

中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金 2022 年中期报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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。

基金托管人兴业银行股份有限公司（简称：兴业银行）根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2022 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..... | 8 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 9 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 9 |
| 3.2 基金净值表现..... | 9 |
| §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..... | 14 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 15 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... | 15 |
| §5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 16 |
| 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..... | 16 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... | 16 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 17 |
| 6.1 资产负债表..... | 17 |
| 6.2 利润表..... | 18 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表..... | 19 |

| | |
|--|-----------|
| 6.4 报表附注..... | 21 |
| §7 投资组合报告..... | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 42 |
| 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..... | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 43 |
| 7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... | 43 |
| 7.7 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明 细..... | 43 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 43 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 44 |
| 7.11 投资组合报告附注..... | 44 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 45 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 45 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 45 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况..... | 45 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 46 |
| §10 重大事件揭示..... | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 47 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 47 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 47 |
| 10.8 其他重大事件..... | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50 |
| 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..... | 50 |

| | |
|--------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 50 |
| §12 备查文件目录..... | 51 |
| 12.1 备查文件目录..... | 51 |
| 12.2 存放地点..... | 51 |
| 12.3 查阅方式..... | 51 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-----------------------|
| 基金名称 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金 |
| 基金简称 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券 |
| 基金主代码 | 008659 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 1 月 21 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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 7,999,992,492.53 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 本基金封闭期内采取买入持有到期投资策略，投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，力求基金资产的稳健增值。 |
| 投资策略 | <p>（一）封闭期投资策略：</p> <p>1、持有到期策略</p> <p>本基金以封闭期为周期进行投资运作。在封闭期内，本基金采取买入并持有到期的投资策略，所投金融资产以收取合同现金流量为目的并持有到期，所投资产到期日（或回售日）不得晚于封闭运作期到期日，力争基金资产在开放前可完全变现。本基金投资含回售权的债券时，应在投资该债券前，确定行使回售权或持有至到期的时间；债券到期日晚于封闭运作期到期日的，基金管理人应当行使回售权而不得持有至到期日。</p> <p>基金管理人可以基于持有人利益优先原则，在不违反《企业会计准则》的前提下，对尚未到期的固定收益类品种进行处置。</p> <p>2、杠杆投资策略</p> <p>本基金将在考虑债券投资的风险收益情况，以及回购成本等因素的情况下，在风险可控以及法律法规允许的范围内，通过债券回购，放大杠杆进行投资操作。本基金将在封闭期内进行杠杆投资，杠杆放大部分仍主要投资于剩余期限（或回售期限）不超过基金剩余封闭期的固定收益类工具，并采取买入并持有到期的策略。同时采取滚动回购的方式来维持杠杆，因此负债的资金成本存在一定的波动性。在封闭期内，本基金基本保持回购杠杆比例不变，以将杠杆比例稳定控制在一个合理的水平。但当回购利率过高、市场流动性不足或市场状况不宜采用回购放大策略等情况下，基金管理人可适度调整回购杠杆。</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>3、现金管理策略</p> <p>在每个封闭期内完成组合的构建之前，本基金将根据届时的市场环境对组合的现金头寸进行管理，选择到期日（或回售日）在建仓期之内的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资，并采用买入持有到期投资策略。</p> <p>由于在建仓期本基金的投资难以做到与封闭期剩余期限完美匹配，因此可能存在持有的部分投资品种在封闭期结束前到期兑付本息的情形。另一方面，本基金持有的部分投资品种的付息也将增加基金的现金头寸。对于现金头寸，本基金将根据届时的市场环境和封闭期剩余期限，选择到期日（或回售日）在封闭期结束之前的债券、回购、银行存款、同业存单、货币市场工具等进行投资或进行基金现金分红。</p> <p>（二）开放期投资策略：</p> <p>开放期内，本基金将在遵守投资限制与投资比例的前提下，保持基金资产的流动性，防范流动性风险，满足开放期的流动性需求。</p> |
| 业绩比较基准 | 在每个封闭期，本基金的业绩比较基准为该封闭期起始日公布的三年期定期存款利率（税后）+1.5%。 |
| 风险收益特征 | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。 |

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 | 兴业银行股份有限公司 |
| 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 | 95561 |
| 传真 | 010-82295155 | 021-62159217 |
| 注册地址 | 北京市东城区和平里中街乙 16 号 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | 北京市东城区和平里中街乙 16 号 | 上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼 |
| 邮政编码 | 100013 | 200120 |
| 法定代表人 | 毕劲松 | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

| | |
|--------------------|---------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网 | www.postfund.com.cn |

| | |
|------------|-------------------|
| 址 | |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人或基金托管人的办公场所。 |

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|--|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 160,174,561.34 |
| 本期利润 | 160,174,561.34 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0200 |
| 本期加权平均净值利润率 | 1.97% |
| 本期基金份额净值增长率 | 1.98% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 194,492,338.49 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0243 |
| 期末基金资产净值 | 8,194,484,831.02 |
| 期末基金份额净值 | 1.0243 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 5.52% |

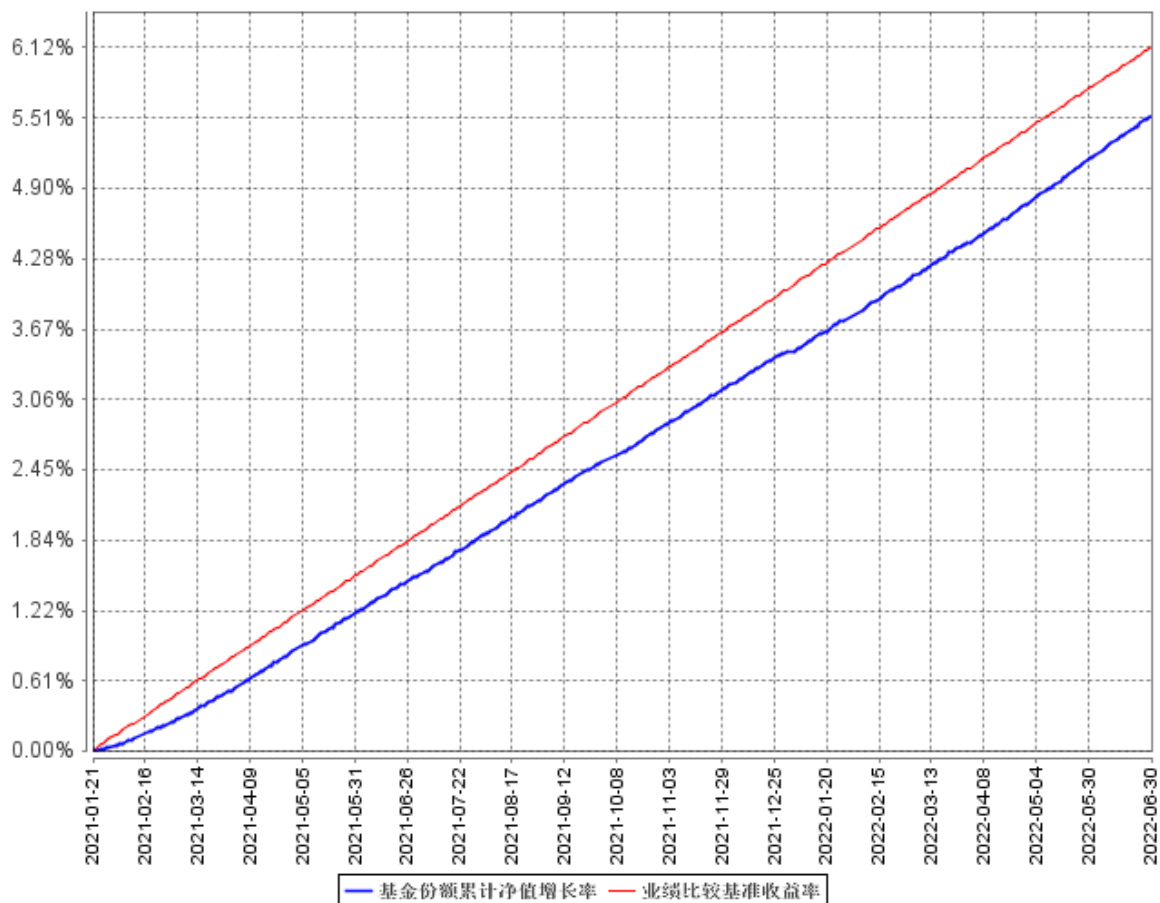
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值 增长率① | 份额净值 增长率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 0.34% | 0.01% | 0.33% | 0.01% | 0.01% | 0.00% |
| 过去三个月 | 1.06% | 0.01% | 1.01% | 0.01% | 0.05% | 0.00% |
| 过去六个月 | 1.98% | 0.01% | 2.03% | 0.01% | -0.05% | 0.00% |
| 过去一年 | 3.94% | 0.01% | 4.17% | 0.01% | -0.23% | 0.00% |
| 自基金合同 生效起至今 | 5.52% | 0.01% | 6.12% | 0.01% | -0.60% | 0.00% |

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

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



§ 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 2022 年 6 月 30 日，本公司共管理 57 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、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、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。

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 | | |
| 武志骁 | 基金经理 | 2021 年 1 月 21 日 | 2022 年 6 月 21 日 | 8 年 | 曾任中国华新投资有限公司中央交易员、投资分析员、中邮创业基金管理股份有限公司投资经理、中邮沪港深精选混合型证券投资基金基金经理助理、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮增力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、中邮纯债聚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基金经理。现任中邮现金驿站货币市场基金、中邮货币市场基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮沪港深精选混合型证券投资基金、中邮尊佑一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。 |
| 张悦 | 基金经理 | 2021 年 1 月 29 日 | 2022 年 6 月 21 日 | 9 年 | 曾任渣打银行（中国）股份有限公司审核与清算岗、民生证券股份有限公司固定收益投资交易部投资经理、光大永明资产管理股份有限公司固定收益投资二部投资经理、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮淳享 66 个月定 |

| | | | | | |
|-----|----------|----------------|---|-----|---|
| | | | | | 期开放债券型证券投资基金基金经理。现任中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮纯债裕利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债丰利债券型证券投资基金、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、中邮中债 1-5 年政策性金融债指数证券投资基金、中邮睿丰增强债券型证券投资基金、中邮鑫享 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金基金经理。 |
| 郭志红 | 基金经 理 | 2022 年 5 月 9 日 | - | 9 年 | 曾任宏源期货有限公司金融研究室负责人、首创证券股份有限公司投资经理，2022 年 1 月加入中邮创业基金管理股份有限公司，现任中邮纯债聚利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、中邮淳悦 39 个月定期开放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、中邮纯债恒利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遵规守信情况的说明

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，上半年经济受到多重冲击，投资、消费同比增速大幅下滑，下行压力非常大。6 月初以来，疫情防控取得有效进展，稳增长政策陆续落地，经济呈现复苏迹象，未来可能会进一步向合理区间靠拢。货币政策总体宽松、资金利率维持低位，地方政府债提前集中发行并未给市场带来明显扰动。债券市场表现方面，短端利率明显下行，中长端维持区间震荡，信用利差压缩。

报告期内，我们维持了票息策略，维持杠杆水平，合理优化融资结构降低融资成本。展望未来，随着经济复苏资金利率大概率向政策利率收敛，个别时点可能会面临扰动，我们将持续优化融资结构，保证融资安全、降低成本，增厚组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0243 元，累计净值为 1.0543 元；本报告期基金份额净

值增长率为 1.98%，业绩比较基准收益率为 2.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年下半年，预计常态化核酸和精准防控的实施会减弱疫情对经济的冲击，同时稳增长政策还会持续发力，助推经济继续修复向合理区间靠拢。然而由于疫情多点散发对场景消费仍有制约、居民收入预期下降影响信心、地产企业资金紧张尚未缓解，经济修复的路径还存在变数，反弹的高度不宜高估。通胀在个别月份不排除会超过 3%，但总体而言仍然比较温和，对货币政策和债券市场影响有限。货币政策大概率仍将维持流动性合理充裕，配合财政政策，对实体经济提供金融支持，受海外加息、稳物价制约，短期内降息降准概率偏低。债券市场方面，随着实体经济的修复，未来狭义流动性会被逐渐消耗，短端利率有向政策利率回归的动力，长端大概率仍然维持震荡，上下空间都比较有限。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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：中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 771,135.61 | 817,448.83 |
| 结算备付金 | | 256,074,312.56 | 254,805,654.58 |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | - | - |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | 14,461,751,508.95 | - |
| 其中：债券投资 | | 14,461,751,508.95 | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | 81,411.64 | 200,000.00 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 14,435,327,180.70 |
| 资产总计 | | 14,718,678,368.76 | 14,691,150,284.11 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 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 | | 6,522,496,897.24 | 6,650,993,415.00 |
| 应付清算款 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|-------------------|-------------------|
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,008,510.49 | 1,026,699.91 |
| 应付托管费 | | 336,170.14 | 342,233.28 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 351,959.87 | 3,634,890.62 |
| 负债合计 | | 6,524,193,537.74 | 6,655,997,238.81 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 7,999,992,492.53 | 7,999,992,492.53 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 194,492,338.49 | 35,160,552.77 |
| 净资产合计 | | 8,194,484,831.02 | 8,035,153,045.30 |
| 负债和净资产总计 | | 14,718,678,368.76 | 14,691,150,284.11 |

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 01 月 21 日，因此上年度比较数据为 2021 年 01 月 21 日至 2021 年 06 月 30 日。报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0243 元，基金份额总额 7,999,992,492.53 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 21 日(基 金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | 236,693,878.60 | 168,428,844.87 |
| 1.利息收入 | | 236,693,878.60 | 168,428,844.87 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 2,004,418.80 | 4,971,319.84 |
| 债券利息收入 | | 234,687,520.07 | 157,353,908.75 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 1,939.73 | 6,103,616.28 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | - | - |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|----------------|----------------|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | - | - |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | - | - |
| 减：二、营业总支出 | | 76,519,317.26 | 47,047,989.53 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,033,152.00 | 5,296,188.51 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,011,050.65 | 1,765,396.19 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 68,344,224.43 | 39,866,336.50 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 68,344,224.43 | 39,866,336.50 |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | -10,319.25 | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 141,209.43 | 120,068.33 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 160,174,561.34 | 121,380,855.34 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 160,174,561.34 | 121,380,855.34 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 160,174,561.34 | 121,380,855.34 |

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 01 月 21 日，因此上年度比较数据为 2021 年 01 月 21 日至 2021 年 06 月 30 日。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|-----------------|---------------------------------------|--------|---------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 7,999,992,492.53 | - | 35,160,552.77 | 8,035,153,045.30 |

| | | | | |
|--|--|--------|----------------|------------------|
| 加：会计政策变更 | - | - | -842,775.62 | -842,775.62 |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 7,999,992,492.53 | - | 34,317,777.15 | 8,034,310,269.68 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | 160,174,561.34 | 160,174,561.34 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 160,174,561.34 | 160,174,561.34 |
| （二）、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） | - | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - | - |
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| （三）、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） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产（基金净值） | 7,999,992,492.53 | - | 194,492,338.49 | 8,194,484,831.02 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021 年 1 月 21 日(基金合同生效日)至 2021 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | - | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 7,999,992,492.53 | - | - | 7,999,992,492.53 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | - | - | 121,380,855.34 | 121,380,855.34 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 121,380,855.34 | 121,380,855.34 |
| （二）、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） | - | - | - | - |
| 其中：1.基金申购款 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|------------------|---|----------------|------------------|
| 2.基金赎回款 | - | - | - | - |
| (三)、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) | - | - | - | - |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 7,999,992,492.53 | - | 121,380,855.34 | 8,121,373,347.87 |

注：本基金基金合同生效日为 2021 年 01 月 21 日，因此上年度比较数据为 2021 年 01 月 21 日至 2021 年 06 月 30 日。

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 佟姍
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金是由中邮淳享 39 个月定期开放债券型证券投资基金变更注册而来，中邮淳享 39 个月定期开放债券型证券投资基金于 2019 年 11 月 26 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2019]2616 号《关于准予中邮淳享 39 个月定期开放债券型证券投资基金注册的批复》准予注册，2020 年 12 月 1 日经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]3250 号《关于准予中邮淳享 39 个月定期开放债券型证券投资基金变更注册的批复》，准予中邮淳享 39 个月定期开放债券型证券投资基金变更注册为中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金，该基金在准予变更注册后募集，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《中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》发起，并于 2021 年 1 月 21 日募集成立。本基金为契约型定期开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集 7,999,992,492.53 元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2021)第 110C000027 号验资报告予以验证。《中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》于 2021 年 1 月 21 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 7,999,992,492.53 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，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行和上市交易的国债、政策性金融债、

央行票据、地方政府债、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款）、同业存单、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不投资股票、可转换债券、可交换债券。本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%，应开放期流动性需要，为保护基金份额持有人利益，本基金开放期开始前 3 个月、开放期期间以及开放期结束后的 3 个月内，本基金的债券资产的投资比例可不受上述限制。开放期内，本基金保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，封闭期内不受上述 5% 的限制，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，真实完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的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

①新金融工具准则

财政部于 2017 年颁布了《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量（修订）》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移（修订）》、《企业会计准则第 24 号——套期会计（修订）》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报（修订）》（统称“新金融工具准则”），本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，对会计政策相关内容进行了调整。

新金融工具准则要求根据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，将金融资产划分为以下三类：（1）以摊余成本计量的金融资产；（2）以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产；（3）以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。混合合同包含的主合同属于金融资产的，不应从该混合合同中分拆嵌入衍生工具，而应当将该混合合同作为一个

整体适用金融资产分类的相关规定。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

采用新金融工具准则对本基金金融负债的会计政策并无重大影响。

本基金按照新金融工具准则的规定，对金融工具的分类和计量进行追溯调整，将金融工具原账面价值和金融工具准则施行日（即 2022 年 1 月 1 日）的新账面价值之间的差额计入 2022 年年初未分配利润。同时，本基金未对比较财务报表数据进行调整。

②财务报表格式的调整

财政部于 2018 年 12 月 27 日发布了《关于修订印发 2018 年度金融企业财务报表格式的通知》（财会〔2018〕36 号），对已执行新金融工具准则的金融企业的财务报表格式进行了规范。根据该通知及中国证监会颁布的《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〉》，本基金对财务报表格式进行了以下修订：

资产负债表，增加根据新金融工具准则新增的报表项目：债权投资、其他债权投资、其他权益工具投资；基于实际利率法计提的金融工具的利息应包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关资产负债表项目中，而不应单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目；“应付交易费用”并入“其他负债”。

财务报表格式的修订对本基金的资产总额、负债总额、净利润、所有者权益等无影响。

于 2022 年 1 月 1 日，执行新金融工具准则时金融工具分类和账面价值调节如下：

应收利息调整前账面金额为 284,267,020.36 元，全部调整至相关金融资产的账面价值中，其中 72.95 元重分类至银行存款，114,662.50 元重分类至结算备付金，284,152,284.91 元重分类至债权投资，应收利息调整后账面金额为 0 元。其他资产调整前账面金额为 14,151,060,160.34 元，全部调整至债权投资，调整后账面金额为 0 元。

银行存款调整前账面金额为 817,448.83 元，调整后账面金额为 817,521.78 元；结算备付金调整前账面金额为 254,805,654.58 元，调整后账面金额为 254,920,317.08 元；债权投资为新增报表项目，由原其他资产 14,151,060,160.34 元、应计利息 284,152,284.91 元转入，并于新金融工具准则施行日确认减值准备 842,775.62 元，调整后债权投资账面价值为 14,434,369,669.63 元。

应付利息调整前账面金额为 3,293,592.11 元，全部重分类至卖出回购金融资产款，调整后账面金额为 0 元。卖出回购金融资产款调整前账面金额为 6,650,993,415.00 元，调整后账面金额为 6,654,287,007.11 元。

应付交易费用调整前账面金额为 112,298.51 元，全部重分类至其他负债，调整后账面金额为 0 元。其他负债调整前账面金额为 229,000.00 元，调整后账面金额为 341,298.51 元。

未分配利润调整前账面金额为 35,160,552.77 元，调整后账面金额为 34,317,777.15 元。

6.4.5.2 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[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。

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

3. 对证券投资基金管理人运用基金买卖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）转让债券、基金、非货物期货，按照实际买入价计算销售额。

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 2022 年 6 月 30 日 |
|----|------------------------|
|----|------------------------|

| | |
|----------------|------------|
| 活期存款 | 771,135.61 |
| 等于：本金 | 770,859.57 |
| 加：应计利息 | 276.04 |
| 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： | 771,135.61 |

6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本期末未持有交易性金融资产。

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 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | | | |
|----|-------|------------------------|---------------|----------------|------------|------------------|
| | | 初始成本 | 利息调整 | 应计利息 | 减值准备 | 账面价值 |
| 债券 | 交易所市场 | 4,470,000,000.00 | 2,758,602.70 | 51,460,843.82 | 832,456.37 | 4,523,386,990.15 |
| | 银行间市场 | 9,590,000,000.00 | 78,784,855.79 | 269,579,663.01 | - | 9,938,364,518.80 |

| | | | | | | |
|--------|-------------------|---------------|----------------|------------|-------------------|---|
| | - | - | - | - | - | - |
| 小计 | 14,060,000,000.00 | 81,543,458.49 | 321,040,506.83 | 832,456.37 | 14,461,751,508.95 | |
| 资产支持证券 | | | | | | |
| 其他 | | | | | | |
| 合计 | 14,060,000,000.00 | 81,543,458.49 | 321,040,506.83 | 832,456.37 | 14,461,751,508.95 | |

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

单位：人民币元

| 减值准备 | 第一阶段 | 第二阶段 | 第三阶段 | 合计 |
|-----------|----------------|----------------------|----------------------|------------|
| | 未来 12 个月预期信用损失 | 整个存续期预期信用损失(未发生信用减值) | 整个存续期预期信用损失(已发生信用减值) | |
| 期初余额 | 842,775.62 | - | - | 842,775.62 |
| 本期从其他阶段转入 | - | - | - | - |
| 本期转出至其他阶段 | - | - | - | - |
| 本期新增 | 12,943.41 | - | - | 12,943.41 |
| 本期转回 | 23,262.66 | - | - | 23,262.66 |
| 其他变动 | - | - | - | - |
| 期末余额 | 832,456.37 | - | - | 832,456.37 |

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 113,945.13 |
| 其中：交易所市场 | 113,945.13 |

| | |
|-------|------------|
| 银行间市场 | - |
| - | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 238,014.74 |
| 合计 | 351,959.87 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 本期期初 | 7,999,992,492.53 | 7,999,992,492.53 |
| 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 | 7,999,992,492.53 | 7,999,992,492.53 |

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|-------|----------------|
| 本期期初 | 34,317,777.15 | - | 34,317,777.15 |
| 本期利润 | 160,174,561.34 | - | 160,174,561.34 |
| 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 | 194,492,338.49 | - | 194,492,338.49 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 活期存款利息收入 | 11,431.38 |
| 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 | 1,992,987.42 |
| 其他 | - |
| 合计 | 2,004,418.80 |

6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资。

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.21 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 银行存款 | - |

| | |
|----------|------------|
| 买入返售金融资产 | - |
| 债权投资 | -10,319.25 |
| 其他债权投资 | - |
| 其他 | - |
| - | - |
| 合计 | -10,319.25 |

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 审计费用 | 59,507.37 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 2,819.69 |
| 上清所债券账户维护费 | 9,600.00 |
| 中债债券帐户维护费 | 9,000.00 |
| 交易费用 | 775.00 |
| 其他 | - |
| 合计 | 141,209.43 |

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

截止 2022 年 08 月 22 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 |

| | |
|------------|--------------|
| 兴业银行股份有限公司 | 基金托管人、基金代销机构 |
|------------|--------------|

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月21日(基金合同生效日)至2021年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,033,152.00 | 5,296,188.51 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 21,341.84 | 18,735.18 |

注：支付基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司的基金管理费，按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。管理费的计算方法如下：

每日应计提的基金管理费 = 前一日的基金资产净值 × 0.15% / 当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|--------------------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月21日(基金合同生效日)至2021年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,011,050.65 | 1,765,396.19 |

注：支付基金托管人兴业银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：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。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|------------------|-------------------|------------------|---------------------|------------------|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 兴业银行股份有限公司资金营运中心 | 2,299,999,000.00 | 28.75% | 2,299,999,000.00 | 28.75% |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月21日(基金合同生效日)至2021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 |
|------------|------------|-----------|--------------|------------|
| 兴业银行股份有限公司 | 771,135.61 | 11,431.38 | 2,614,821.79 | 692,063.30 |

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行活期利率/银行同业利率/约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间本基金未在承销期内参与认购关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 3,071,282,086.70 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

| 债券代码 | 债券名称 | 回购到期日 | 期末估值单价 | 数量（张） | 期末估值总额 |
|--------|--------|-----------|--------|-----------|----------------|
| 190408 | 19农发08 | 2022年7月5日 | 100.87 | 1,053,000 | 106,220,789.51 |
| 190408 | 19农发08 | 2022年7月5日 | 100.87 | 4,124,000 | 416,006,206.96 |
| 160418 | 16农发18 | 2022年7月6日 | 100.65 | 3,093,000 | 311,297,678.78 |
| 160418 | 16农发18 | 2022年7月6日 | 100.65 | 2,109,000 | 212,262,141.79 |
| 190408 | 19农发08 | 2022年7月7日 | 100.87 | 3,093,000 | 312,004,655.22 |
| 160418 | 16农发18 | 2022年7月 | 100.65 | 4,950,000 | 498,197,061.10 |

| | | | | | |
|--------|----------|----------------|--------|------------|------------------|
| | | 1 日 | | | |
| 190408 | 19 农发 08 | 2022 年 7 月 4 日 | 100.87 | 3,160,000 | 318,763,242.97 |
| 160418 | 16 农发 18 | 2022 年 7 月 5 日 | 100.65 | 3,159,000 | 317,940,306.26 |
| 160418 | 16 农发 18 | 2022 年 7 月 1 日 | 100.65 | 1,790,000 | 180,156,108.96 |
| 190408 | 19 农发 08 | 2022 年 7 月 1 日 | 100.87 | 3,159,000 | 318,662,368.53 |
| 160418 | 16 农发 18 | 2022 年 7 月 4 日 | 100.65 | 2,430,000 | 244,569,466.36 |
| 合计 | | | | 32,120,000 | 3,236,080,026.44 |

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 3,451,214,810.54 元,于 2022 年 7 月 14 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

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | 2,400,886,219.37 | 2,372,597,578.47 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 12,060,865,289.58 | 11,778,462,581.87 |
| 合计 | 14,461,751,508.95 | 14,151,060,160.34 |

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的中期票据、地方政府债。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022 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 | 771,135.61 | | - | - | 771,135.61 |
| 结算备付金 | 256,074,312.56 | | - | - | 256,074,312.56 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|---------------------------|------------------|--------------------|---|-----------------|-------------------|
| 返售 金融 资产 | | | | | |
| 债权 投资 | | -14,140,711,002.12 | | -321,040,506.83 | 14,461,751,508.95 |
| 应收 清算 款 | 81,411.64 | | - | | 81,411.64 |
| 应收 股利 | | | - | | - |
| 应收 申购 款 | | | - | | - |
| 递延 所得 税资 产 | | | - | | - |
| 其他 资产 | | | - | | - |
| - | | | - | | - |
| 资产 总计 | 256,926,859.81 | 14,140,711,002.12 | | -321,040,506.83 | 14,718,678,368.76 |
| 负债 | | | | | |
| 短期 借款 | | | - | | - |
| 交易 性金 融负 债 | | | - | | - |
| 衍生 金融 负债 | | | - | | - |
| 卖出 回购 金融 资产 款 | 6,522,496,897.24 | | - | | 6,522,496,897.24 |
| 应付 清算 款 | | | - | | - |
| 应付 赎回 款 | | | - | | - |
| 应付 | | | - | 1,008,510.49 | 1,008,510.49 |

| | | | | | |
|-----------------------|-------------------|-------------------|-------|-----------------|------------------|
| 管理人报酬 | | | | | |
| 应付托管费 | - | - | - | 336,170.14 | 336,170.14 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 递延所得税负债 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 351,959.87 | 351,959.87 |
| 负债总计 | 6,522,496,897.24 | - | - | 1,696,640.50 | 6,524,193,537.74 |
| 利率敏感度缺口 | -6,265,570,037.43 | 14,140,711,002.12 | - | -319,343,866.33 | 8,194,484,831.02 |
| 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 817,448.83 | - | - | - | 817,448.83 |
| 结算备付金 | 254,805,654.58 | - | - | - | 254,805,654.58 |
| 存出保证 | - | - | - | - | - |

| | | | | | |
|-----------|--------------------|-------------------|-----------------|---|-------------------|
| 金 | | | | | |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | 200,000.00 | - | 200,000.00 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | -14,151,060,160.34 | - | -284,267,020.36 | - | 14,435,327,180.70 |
| 资产总计 | 255,623,103.41 | 14,151,060,160.34 | -284,467,020.36 | - | 14,691,150,284.11 |
| 负债 | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 6,650,993,415.00 | - | - | - | 6,650,993,415.00 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | 1,026,699.91 | - | 1,026,699.91 |
| 应付托管 | - | - | 342,233.28 | - | 342,233.28 |

| | | | | | |
|---------|-------------------|-------------------|---|-----------------|------------------|
| 费 | | | | | |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 3,634,890.62 | 3,634,890.62 |
| 负债总计 | 6,650,993,415.00 | - | - | 5,003,823.81 | 6,655,997,238.81 |
| 利率敏感度缺口 | -6,395,370,311.59 | 14,151,060,160.34 | - | -279,463,196.55 | 8,035,153,045.30 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|-----------------------------|-----------------------------|------------------------|
| 假设 | 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（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| | 1. 基金净资产变动 | -136,431,807.88 | -153,721,187.14 |
| | 2. 基金净资产变动 | 139,486,375.45 | 157,487,905.59 |

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他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固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最

低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括：银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、债权投资、卖出回购金融资产和其他各类应收应付款项等。

除债权投资外，其他不以公允价值计量的金融资产和金融负债的账面价值与公允价值相差很小。截至 2022 年 6 月 30 日，债权投资账面价值为 14,461,751,508.95 元，公允价值为 14,756,296,506.83 元。

债权投资按如下原则确定公允价值：（1）存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。（2）当金融工具不存在活跃市场，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公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。（3）如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》的有关规定，本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券和私募债券除外），

按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值；本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的上述投资的公允价值均属于第二层次。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|-------------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 14,461,751,508.95 | 98.25 |
| | 其中：债券 | 14,461,751,508.95 | 98.25 |
| | 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 | 256,845,448.17 | 1.75 |
| 8 | 其他各项资产 | 81,411.64 | 0.00 |
| 9 | 合计 | 14,718,678,368.76 | 100.00 |

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

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

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

本基金本报告期内未持有股票。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期内未持有股票。

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 | 按实际利率计算账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 9,938,364,518.80 | 121.28 |
| | 其中：政策性金融债 | 9,938,364,518.80 | 121.28 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | 4,523,386,990.15 | 55.20 |
| 10 | 合计 | 14,461,751,508.95 | 176.48 |

注：其他为地方政府债。

7.6 期末按实际利率计算账面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） | 按实际利率计算账面价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|------------|------------------|--------------|
| 1 | 190408 | 19 农发 08 | 73,700,000 | 7,688,784,211.58 | 93.83 |
| 2 | 160418 | 16 农发 18 | 22,200,000 | 2,249,580,307.22 | 27.45 |
| 3 | 173533 | 21 浙江 01 | 8,000,000 | 811,812,692.57 | 9.91 |
| 4 | 173110 | 21 重庆 01 | 8,000,000 | 810,478,376.51 | 9.89 |
| 5 | 157132 | 19 安徽 01 | 7,900,000 | 804,560,492.94 | 9.82 |

7.7 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 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 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

本报告期内本基金投资的 19 农发 08 (190408)、16 农发 18 (160418)，其发行主体中国农业发展银行受到中国银行保险监督管理委员会行政处罚—银保监罚决字【2022】10 号。

除此，基金投资的前十名其他证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 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

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内股票。

7.11.3 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 | - |
| 2 | 应收清算款 | 81,411.64 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 81,411.64 |

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

| 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 |
| 211 | 37,914,656.36 | 7,999,990,000.00 | 100.00% | 2,492.53 | 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 | 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 | 0.00 | 0.00% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 1 月 21 日）基金份额总额 | 7,999,992,492.53 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 7,999,992,492.53 |
| 本报告期基金总申购份额 | - |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | - |
| 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 | 7,999,992,492.53 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人、托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期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 | |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1. 选择专用交易单元的标准和程序：

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

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

能力以及其他综合服务能力。

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

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|--------------|--------------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | 271,753,576,000.00 | 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增加上海长量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 | 2022年6月30日 |
| 2 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金 基金产品资料概要（更新） | 规定媒介 | 2022年6月24日 |
| 3 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书（更新） | 规定媒介 | 2022年6月24日 |
| 4 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金 基金经理变更公告 | 规定媒介 | 2022年6月23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兴业银行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 | 2022年6月17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北京汇成 | 规定媒介 | 2022年6月14日 |

| | | | |
|----|--|------|-----------------|
| | 基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告 | | |
| 7 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金 基金产品资料概要 (更新) | 规定媒介 | 2022 年 5 月 11 日 |
| 8 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金招募说明书 (更新) | 规定媒介 | 2022 年 5 月 11 日 |
| 9 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理变更公告 | 规定媒介 | 2022 年 5 月 10 日 |
| 10 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 规定媒介 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 11 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金 2021 年年度报告 | 规定媒介 | 2022 年 3 月 11 日 |
| 12 | 中邮创业基金管理股份有限公司关于调整旗下部分基金在浙江同花顺基金销售有限公司申购及定投起点金额的公告 | 规定媒介 | 2022 年 3 月 8 日 |
| 13 | 中邮淳享 66 个月定期开放债券型投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 规定媒介 | 2022 年 1 月 24 日 |

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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 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 | 20220101-20220630 | 1,999,999,000.00 | - | - | 1,999,999,000.00 | 25.00% |
| | 2 | 20220101-20220630 | 2,299,999,000.00 | - | - | 2,299,999,000.00 | 28.75% |
| 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。 | | | | | | | |

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瑞享两年定期开放混合型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮淳享 66 个月定期开放债券型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮淳享 66 个月定期开放债券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

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可于营业时间查阅，或登陆基金管理人网站查阅。

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司。

客户服务中心电话：010-58511618 400-880-1618

基金管理人网址：www.postfund.com.cn

中邮创业基金管理股份有限公司

2022 年 8 月 31 日