

中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：徽商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金管理人-中邮创业基金管理股份有限公司的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本中期报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人徽商银行股份有限公司（简称：徽商银行）根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	38
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.11 投资组合报告附注.....	42
§8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	44
§9 开放式基金份额变动.....	45
§10 重大事件揭示.....	46
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	46
10.4 基金投资策略的改变.....	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	46
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.....	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	49

§12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	50
12.3 查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金	
基金简称	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数	
基金主代码	007208	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 4 月 15 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	徽商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	496,908,465.25 份	
下属分级基金的基金简称:	中邮中债-1-3 年久期央 企 20 债券指数 A	中邮中债-1-3 年久期央 企 20 债券指数 C
下属分级基金的交易代码:	007208	007209
报告期末下属分级基金的份额总额	496,904,956.54 份	3,508.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金力争追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，将年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	<p>本基金为指数基金，主要采用抽样复制和动态最优化的方法，投资于标的指数中具有代表性和流动性的成份券和备选成份券，或选择非成份券作为替代，构造与标的指数风险收益特征相似的资产组合，以实现对标指数的有效跟踪。在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、优化抽样复制策略</p> <p>本基金通过对标的指数中各成份企业债、公司债、中期票据的历史数据和流动性分析，选取流动性较好的债券构建组合，对标的指数的久期等指标进行跟踪，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>对于市场流动性不足、因法律法规原因个别成份债券被限制投资等情况，本基金无法获得对个别成份债券足够数量的投资时，基金管理人将通过投资其他非成份债券进行替代。</p> <p>3、其他债券投资策略</p> <p>为了在一定程度上弥补基金费用，基金管理人还可以在控制风险的前提下，使用其他投资策略。例如，基金管理人可以利用银行间市场与交易所市场，或债券一、二级市场间的套利机会进行跨市场套利；还可以使用事件驱动策略，即通过分析重大事件发生对投资标的定价的影响而进行套利；也可以使用公允价值策略，即通过对债券市场价格与模型价格偏离度的研究，采取相应的增/减仓操作；或运用杠杆原理进行回购交易等。</p>
业绩比较基准	本基金整体业绩比较基准为：中债-1-3 年久期央企 20 债券指数收益率×95% + 同期银行人民币活期存款利率（税后）×5%

风险收益特征	本基金是债券型基金，其预期风险和预期收益低于股票基金、混合基金，高于货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--------	---

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	徽商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	侯玉春
	联系电话	010-82295160—157
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn
客户服务电话	010-58511618	40088-96588
传真	010-82295155	0551-65970481
注册地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座
办公地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	安徽省合肥市安庆路 79 号天徽大厦 A 座
邮政编码	100013	230001
法定代表人	毕劲松	吴学民

2.4 信息披露方式

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

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

基金级别	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数 A	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)	报告期(2021年1月1日 - 2021年6月30日)
本期已实现收益	6,292,559.81	41.32
本期利润	11,665,362.28	79.04
加权平均基金份额本期利润	0.0235	0.0224
本期加权平均净值利润率	2.28%	2.18%
本期基金份额净值增长率	2.31%	2.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)	
期末可供分配利润	17,272,415.48	111.24
期末可供分配基金份额利润	0.0348	0.0317
期末基金资产净值	516,568,225.35	3,636.75
期末基金份额净值	1.0396	1.0365
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	7.19%	6.76%

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

中邮中债-1-3年久期央企20债券指数 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.18%	0.03%	-0.02%	0.02%	0.20%	0.01%
过去三个月	1.21%	0.02%	0.67%	0.03%	0.54%	-0.01%
过去六个月	2.31%	0.03%	1.33%	0.03%	0.98%	0.00%
过去一年	2.98%	0.06%	1.17%	0.05%	1.81%	0.01%
自基金合同生效起至今	7.19%	0.05%	3.73%	0.05%	3.46%	0.00%

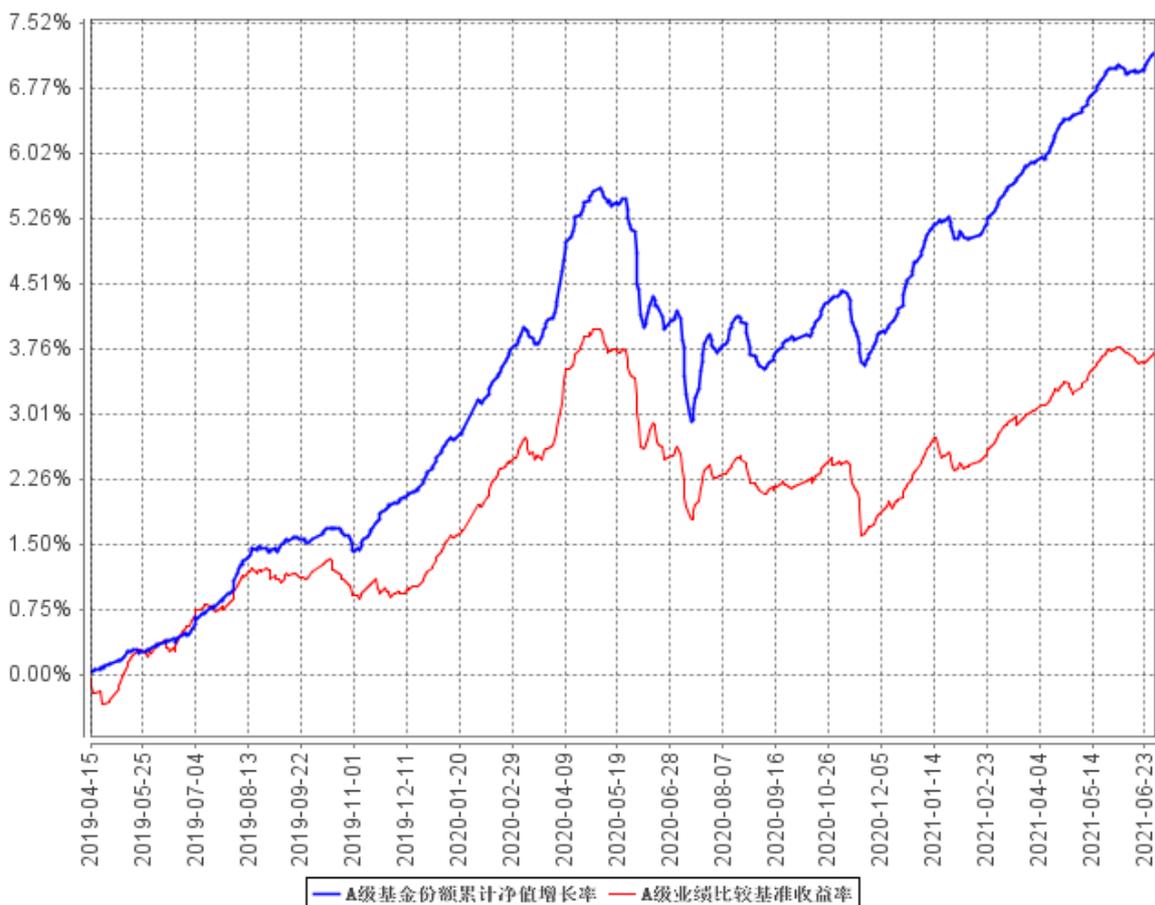
中邮中债-1-3年久期央企20债券指数C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.17%	0.02%	-0.02%	0.02%	0.19%	0.00%
过去三个月	1.16%	0.02%	0.67%	0.03%	0.49%	-0.01%
过去六个月	2.21%	0.03%	1.33%	0.03%	0.88%	0.00%
过去一年	2.78%	0.06%	1.17%	0.05%	1.61%	0.01%
自基金合同生效起至今	6.76%	0.05%	3.73%	0.05%	3.03%	0.00%

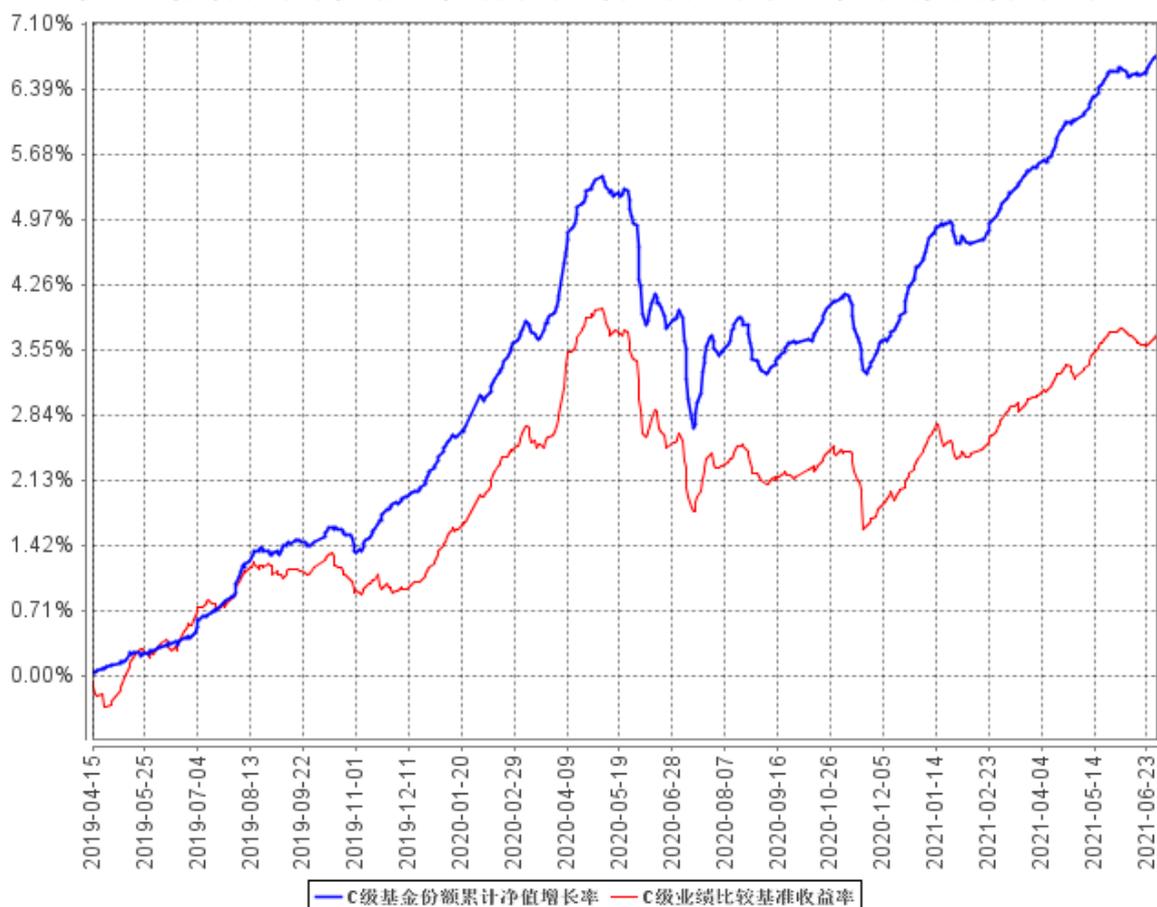
注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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



注：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 2021 年 6 月 30 日，本公司共管理 49 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、中邮睿利增强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、中邮中证价值回报量化策略指数型发起式证券投资基金、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、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮研究精选混合型证券投资基金、中邮科技创新精选混合型证券投资基金、中邮优享一年定期开放混合型证券投资基金、中邮价值精选混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮未来成长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	说明
----	----	-----------------	-----	----

		任职日期	离任日期	业年限	
闫宜乘	基金经 理	2020 年 4 月 30 日	-	6 年	曾任中国工商银行股份有限公司北京市分行营业部对公客户经理、中信建投证券股份有限公司资金运营部高级经理、中邮创业基金管理股份有限公司中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、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、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮现金驿站货币市场基金基金经理助理、中邮纯债恒利债券型证券投资基金基金经理。现任中邮货币市场基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金基金经理。

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

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

投资运作方面，上半年经济经历了疫情小范围反复，但整体控制得当，并未阻碍国内复苏进程，去年下半年开始的强出口出现转弱迹象，但整体仍在高位，经济数据在低基数的效应下大幅增长，我们维持经济增速前高后低的判断。债券市场的表现方面，资金面的超预期宽松和利率债供给高峰的一再推迟使得债券市场对利空表现有所钝化，上半年市场利率震荡下行，收益率曲线信用利差收缩。

报告期内，我们维持了短久期票息策略，资金面持续偏松的情况下适当提升了杠杆水平。展望下半年，利率供给节奏滞后，三季度地方债供给压力较大，债券市场有一定的调整压力，我们

将维持信用票息策略，并择机参与成份债长端波段交易，适当控制杠杆和久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 A 基金份额净值为 1.0396 元，累计净值为 1.0706 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.31%；截至本报告期末中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 C 基金份额净值为 1.0365 元，累计净值为 1.0665 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.21%；同期业绩比较基准收益率为 1.33%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年，预计海外经济受益疫苗接种开始复苏，全球总需求温和扩张，美联储缩表提上日程，病毒变异或仍有零星影响但不改复苏趋势，原油价格受需求拉动呈现高位震荡，整体看 PPI 在短期冲高后进一步上行空间较小。国内方面，外海产能恢复较慢部分行业复产难度大使得出口边际回落但整体仍处高位，投资活动在偏严的地产政策下难以大幅好转，消费有望继续边际好转，但疫情对居民资产负债表的伤害仍，消费恢复至疫情前仍有难度。政策方面 7 月份的降准使得市场对过于一直偏紧预期有所弱化，但下半年 MLF 到期高峰叠加地方债放量发行仍将使得资金面临考验，预计资金价格围绕公开市场价格震荡中枢将有所抬升，长端方面，三季度地方债供给放量仍将对长端利率的走势造成影响，但利率长端大幅高于疫情前的状态难以持续，机构欠配仍较严重，冲高将是较好配置机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内根据相关法律法规、基金合同及基金运作情况，未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管人协议的规定，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核符合范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中邮中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	925,219.95	405,335.13
结算备付金		422,406.16	2,330,248.90
存出保证金		45,230.93	60,945.44
交易性金融资产	6.4.7.2	603,681,000.00	589,701,000.60
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		603,681,000.00	589,701,000.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	13,000,000.00
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	7,864,781.87	9,912,103.79
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		612,938,638.91	615,409,633.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		96,000,000.00	110,000,000.00
应付证券清算款		-	11,427.34
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		105,966.97	106,328.82
应付托管费		21,193.36	21,265.79
应付销售服务费		0.60	0.62
应付交易费用	6.4.7.7	4,326.61	5,850.00
应交税费		53,840.55	54,614.91

应付利息		26,060.31	36,972.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	155,388.41	266,651.73
负债合计		96,366,776.81	110,503,111.30
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	496,908,465.25	496,908,565.25
未分配利润	6.4.7.10	19,663,396.85	7,997,957.31
所有者权益合计		516,571,862.10	504,906,522.56
负债和所有者权益总计		612,938,638.91	615,409,633.86

注：报告截止日2021年6月30日，中邮中债-1-3年久期央企20债券指数A基金份额净值1.0396元，基金份额总额496,904,956.54份；中邮中债-1-3年久期央企20债券指数C基金份额净值1.0365元，基金份额总额3,508.71份。中邮中债-1-3年久期央企20债券指数份额总额合计为496,908,465.25份。

6.2 利润表

会计主体：中邮中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年1月1日至 2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
一、收入		13,386,011.43	12,512,397.18
1.利息收入		10,018,094.34	13,019,888.71
其中：存款利息收入	6.4.7.11	30,322.32	41,879.39
债券利息收入		9,950,935.95	12,977,334.25
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		36,836.07	675.07
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,004,923.10	3,419,950.98
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-2,004,923.10	3,419,950.98
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,372,840.19	-3,927,442.51
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-	-
减:二、费用		1,720,570.11	2,517,895.26
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	633,132.51	840,018.88
2. 托管费	6.4.10.2.2	126,626.48	168,003.73
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3.62	3.64
4. 交易费用	6.4.7.19	4,505.10	4,177.14
5. 利息支出		697,765.88	1,203,344.29
其中: 卖出回购金融资产支出		697,765.88	1,203,344.29
6. 税金及附加		34,496.99	44,918.43
7. 其他费用	6.4.7.20	224,039.53	257,429.15
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,665,441.32	9,994,501.92
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,665,441.32	9,994,501.92

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 中邮中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金

本报告期: 2021年1月1日至2021年6月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	496,908,565.25	7,997,957.31	504,906,522.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,665,441.32	11,665,441.32
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-100.00	-1.78	-101.78
其中: 1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-100.00	-1.78	-101.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-

基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	496,908,465.25	19,663,396.85	516,571,862.10
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	598,895,424.66	4,758,116.45	603,653,541.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,994,501.92	9,994,501.92
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	97,673,519.15	2,314,988.25	99,988,507.40
其中：1.基金申购款	97,683,891.77	2,315,108.23	99,999,000.00
2.基金赎回款	-10,372.62	-119.98	-10,492.60
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	696,568,943.81	17,067,606.62	713,636,550.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 张志名 唐亚明 佟珊
 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

中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金（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[2019]485 号《关于准予中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金注册的批复》批准进行募集，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金合同》发起，并于 2019 年 4 月 15 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 200,002,949.00 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2019)第 110ZC0050 号验资报告予以验证。《中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 4 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 200,002,949.00 份基金份额（其中 A 类基金份额为 200,000,139.00 份，C 类基金份额为 2,810.00 份）。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为徽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《中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份企业债、公司债、中期票据等。为更好地实现投资目标，基金还可投资于国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、债券回购、银行存款、货币市场工具以及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。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中标的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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》、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》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，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和所有者权益（基金净值）变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金无差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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. 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴 20% 的个人所得税；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。

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

3. 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。

4. 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	925,219.95
定期存款	-
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	-
合计：	925,219.95

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券			
交易所市场	282,626,404.67	281,876,000.00	-750,404.67

	银行间市场	321,668,630.81	321,805,000.00	136,369.19
	合计	604,295,035.48	603,681,000.00	-614,035.48
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		604,295,035.48	603,681,000.00	-614,035.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	165.44
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	190.10
应收债券利息	7,864,406.03
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	20.30
合计	7,864,781.87

6.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	4,326.61
合计	4,326.61

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	51,250.06
合计	155,388.41

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

中邮中债-1-3年久期央企20债券指数A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	496,904,956.54	496,904,956.54
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	496,904,956.54	496,904,956.54

金额单位：人民币元

中邮中债-1-3年久期央企20债券指数C	
项目	本期

	2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	3,608.71	3,608.71
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-100.00	-100.00
- 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	3,508.71	3,508.71

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

中邮中债-1-3年久期央企20债券指数A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,979,855.67	-2,981,949.14	7,997,906.53
本期利润	6,292,559.81	5,372,802.47	11,665,362.28
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,272,415.48	2,390,853.33	19,663,268.81

单位：人民币元

中邮中债-1-3年久期央企20债券指数C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	72.44	-21.66	50.78
本期利润	41.32	37.72	79.04
本期基金份额交易产生的变动数	-2.52	0.74	-1.78
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-2.52	0.74	-1.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	111.24	16.80	128.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	17,163.68
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	12,735.05
其他	423.59
合计	30,322.32

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期末未持有股票。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,004,923.10
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	-2,004,923.10

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	285,205,027.37
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	283,920,918.16
减：应收利息总额	3,289,032.31
买卖债券差价收入	-2,004,923.10

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末持有资产支持证券投资。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期末持有贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期末持有衍生工具投资。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期无股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	5,372,840.19
——股票投资	-
——债券投资	5,372,840.19
——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	5,372,840.19

6.4.7.18 其他收入

本报告期内本基金无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	305.10

银行间市场交易费用	4,200.00
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	4,505.10

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	101,301.18
上清所债券账户维护费	9,000.00
中债债券账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	224,039.53

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

本报告期内本基金不存在或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至 2021 年 8 月 20 日，本基金不存在应披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中邮创业基金管理股份有限公司	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
徽商银行股份有限公司	基金托管人

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易的情况。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	633,132.51	840,018.88
其中：支付销售机构的客户维护费	3.81	16.15

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人报酬按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	126,626.48	168,003.73

注：支付基金托管人徽商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.1.3 销售服务费

本基金本报告期内未向关联方支付销售服务费。

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未与关联方发生银行间同业市场的债券交易（含回购）。

6.4.10.3 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**6.4.10.3.1 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。

6.4.10.3.2 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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期末基金管理人未运用固定资金投资本基金。

6.4.10.4.2 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持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 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
徽商银行股份有限公司	925,219.95	17,163.68	2,876,806.72	27,395.27

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期本基金未发生在承销期内参与认购关联方承销证券的情况。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2021 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

本期末本基金未持有股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 96,000,000.00 元,于 2021 年 07 月 06 日(先后)到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控和可承受。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理组织架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后,通过正式报告的方式,将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会,协助进行风险管理决策,以实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法,估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度;从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用的金融工具特征,通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告,参考压力测试结果,确定风险限度,及时对各种风险进行监督、分析和评估,并制定应对措施,将风险控制在预期可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	29,991,000.00
合计	-	29,991,000.00

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	573,626,000.00	559,710,000.60
AAA 以下	-	-
未评级	30,055,000.00	-
合计	603,681,000.00	559,710,000.60

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

在负债端，基金管理人详细分析本基金投资者类型、投资者结构、投资者风险偏好和历史申购与赎回数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者赎回需求，制定了健全有效的流动性风险压

力测试方法。当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整基金投资策略，预留充足现金头寸、确保基金组合资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。

如果遇到极端市场情形或发生巨额赎回情形，公司将采取本基金合同约定的巨额赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险指因受各种因素影响而引起的证券及其衍生品市场价格不利波动，使投资组合资产、公司资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金管理人定期对组合中债券投资部分面临的利率风险进行监控分析，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年6 月 30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	925,219.95	-	-	-	925,219.95
结算备付金	422,406.16	-	-	-	422,406.16
存出保证金	45,230.93	-	-	-	45,230.93
交易性金融资产	120,654,000.00	462,515,000.00	20,512,000.00	-	603,681,000.00
应收利息	-	-	-	-7,864,781.87	7,864,781.87

资产总计	122,046,857.04	462,515,000.00	20,512,000.00	7,864,781.87	612,938,638.91
负债					
卖出回购金融资产款	96,000,000.00	-	-	-	96,000,000.00
应付管理人报酬	-	-	-	105,966.97	105,966.97
应付托管费	-	-	-	21,193.36	21,193.36
应付销售服务费	-	-	-	0.60	0.60
应付交易费用	-	-	-	4,326.61	4,326.61
应付利息	-	-	-	26,060.31	26,060.31
应交税费	-	-	-	53,840.55	53,840.55
其他负债	-	-	-	155,388.41	155,388.41
负债总计	96,000,000.00	-	-	366,776.81	96,366,776.81
利率敏感度缺口	26,046,857.04	462,515,000.00	20,512,000.00	7,498,005.06	516,571,862.10
上年度末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行	405,335.13	-	-	-	405,335.13

存款					
结算 备付 金	2,330,248.90		-	-	2,330,248.90
存出 保证 金	60,945.44		-	-	60,945.44
交易 性金 融资 产	90,495,000.60	499,206,000.00		-	-589,701,000.60
买入 返售 金融 资产	13,000,000.00		-	-	13,000,000.00
应收 利息				-9,912,103.79	9,912,103.79
资产 总计	106,291,530.07	499,206,000.00		-9,912,103.79	615,409,633.86
负债					
卖出 回购 金融 资产 款	110,000,000.00		-	-	-110,000,000.00
应付 证券 清算 款				11,427.34	11,427.34
应付 管理 人报 酬				106,328.82	106,328.82
应付 托管 费				21,265.79	21,265.79
应付 销售 服务 费				0.62	0.62
应付 交易 费用				5,850.00	5,850.00
应付				36,972.09	36,972.09

利息					
应交 税费				54,614.91	54,614.91
其他 负债				266,651.73	266,651.73
负债 总计	110,000,000.00			503,111.30	110,503,111.30
利率 敏感 度缺 口	-3,708,469.93	499,206,000.00		-9,408,992.49	504,906,522.56

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变		
	2. 市场利率下降 25 个基点且其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	-2,785,055.87	-2,619,276.67
	2. 基金净资产变动	2,829,792.77	2,656,974.09

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。

本基金主要投资于标的指数的成份企业债、公司债、中期票据等。为更好地实现投资目标，基金还可投资于国内依法发行上市的国债、央行票据、政策性金融债、债券回购、银行存款、货币市场工具以及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：本基金投资于债券资产的比例不低于基金资产的 80%，其中标

的指数成份券和备选成份券的比例不低于本基金非现金基金资产的 80%；每个交易日日终，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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构变更上述投资品种的比例限制，在履行适当程序后，以变更后的比例为准，本基金的投资比例会做相应调整。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	-	-	-	-
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	603,681,000.00	116.86	589,701,000.60	116.79
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	603,681,000.00	116.86	589,701,000.60	116.79

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	2. 固定其它市场变量，当本基金基准下跌 1%		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	6,027,870.54	6,734,768.60
2. 基金净资产变动	-6,027,870.54	-6,734,768.60	

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，利用 2021 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 1.00。

6.4.14 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	603,681,000.00	98.49
	其中：债券	603,681,000.00	98.49
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,347,626.11	0.22
8	其他各项资产	7,910,012.80	1.29
9	合计	612,938,638.91	100.00

7.2 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

本基金本期末未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本期末未持有股票。

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

本基金本期末未持有股票。

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

本基金本期末未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本期末未持有股票。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	30,055,000.00	5.82
	其中：政策性金融债	30,055,000.00	5.82
4	企业债券	281,876,000.00	54.57
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	291,750,000.00	56.48
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	603,681,000.00	116.86

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	101900214	19 鞍钢集 MTN001	500,000	50,400,000.00	9.76
2	163458	20 新际 02	500,000	49,500,000.00	9.58
3	122358	15 际华 03	400,000	40,420,000.00	7.82
4	122244	12 大唐 01	300,000	30,993,000.00	6.00
5	155186	19 蓝星 02	300,000	30,129,000.00	5.83

注：期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有债券投资明细：

序号：1|债券代码：101900214|债券名称：19 鞍钢集 MTN001|数量：500,000|公允价值：

50,400,000.00|占基金净资产比例：9.76%；

序号：2|债券代码：163458|债券名称：20 新际 02|数量：500,000|公允价值：49,500,000.00|

占基金净资产比例：9.58%；

序号：3|债券代码：122358|债券名称：15 际华 03|数量：400,000|公允价值：40,420,000.00|

占基金净资产比例：7.82%；

序号：4|债券代码：122244|债券名称：12 大唐 01|数量：300,000|公允价值：30,993,000.00|

占基金净资产比例：6.00%；

序号：5|债券代码：155186|债券名称：19 蓝星 02|数量：300,000|公允价值：30,129,000.00|
占基金净资产比例：5.83%;

序号：6|债券代码：136734|债券名称：16 大唐 01|数量：300,000|公允价值：29,970,000.00|
占基金净资产比例：5.80%;

序号：7|债券代码：102000789|债券名称：20 鞍钢 MTN002|数量：300,000|公允价值：
29,589,000.00|占基金净资产比例：5.73%;

序号：8|债券代码：101800751|债券名称：18 中铝集 MTN002B|数量：200,000|公允价值：
20,866,000.00|占基金净资产比例：4.04%;

序号：9|债券代码：143805|债券名称：18 中铝 02|数量：200,000|公允价值：20,670,000.00|
占基金净资产比例：4.00%;

序号：10|债券代码：101900980|债券名称：19 中煤能源 MTN001|数量：200,000|公允价值：
20,512,000.00|占基金净资产比例：3.97%;

序号：11|债券代码：102001641|债券名称：20 中铝集 MTN002|数量：200,000|公允价值：
20,226,000.00|占基金净资产比例：3.92%;

序号：12|债券代码：102100611|债券名称：21 华侨城 MTN001|数量：200,000|公允价值：
20,142,000.00|占基金净资产比例：3.90%;

序号：13|债券代码：102100827|债券名称：21 中交建 MTN001（乡村振兴）|数量：200,000|公允
价值：20,038,000.00|占基金净资产比例：3.88%;

序号：14|债券代码：200216|债券名称：20 国开 16|数量：200,000|公允价值：20,034,000.00|
占基金净资产比例：3.88%;

序号：15|债券代码：163594|债券名称：20 诚通 13|数量：200,000|公允价值：20,004,000.00|
占基金净资产比例：3.87%;

序号：16|债券代码：102100938|债券名称：21 大唐发电 MTN001(可持续挂钩)|数量：200,000|
公允价值：19,988,000.00|占基金净资产比例：3.87%;

序号：17|债券代码：102000236|债券名称：20 中化工 MTN004A|数量：200,000|公允价值：
19,940,000.00|占基金净资产比例：3.86%;

序号：18|债券代码：163312|债券名称：20 中铝 02|数量：200,000|公允价值：19,920,000.00|
占基金净资产比例：3.86%;

序号：19|债券代码：163541|债券名称：20 诚通 10|数量：200,000|公允价值：19,812,000.00|
占基金净资产比例：3.84%;

序号：20|债券代码：112715|债券名称：18 蛇口 03|数量：100,000|公允价值：10,383,000.00|
占基金净资产比例：2.01%;

序号：21|债券代码：102002325|债券名称：20 招商蛇口 MTN003|数量：100,000|公允价值：
10,128,000.00|占基金净资产比例：1.96%;

序号：22|债券代码：101901023|债券名称：19 蓝星 MTN001|数量：100,000|公允价值：
10,117,000.00|占基金净资产比例：1.96%;

序号：23|债券代码：112886|债券名称：19 侨集 01|数量：100,000|公允价值：10,075,000.00|
占基金净资产比例：1.95%;

序号：24|债券代码：101900843|债券名称：19 中化工 MTN002|数量：100,000|公允价值：
10,070,000.00|占基金净资产比例：1.95%;

序号：25|债券代码：200314|债券名称：20 进出 14|数量：100,000|公允价值：10,021,000.00|
占基金净资产比例：1.94%;

序号：26|债券代码：102002155|债券名称：20 中化工 MTN011|数量：100,000|公允价值：
10,019,000.00|占基金净资产比例：1.94%;

序号：27|债券代码：102000330|债券名称：20 鞍钢 MTN001|数量：100,000|公允价值：
9,975,000.00|占基金净资产比例：1.93%;

序号：28|债券代码：102000651|债券名称：20 中煤能源 MTN001A|数量：100,000|公允价值：
9,871,000.00|占基金净资产比例：1.91%;

序号：29|债券代码：102000889|债券名称：20 鞍钢 MTN003|数量：100,000|公允价值：
9,869,000.00|占基金净资产比例：1.91%;

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

本基金本期末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

本基金本期末未持有贵金属投资。

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

本基金本期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

7.11.2 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

本报告期末本基金未持有股票。

7.11.3 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	45,230.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	7,864,781.87
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,910,012.80

7.11.4 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。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中邮中债-1-3年久期央企20债券指数A	15	33,126,997.10	496,903,917.10	100.00%	1,039.44	0.00%
中邮中债-1-3年久期央企20债券指数C	195	17.99	0.00	0.00%	3,508.71	100.00%
合计	210	2,366,230.79	496,903,917.10	100.00%	4,548.15	0.00%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数A	929.52	0.0002%
	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数C	110.00	3.1351%
	合计	1,039.52	0.0002%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 A	0
	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 A	0
	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 A	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 C
基金合同生效日（2019 年 4 月 15 日）基金份额总额	200,000,139.00	2,810.00
本报告期期初基金份额总额	496,904,956.54	3,608.71
本报告期基金总申购份额	-	-
减：本报告期基金总赎回份额	-	100.00
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	496,904,956.54	3,508.71

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未改聘为本基金进行审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
华泰证券	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。

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
华泰证券	142,045,538.34	100.00%	1,147,000,000.00	100.00%	-	-

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	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加费率优惠活动的公告	规定媒介	2021年6月30日
2	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金（中邮中债-1-3年久期央企20债券指数A份额）基金产品资料概要（更新）	规定媒介	2021年4月30日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于根据《侧袋机制指引》修改旗下债券型基金基金合同的公告	规定媒介	2021年4月30日
4	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金基金合同	规定媒介	2021年4月30日
5	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金托管协议	规定媒介	2021年4月30日
6	中邮中债-1-3年久期央企20债券指数证券投资基金招募说明书（更新）	规定媒介	2021年4月30日
7	中邮创业基金管理股份有限	规定媒介	2021年4月22日

	公司关于调整特定投资群体通过直销柜台申购旗下部分基金费率优惠方案的公告		
8	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定媒介	2021 年 4 月 22 日
9	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金(中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数 A 份额)基金产品资料概要(更新)	规定媒介	2021 年 3 月 30 日
10	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号-指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	规定媒介	2021 年 3 月 30 日
11	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金合同	规定媒介	2021 年 3 月 30 日
12	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金托管协议	规定媒介	2021 年 3 月 30 日
13	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金招募说明书(更新)	规定媒介	2021 年 3 月 30 日
14	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金 2020 年年度报告	规定媒介	2021 年 3 月 11 日
15	风险揭示书	规定媒介	2021 年 1 月 28 日
16	中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定媒介	2021 年 1 月 22 日

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20210101-20210630	399,220,025.33	-	-	399,220,025.33	80.34%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>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。</p>							

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中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金募集的文件
2. 《中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金基金合同》
3. 《中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金托管协议》
4. 《中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金招募说明书》
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 基金托管人业务资格批件、营业执照
7. 报告期内基金管理人在规定报刊上披露的各项公告

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

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

2021 年 8 月 31 日