75	23.92%	-

东吴证券	2	978,310,227.77	17.33%	729,728.17	15.46%	-
国海证券	2	411,880,339.11	7.30%	307,222.69	6.51%	-
中金公司	1	21,240,476.64	0.38%	14,253.49	0.30%	-
华福证券	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。

### 11.7.2 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
东北证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	中邮未来成长混合型证券投资	规定媒介	2023年1月20日

	资基金 2022 年第 4 季度报告		
2	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 2 月 6 日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加博时财富基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 2 月 6 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北京创金启富基金销售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	2023 年 2 月 21 日
5	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加南京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	2023 年 2 月 24 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上海中欧财富基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 3 月 23 日
7	中邮未来成长混合型证券投资基金 2022 年年度报告	规定媒介	2023 年 3 月 30 日
8	中邮未来成长混合型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	规定媒介	2023 年 4 月 22 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在国信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	2023 年 4 月 24 日
10	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 5 月 15 日
11	中邮未来成长混合型证券投资基金暂停大额申购(含定期定额投资、转换转入)业务公告	规定媒介	2023 年 6 月 20 日

12	中邮创业基金管理股份有限公司关于在直销中心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	2023 年 6 月 20 日
13	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加上海陆享基金销售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	2023 年 6 月 30 日
14	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华泰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	2023 年 7 月 6 日
15	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东方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	2023 年 7 月 13 日
16	中邮未来成长混合型证券投资基金 2023 年第 2 季度报告	规定媒介	2023 年 7 月 21 日
17	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家财富基金销售(天津)有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 7 月 28 日
18	中邮创业基金管理股份有限公司关于调整中邮未来成长混合型证券投资基金在南京证券股份有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2023 年 8 月 24 日
19	中邮未来成长混合型证券投资基金基金合同	规定媒介	2023 年 8 月 25 日
20	中邮未来成长混合型证券投资基金托管协议	规定媒介	2023 年 8 月 25 日
21	中邮未来成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)	规定媒介	2023 年 8 月 25 日
22	中邮创业基金管理股份有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	规定媒介	2023 年 8 月 25 日
23	中邮未来成长混合型证券投资基金(中邮未来成长混合 A 份额)基金产品资料概要(更新)	规定媒介	2023 年 8 月 25 日



24	中邮未来成长混合型证券投资基金（中邮未来成长混合 C 份额）基金产品资料概要（更新）	规定媒介	2023 年 8 月 25 日
25	中邮未来成长混合型证券投资基金 2023 年中期报告	规定媒介	2023 年 8 月 31 日
26	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通平台为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023 年 9 月 20 日
27	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加麦高证券有限责任公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 10 月 10 日
28	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加贵州省贵文文化基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 10 月 25 日
29	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加和信证券投资咨询股份有限公司为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 10 月 25 日
30	中邮未来成长混合型证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	规定媒介	2023 年 10 月 25 日
31	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加中银国际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	2023 年 12 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20230101-20230517	26,526,744.96	18,407,425.81	-	44,934,170.77	7.90%
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。							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮未来成长混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮未来成长混合型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮未来成长混合型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮未来成长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报刊上披露的各项公告

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

### 13.3 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 3 月 28 日