

中邮纯债丰利债券型证券投资基金 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：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

中邮纯债丰利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。本半年度报告已经全部独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司（简称：上海浦发银行）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、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正。

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.....	8
2.4 信息披露方式.....	9
2.5 其他相关资料.....	9
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标.....	9
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§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.....	17
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.....	17
§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.....	20
6.4 报表附注.....	22
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	45
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.....	45
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.....	46
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.....	46
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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.11 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	47
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.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	48
§10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	49
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.....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	49
10.8 其他重大事件.....	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
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.....	51

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	51
§12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中邮纯债丰利债券型证券投资基金	
基金简称	中邮纯债丰利债券	
基金主代码	010086	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 11 月 19 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	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	502,026,669.08 份	
下属分级基金的基金简称:	中邮纯债丰利债券 A	中邮纯债丰利债券 C
下属分级基金的交易代码:	010086	010087
报告期末下属分级基金的份额总额	499,999,729.31 份	2,026,939.77 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，通过积极主动的资产管理，为投资者提供稳健持续增长的投资收益。
投资策略	<p>本基金在对宏观经济和债券市场综合研判的基础上，通过自上而下的宏观分析和自下而上的个券研究，使用主动管理、数量投资和组合投资的投资手段，追求基金资产长期稳健的增值。</p> <p>主动管理：我国债券市场运作时间短，市场规模较小，参与主体少，债券市场还处于不断完善和发展的过程中。由于我国债券市场的不完全有效性为基金管理人通过积极的投资策略，实现基金资产的长期稳定增值提供了可能性。本基金管理人将通过增强对宏观、市场利率和债券市场发展的认识和预测，运用市场时机选择、期限选择和类别选择等方式，在控制投资风险的前提下力争获取超过债券市场平均收益水平的投资业绩。</p> <p>数量投资：通过数量化分析债券久期、凸性、利率、流动性和信用风险等因素，寻找被市场错误定价或严重低估的偏离价值区域的券种。通过科学的计算方法，严格测算和比较该项投资的风险与预期投资收益水平，研究分析所选定的品种是否符合投资目标，是否具有投资价值，并选择有利时机进行投资决策。</p> <p>组合投资：债券收益率曲线的变动并不是整体平行移动，而具有不平衡性，往往收益率曲线的某几个期限段的变动较为突出，收益率曲线变动的不平衡性为基金管理人集中投资于某几个期限段的债券提供了条件。基金管理人可根据不同债种的风险收益特征，在不同市场环境下进行不同比例的组合投资，采用哑铃型、子弹型、阶梯型等方式进行债券组合。</p> <p>（一）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形势发展和变动趋势，基于对财政政策、货币政策和债券市场的综合研判，在遵守有关投资限制规定的前提下，灵活运用投资策略，配置基金资产，力争在保障基金资产流动性和本金安全的前提下实现投资组合收益的最大化。</p> <p>本基金基于对以下因素的判断，进行基金资产在非信用类固定收益资产、信用</p>

类固定收益资产和现金之间的配置：

- 1、基于对利率走势、利率期限结构等因素的分析，预测固定收益品种的投资收益和风险；
- 2、对宏观经济、行业前景以及公司财务进行严谨的分析，考察其对固定收益市场信用利差的影响；
- 3、套利性投资机会的投资期间及预期收益率；
- 4、可转换债券发行公司的成长性和可转债价值的判断

（二）固定收益品种投资策略

1、固定收益品种的配置策略

（1）平均久期配置策略

本基金通过对宏观经济变量（包括国内生产总值、工业增长、货币信贷、固定资产投资、消费、通胀率、外贸差额、财政收支、价格指数和汇率等）和宏观经济政策（包括货币政策、财政政策、产业政策、外贸和汇率政策等）等进行定性和定量分析，预测未来的利率变化趋势，判断债券市场对上述变量和政策的反应，并据此积极调整债券组合的平均久期，有效控制基金资产风险，提高债券组合的总投资收益。当预期市场利率上升时，本基金将缩短债券投资组合久期，以规避债券价格下跌的风险。当预期市场利率下降时，本基金将拉长债券投资组合久期，以更大程度的获取债券价格上涨带来的价差收益。

（2）期限结构配置策略

结合对宏观经济形势和政策的判断，本基金对债券市场收益率期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，预测收益率期限结构的变化方式，选择合适的期限结构配置策略，配置各期限固定收益品种的比例，以达到预期投资收益最大化的目的。

（3）类属配置策略

本基金对不同类型固定收益品种的信用风险、税赋水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，确定组合在不同类型债券品种上的配置比例。根据中国债券市场存在市场分割的特点，本基金将考察相同债券在交易所市场和银行间市场的利差情况，结合流动性等因素的分析，选择具有更高投资价值的市场进行配置。

2、固定收益品种的选择

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

（1）非信用类固定收益品种的选择

本基金对国债、央行票据等非信用类固定收益品种的投资，主要根据宏观经济变量和宏观经济政策的分析，预测未来收益率曲线的变动趋势，综合考虑组合流动性决定投资品种。

（2）信用类固定收益品种的选择

本基金投资信用状况良好的信用类债券。通过对宏观经济、行业特性和公司财务状况进行研究分析，对固定收益品种的信用风险进行分析、度量及定价，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。具体内容包括：

- ①根据宏观经济环境及各行业的发展状况，决定各行业的配置比例；
- ②充分研究和分析债券发行人的产业发展趋势、行业政策、监管环境、公司背

	<p>景、盈利情况、竞争地位、治理结构、特殊事件风险等基本面信息，分析企业的长期运作风险；</p> <p>③运用财务评分模型对债券发行人的资产流动性、盈利能力、偿债能力、现金流水平等方面进行综合评分，度量发行人财务风险；</p> <p>④利用历史数据、市场价格以及资产质量等信息，估算债券发行人的违约率及违约损失率；</p> <p>⑤综合发行人各方面分析结果，采用数量化模型，确定信用利差的合理水平，利用市场的相对失衡，选择价格相对低估的品种进行投资。</p> <p>（三）可转换债券的投资策略</p> <p>可转换债券的价值主要取决于其股权价值、债券价值和转换期权价值，本基金管理人将对可转换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券。</p> <p>本基金管理人将对发行公司的基本面进行分析，包括所处行业的景气度、公司成长性、市场竞争力等，并参考同类公司的估值水平，判断可转换债券的股权投资价值；基于对利率水平、票息率、派息频率及信用风险等因素的分析，判断其债券投资价值；采用期权定价模型，估算可转换债券的转换期权价值。综合以上因素，对可转换债券进行定价分析，制定可转换债券的投资策略。</p> <p>此外，本基金还将根据新发可转换债券的预计中签率、模型定价结果，积极参与一级市场可转债新券的申购。</p> <p>（四）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>（五）国债期货投资策略</p> <p>国债期货作为利率衍生品的一种，有助于管理债券组合的久期、流动性和风险水平。管理人将按照相关法律法规的规定，结合对宏观经济形势和政策趋势的判断、对债券市场进行定性和定量分析。本基金构建量化分析体系，对国债期货和现货基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在严控风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳健增值。</p>	
业绩比较基准	中债综合指数收益率×90%+活期存款利率（税后）×10%	
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。	
	中邮纯债丰利债券 A	中邮纯债丰利债券 C

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	上海浦东发展银行股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	侯玉春	胡波
	联系电话	010-82295160-157	021-61618888
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	Hub5@spdb.com.cn
客户服务电话	010-58511618	95528	

传真	010-82295155	021-63602540
注册地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	上海市中山东一路 12 号
办公地址	北京市东城区和平里中街乙 16 号	上海市北京东路 689 号
邮政编码	100013	200001
法定代表人	毕劲松	郑杨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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	中邮纯债丰利债券 A	中邮纯债丰利债券 C
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)	报告期(2022 年 1 月 1 日 - 2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	11,135,262.07	42,367.88
本期利润	11,397,946.06	43,421.28
加权平均基金份额本期利润	0.0228	0.0215
本期加权平均净值利润率	2.21%	2.09%
本期基金份额净值增长率	2.23%	2.11%
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	8,117,206.10	28,669.22
期末可供分配基金份额利润	0.0162	0.0141
期末基金资产净值	516,799,767.28	2,091,049.54
期末基金份额净值	1.0336	1.0316
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	7.57%	7.26%

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

中邮纯债丰利债券 A

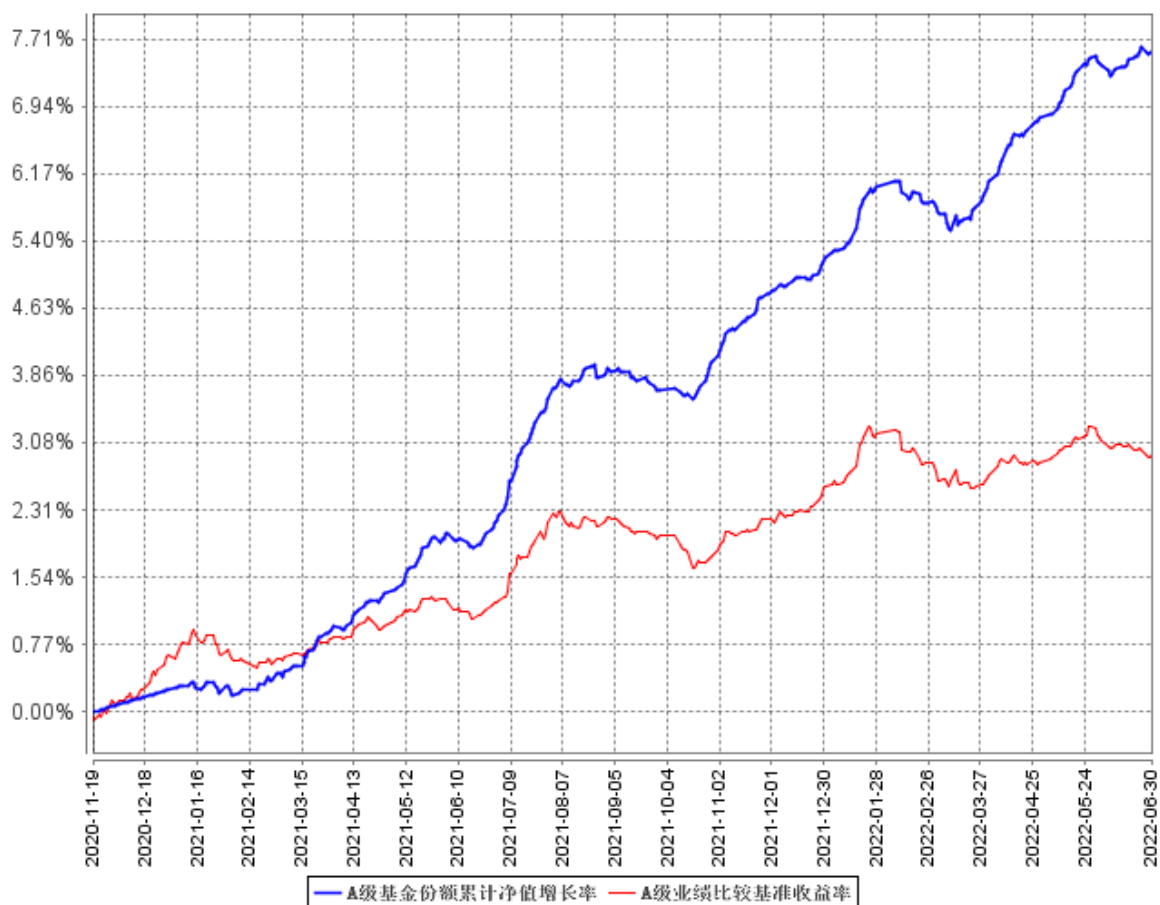
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.10%	0.03%	-0.21%	0.03%	0.31%	0.00%
过去三个月	1.47%	0.04%	0.27%	0.03%	1.20%	0.01%
过去六个月	2.23%	0.05%	0.36%	0.05%	1.87%	0.00%
过去一年	5.29%	0.04%	1.68%	0.05%	3.61%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.57%	0.04%	2.95%	0.04%	4.62%	0.00%

中邮纯债丰利债券 C

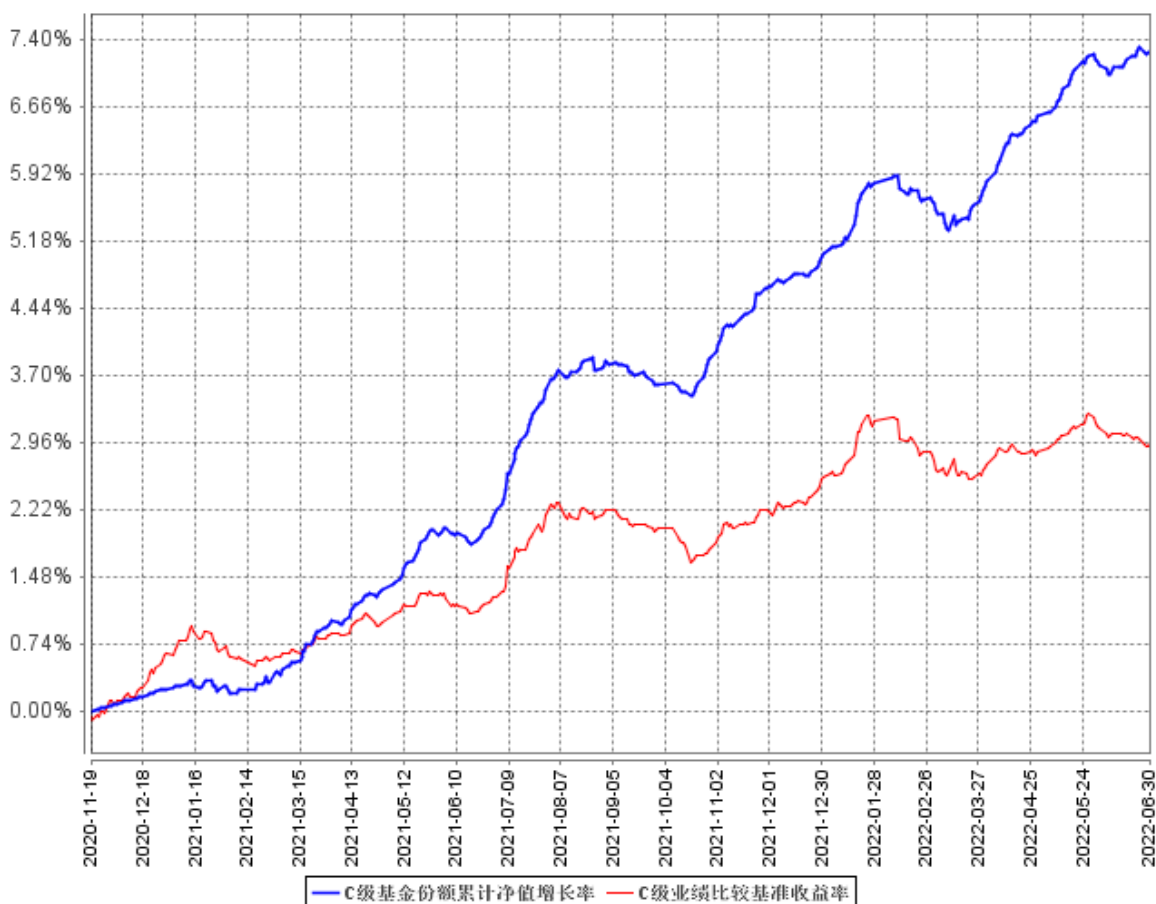
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.08%	0.03%	-0.21%	0.03%	0.29%	0.00%
过去三个月	1.40%	0.04%	0.27%	0.03%	1.13%	0.01%
过去六个月	2.11%	0.05%	0.36%	0.05%	1.75%	0.00%
过去一年	5.02%	0.04%	1.68%	0.05%	3.34%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.26%	0.04%	2.95%	0.04%	4.31%	0.00%

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

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



§ 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		
张悦	基金经理	2020 年 11 月 19 日	-	9 年	工程硕士，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、中邮悦享 6 个月持有期混合型证券投资基金、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。
武志骁	基金经理	2020 年 11 月 19 日	-	8 年	理学硕士，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。

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

上半年经济基本面再次受到海外地缘冲突和国内疫情的双重冲击，政策全面转松，资金面维持低位，债券市场表现方面，短端大幅下行，长端受中美利差掣肘呈现区间震荡，期限利差走阔，资产荒下信用利差继续维持低位。

报告期内我们维持了短久期票息策略，且在债券收益低点适度兑现了短端的盈利，小幅降低组合久期和杠杆。展望下半年，疫后复产复工持续，经济呈现复苏趋势，短期政策仍处于观察期快速收紧概率较低，海外加息超预期硬着陆风险加大，中期看基建发力的概率较大，出口在海外能源危机的背景下有望持续走强，地产全年仍将对基本面形成拖累，三季度后可适度提升组合久

期，票息策略仍可提供较好的配置价值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中邮纯债丰利债券 A 基金份额净值为 1.0336 元，累计净值为 1.0746 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.23%；截至本报告期末中邮纯债丰利债券 C 基金份额净值为 1.0316 元，累计净值为 1.0716 元；本报告期基金份额净值增长率为 2.11%；同期业绩比较基准收益率为 0.36%。

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，海外能源危机下的通胀压力仍将持续，欧美央行激进加息对基本面形成较大压力，国内疫后复苏的大趋势并未改变，出口和基建拉动投资，地产仍将对经济形成拖累，消费弱复苏，整体上维持海外衰退国内弱复苏的格局。政策面货币仍将维持偏松，更多的财政刺激政策有望陆续出炉托底经济，政策面整体对债券市场仍偏友好。预计资金下半年整体维持偏松，市场走势方面，三季度有望成为全年经济复苏斜率最强的时间段，经济数据的恢复对债券收益率形成一定的压力，但不改长期经济增速下台阶的趋势，机构欠配仍较严重，调整将是较好配置机会。。

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

本基金根据相关法律法规的规定及《基金合同》的约定，在报告期内共分红一次，2022 年 6 月 15 日公告的对截至 2022 年 6 月 10 日可分配收益进行分配，权益登记日为 2022 年 6 月 17 日，利润分配总额 A 级为 4,999,997.40 元，C 级为 20,170.18 元。

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

本基金本报告期内，有连续二十个工作日基金份额持有人数量不满足二百人的情形。

§ 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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对中邮纯债丰利证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人依照《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、托管协议的规定，对中邮纯债丰利证券投资基金的投资运作进行了监督，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的复核，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

本报告期内，由中邮创业基金管理股份有限公司编制本托管人复核的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范围内）、投资组合报告等内容真实、准确、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：中邮纯债丰利债券型证券投资基金

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	127,867.43	328,506.87
结算备付金		1,841,435.37	2,687,783.12
存出保证金		9,867.41	19.15
交易性金融资产	6.4.7.2	692,643,269.60	565,704,000.00
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		692,643,269.60	565,704,000.00
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	-	2,700,000.00
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-

其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	11,856,788.00
资产总计		694,622,439.81	583,277,097.14
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		175,123,755.26	70,300,000.00
应付清算款		53,832.88	-
应付赎回款		-	10.14
应付管理人报酬		128,516.98	130,609.06
应付托管费		42,838.98	43,536.36
应付销售服务费		430.22	437.26
应付投资顾问费		-	-
应交税费		36,860.32	45,011.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	345,388.35	292,891.50
负债合计		175,731,622.99	70,812,495.50
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	502,026,669.08	502,021,788.08
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	16,864,147.74	10,442,813.56
净资产合计		518,890,816.82	512,464,601.64
负债和净资产总计		694,622,439.81	583,277,097.14

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，中邮纯债丰利债券 A 基金份额净值 1.0336 元，基金份额总额 499,999,729.31 份；中邮纯债丰利债券 C 基金份额净值 1.0316 元，基金份额总额 2,026,939.77 份。中邮纯债丰利债券份额总额合计为 502,026,669.08 份。

6.2 利润表

会计主体：中邮纯债丰利债券型证券投资基金

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 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,133,642.32	12,169,241.13
1.利息收入		113,133.87	10,280,236.76
其中：存款利息收入	6.4.7.13	104,970.44	575,089.76
债券利息收入		-	8,314,474.42
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		8,163.43	1,390,672.58
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		13,756,771.06	55,337.67
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	13,756,771.06	55,337.67
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	263,737.39	1,833,666.70
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		2,692,274.98	2,302,725.96
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	770,359.18	971,424.60
2. 托管费	6.4.10.2.2	256,786.35	323,808.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	2,580.85	1,450.30
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		1,506,460.66	844,184.68
其中：卖出回购金融资产支出		1,506,460.66	844,184.68
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		31,122.35	16,295.79
8. 其他费用	6.4.7.23	124,965.59	145,562.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,441,367.34	9,866,515.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,441,367.34	9,866,515.17

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		11,441,367.34	9,866,515.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中邮纯债丰利债券型证券投资基金

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）	502,021,788.08	-	10,442,813.56	512,464,601.64
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）	502,021,788.08	-	10,442,813.56	512,464,601.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,881.00	-	6,421,334.18	6,426,215.18
（一）、综合收益总额	-	-	11,441,367.34	11,441,367.34
（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）	4,881.00	-	134.42	5,015.42
其中：1.基金申购款	9,950.18	-	307.44	10,257.62
2.基金赎回款	-5,069.18	-	-173.02	-5,242.20
（三）、本期向基金份	-	-	-5,020,167.58	-5,020,167.58

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）	502,026,669.08	-	16,864,147.74	518,890,816.82
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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）	999,999,562.36	-	2,519,558.93	1,002,519,121.29
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）	999,999,562.36	-	2,519,558.93	1,002,519,121.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-497,996,888.49	-	8,329,800.14	-489,667,088.35
（一）、综合收益总额	-	-	9,866,515.17	9,866,515.17
（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）	-497,996,888.49	-	-1,536,715.03	-499,533,603.52
其中：1.基金申购款	2,013,140.34	-	13,489.64	2,026,629.98
2.基金赎回款	-500,010,028.83	-	-1,550,204.67	-501,560,233.50
（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）	502,002,673.87	-	10,849,359.07	512,852,032.94

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中邮纯债丰利债券型证券投资基金（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]1729号《关于准予中邮纯债丰利债券型证券投资基金注册的批复》批准进行募集，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《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《中邮纯债丰利债券型证券投资基金基金合同》发起，并于2020年11月19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1,000,003,485.18元，业经致同会计师事务所（特殊普通合伙）致同验字(2020)第110ZC00441号验资报告予以验证。《中邮纯债丰利债券型证券投资基金基金合同》于2020年11月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,000,003,485.18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，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮纯债丰利债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围是具有良好流动性的金融工具，包括债券（含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、可转换债券（含可分离交易可转债）、次级债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、地方政府债等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票、权证等权益类金融工具，但可持有因可转债转股所形成的股票等。因上述原因持有的股票

和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。本基金不参与信用评级低于 AA 的信用债投资。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%，投资于信用评级 AAA 的信用债比例不低于基金资产的 30%，投资于信用评级 AA+ 及以下的信用债比例不超过基金资产的 50%，投资于信用评级 AA 的信用债比例不超过基金资产的 20%；本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金，存出保证金和应收申购款等。

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。

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，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仅涉及重分类，不影响 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 11,856,788.00 元，全部调整至相关金融资产的账面价值中，其中 452.27 元重分类至银行存款，1,209.20 元重分类至结算备付金，11,854,350.55 元重分类至交易性金融资产-债券投资，775.98 元重分类至买入返售金融资产，应收利息调整后账面金额为 0 元。

银行存款调整前账面金额为 328,506.87 元，调整后账面金额为 328,959.14 元；结算备付金调整前账面金额为 2,687,783.12 元，调整后账面金额为 2,688,992.32 元；交易性金融资产调整前账面金额为 565,704,000.00 元，调整后账面金额为 577,558,350.55 元；买入返售金融资产调整前账面金额为 2,700,000.00 元，调整后账面金额为 2,700,775.98 元。

应付利息调整前账面金额为 48,844.49 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 70,300,000.00 元，调整后账面金额为 70,348,844.49 元。

应付交易费用调整前账面金额为 4,047.01 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 240,000.00 元，调整后账面金额为 244,047.01 元。

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[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。

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	127,867.43
等于：本金	127,818.06
加：应计利息	49.37
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：	127,867.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2022 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	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	333,647,845.05	4,126,158.91	340,685,158.91	2,911,154.95
	银行间市场	341,779,710.83	5,462,110.69	351,958,110.69	4,716,289.17
	合计	675,427,555.88	9,588,269.60	692,643,269.60	7,627,444.12
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	675,427,555.88	9,588,269.60	692,643,269.60	7,627,444.12	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 债权投资

本基金本期末未有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本期末未有其他债权投资。

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	1,250.00
其中：交易所市场	1,250.00
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	344,138.35
合计	345,388.35

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中邮纯债丰利债券 A	
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	499,999,803.77	499,999,803.77
本期申购	28.00	28.00
本期赎回(以“-”号填列)	-102.46	-102.46
- 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	499,999,729.31	499,999,729.31

金额单位：人民币元

中邮纯债丰利债券 C		
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	2,021,984.31	2,021,984.31
本期申购	9,922.18	9,922.18
本期赎回(以“-”号填列)	-4,966.72	-4,966.72
- 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	2,026,939.77	2,026,939.77

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

中邮纯债丰利债券 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,981,942.51	8,420,149.12	10,402,091.63
本期利润	11,135,262.07	262,683.99	11,397,946.06
本期基金份额交易产生的变动数	-1.08	-1.24	-2.32
其中：基金申购款	0.37	0.47	0.84
基金赎回款	-1.45	-1.71	-3.16
本期已分配利润	-4,999,997.40	-	-4,999,997.40
本期末	8,117,206.10	8,682,831.87	16,800,037.97

单位：人民币元

中邮纯债丰利债券 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,429.58	34,292.35	40,721.93
本期利润	42,367.88	1,053.40	43,421.28
本期基金份额交易产生的变动数	41.94	94.80	136.74
其中：基金申购款	124.55	182.05	306.60
基金赎回款	-82.61	-87.25	-169.86
本期已分配利润	-20,170.18	-	-20,170.18
本期末	28,669.22	35,440.55	64,109.77

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	1,812.58
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	103,119.55
其他	38.31
合计	104,970.44

6.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期无股票投资收益

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	12,436,816.41
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,319,954.65
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	13,756,771.06

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	184,300,568.02
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	180,275,181.91
减：应计利息总额	2,702,057.98
减：交易费用	3,373.48
买卖债券差价收入	1,319,954.65

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具投资收益

6.4.7.19 股利收益

本报告期内本基金无股利收益。

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	263,737.39
——股票投资	-
——债券投资	263,737.39
——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	263,737.39

6.4.7.21 其他收入

本报告期无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-
银行费用	2,227.24
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
合计	124,965.59

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

本报告期末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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人

首创证券股份有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行交易的情况。

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 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	770,359.18	971,424.60
其中：支付销售机构的客户维护费	1.09	5.37

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 0.30% 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：

日基金管理人报酬 = 前一日的基金资产净值 × 0.30% / 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 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	256,786.35	323,808.20

注：支付基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中邮纯债丰利债券 A	中邮纯债丰利债券 C	合计
中邮创业基金管理股份有限公司	-	2,575.49	2,575.49
合计	-	2,575.49	2,575.49
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中邮纯债丰利债券 A	中邮纯债丰利债券 C	合计
中邮创业基金管理股份有限公司	-	1,436.15	1,436.15
合计	-	1,436.15	1,436.15

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

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

本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期内本基金其他关联方未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 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
上海浦东发展银行股份有限公司	127,867.43	1,812.58	385,381.13	31,114.11

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，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

中邮纯债丰利债券 A

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 6 月 17 日	-	2022 年 6 月 17 日	0.1000	4,999,994.56	2.84	4,999,997.40	
合计	-	-	-	0.1000	4,999,994.56	2.84	4,999,997.40	

中邮纯债丰利债券 C

金额单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份额分红 数	现金形式 发放总额	再投资形式 发放总额	本期利润 分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 6 月 17 日	-	2022 年 6 月 17 日	0.1000	9,941.40	10,228.78	20,170.18	
合计	-	-	-	0.1000	9,941.40	10,228.78	20,170.18	

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

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有银行间市场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 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 175,123,755.26 元,分别于 2022 年 07 月 05 日、2022 年 07 月 06 日、2022 年 07 月 07 日、2022 年 07 月 11 日到期。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金额。

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之内。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	30,175,684.93	30,012,000.00
合计	30,175,684.93	30,012,000.00

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	459,758,521.11	377,107,000.00
AAA 以下	161,064,142.46	158,585,000.00
未评级	-	-
合计	620,822,663.57	535,692,000.00

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 金融资产和金融负债的到期期限分析

6.4.13.3.2 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	127,867.43	-	-	-	127,867.43
结算备付金	1,841,435.37	-	-	-	1,841,435.37
存出保证金	9,867.41	-	-	-	9,867.41
交易性金融资产	61,369,191.78	485,607,462.48	145,666,615.34	-	692,643,269.60
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
发放贷款和垫款	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资（债权投资）	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	63,348,361.99	485,607,462.48	145,666,615.34	-	694,622,439.81
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	175,123,755.26	-	-	-	175,123,755.26
应付清算款	-	-	-	53,832.88	53,832.88
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	128,516.98	128,516.98
应付托管费	-	-	-	42,838.98	42,838.98
应付销售服务费	-	-	-	430.22	430.22
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	36,860.32	36,860.32
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	345,388.35	345,388.35
负债总计	175,123,755.26	-	-	607,867.73	175,731,622.99

利率敏感 度缺口	-111,775,393.27	485,607,462.48	145,666,615.34	-607,867.73	518,890,816.82
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	328,506.87	-	-	-	328,506.87
结算 备付 金	2,687,783.12	-	-	-	2,687,783.12
存出 保证 金	19.15	-	-	-	19.15
交易 性金 融资 产	30,012,000.00	381,796,000.00	153,896,000.00	-	565,704,000.00
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	2,700,000.00	-	-	-	2,700,000.00
应收 证券 清算 款	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-
其他 资产	-	-	-	-11,856,788.00	11,856,788.00
资产	35,728,309.14	381,796,000.00	153,896,000.00	11,856,788.00	583,277,097.14

总计					
负债					
卖出回购金融资产款	70,300,000.00	-	-	-	70,300,000.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	10.14	10.14
应付管理人报酬	-	-	-	130,609.06	130,609.06
应付托管费	-	-	-	43,536.36	43,536.36
应付销售服务费	-	-	-	437.26	437.26
应交税费	-	-	-	45,011.18	45,011.18
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	292,891.50	292,891.50
负债总计	70,300,000.00	-	-	512,495.50	70,812,495.50
利率敏感度缺口	-34,571,690.86	381,796,000.00	153,896,000.00	11,344,292.50	512,464,601.64

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	市场利率上升 25 个基点且其他市场变量保持不变
	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	-14,800,268.32	-5,706,563.46
	2. 基金净资产变动	14,955,884.93	5,896,011.57

6.4.13.4.2 外汇风险

-

6.4.13.4.3 其他价格风险

市场价格风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。

本基金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债券、货币市场工具、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金主要投资于固定收益类资产，包括国债、地方政府债、中央银行票据、中期票据、金融债、企业债、公司债、短期融资券、次级债、中小企业私募债、可转换债券（含可分离交易可转债）、资产支持证券、债券回购、银行存款等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他固定收益类金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金不参与一级市场新股申购或增发新股，也不直接从二级市场上买入股票、权证等权益类金融工具，但可持有因可转债转股所形成的股票、因所持股票所派发的权证以及因投资可分离交易可转债而产生的权证等。因上述原因持有的股票和权证等资产，本基金应在其可交易之日起的 30 个交易日内卖出。本基金的投资组合比例为：本基金投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的 80%；现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中现金类资产不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金面临的整体市场价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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	689,940,770.96	132.96	573,761,511.10	111.96
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	689,940,770.96	132.96	573,761,511.10	111.96

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	固定其它市场变量，当本基金基准上涨 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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	1. 基金净资产变动	40,310,220.59	3,778,381.69
	2. 基金净资产变动	-40,310,220.59	-3,778,381.69

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，利用 2022 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 0.77。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	692,643,269.60	565,704,000.00
第三层次	-	-
合计	692,643,269.60	565,704,000.00

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，本基金持有的金融工具的公允价值未发生所属层次间的重大变动。

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

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：银行存款、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。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金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。

§ 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	692,643,269.60	99.72
	其中：债券	692,643,269.60	99.72
	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	1,969,302.80	0.28

8	其他各项资产	9,867.41	0.00
9	合计	694,622,439.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有股票。

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

本报告期末本基金未持有股票。

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	175,842,300.27	33.89
	其中：政策性金融债	30,175,684.93	5.82
4	企业债券	371,937,470.69	71.68
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	144,863,498.64	27.92
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	692,643,269.60	133.49

注：由于四舍五入的原因报告期末债券投资组合各项目公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

7.6 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	102100276	21 陕延油 MTN001	500,000	51,598,515.07	9.94
2	163094	20 江东 01	450,000	46,007,704.11	8.87
3	188359	21 华福 G1	400,000	41,584,521.64	8.01
4	102101354	21 海尔金控 MTN001	400,000	41,223,813.70	7.94
5	175892	21 诚通 01	400,000	40,983,397.26	7.90

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 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

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为主要目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用国债期货。通过对债券现货和国债期货市场运行趋势的研究，结合国债期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本计划投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

7.10.2 本期国债期货投资评价

本报告期本基金未投资国债期货。

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 21 华福 G1 (188359)，其发行主体华福证券有限责任公司受到福建证监局警示—福建证监局【2021】63 号及【2021】76 号；本基金投资的 20 西安银行二级 01(2020036) 其发行主体西安银行股份有限公司受到陕西银保监局行政处罚—陕银保监罚决字【2022】6 号及陕银保监罚决字【2022】20 号；本基金投资的 21 齐鲁银行二级 01 (2120080) 其发行主体齐鲁银行股份有限公司受到山东银保监局行政处罚—鲁银保监罚决字【2021】14 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

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	9,867.41
2	应收清算款	-
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	9,867.41

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末未持有处于转股期可转债。

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
中邮纯债丰利债券 A	203	2,463,052.85	499,999,410.82	100.00%	318.49	0.00%
中邮纯债丰利债券 C	3	675,646.59	2,026,939.77	100.00%	0.00	0.00%
合计	206	2,437,022.67	502,026,350.59	100.00%	318.49	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	中邮纯债丰利债券 A	0.00	0.00%
	中邮纯债丰利债券 C	0.00	0.00%

	合计	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	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	中邮纯债丰利债券 A	0
	中邮纯债丰利债券 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中邮纯债丰利债券 A	0
	中邮纯债丰利债券 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中邮纯债丰利债券 A	中邮纯债丰利债券 C
基金合同生效日（2020 年 11 月 19 日）基金份额总额	1,000,003,285.16	200.02
本报告期期初基金份额总额	499,999,803.77	2,021,984.31
本报告期基金总申购份额	28.00	9,922.18
减：本报告期基金总赎回份额	102.46	4,966.72
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	499,999,729.31	2,026,939.77

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人、托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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	
兴业证券	2	-	-	-	-	-

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例

兴业证券	147,038,738.95	100.00%	2,385,170,000.00	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	中邮纯债丰利债券型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定媒介	2022 年 1 月 24 日
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上海好买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 2 月 28 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北京中植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 3 月 4 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京东肯特瑞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 3 月 7 日
5	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
6	中邮纯债丰利债券型证券投资基金 2021 年年度报告	规定媒介	2022 年 3 月 11 日
7	中邮纯债丰利债券型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定媒介	2022 年 4 月 22 日
8	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加泰信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	2022 年 6 月 8 日
9	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 14 日
10	中邮纯债丰利债券型证券投资基金分红公告	规定媒介	2022 年 6 月 15 日
11	中邮创业基金管理股份有限	规定媒介	2022 年 6 月 28 日

	公司关于旗下部分基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务的公告		
12	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

§ 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	499,999,000.00	0.00	0.00	499,999,000.00	99.60%
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纯债丰利债券型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮纯债丰利债券型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮纯债丰利债券型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮纯债丰利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

2022 年 8 月 31 日