

中邮睿丰增强债券型证券投资基金 2022 年第 3 季度报告

2022 年 9 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：交通银行股份有限公司

报告送出日期：2022 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本季度报告的财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 07 月 01 日起至 2022 年 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中邮睿丰增强债券 |
| 交易代码 | 013229 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2021 年 9 月 7 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,276,808.20 份 |
| 投资目标 | 在严格控制投资组合风险和保持资金流动性的基础上，追求基金资产的长期稳健增值，并通过积极主动的投资管理，力争获得超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | <p>（一）资产配置策略</p> <p>本基金通过自上而下和自下而上相结合、定性分析和定量分析互相补充的方法，在股票、债券和现金等资产类别之间进行相对稳定的适度配置，强调通过自上而下的宏观分析与自下而上的市场趋势分析有机结合进行前瞻性的决策。本基金资产配置不仅考虑宏观基本面的影响因素同时考虑市场情绪、同业基金仓位水平的影响，并根据市场情况作出应对措施。</p> <p>资产配置层面重在系统性风险的规避。本基金将基于既定的投资策略，充分衡量风险收益比后作出投资决策。</p> <p>（二）股票投资策略</p> <p>在严格控制风险、保持资产流动性的前提下，本基金将适度参与股票等权益类资产的投资，以增加基金收益。</p> <p>本基金对股票的投资以价值投资理念为导向，采取自上而下的多主题投资和自下而上的个股精选方法，本基金将结合对宏观经济状况、行业成长空间、行业集中度、公司竞争优势等因素的判断，综合考察股票所属行业发展前景、上市公司行业地位、竞争优势、盈利能力、成长性、估值水平等多种因素，挑选出预期表现将超过大盘的个股，构建核心组合。</p> |

本基金可通过港股通机制投资港股通机制下允许买卖的规定范围内的香港联交所上市的股票。对于港股通标的股票，本基金主要采用“自下而上”个股研究方式，精选出具有投资价值的优质标的。

本基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

（三）债券投资策略

本基金采用的债券投资策略包括：期限结构策略、信用策略、互换策略、息差策略、可转换债券投资策略等。

1、期限结构策略

通过预测收益率曲线的形状和变化趋势，对各类型债券进行久期配置。具体策略又分为跟踪收益率曲线的骑乘策略和基于收益率曲线变化的子弹策略、杠铃策略及梯式策略。

2、信用策略

信用债收益率等于基准收益率加信用利差，信用利差收益主要受两个方面的影响，一是该信用债对应信用水平的市场平均信用利差曲线走势；二是该信用债本身的信用变化。基于这两方面的因素，本基金管理人分别采用以下两种策略：

（1）基于信用利差曲线变化策略：一是分析经济周期和相关市场变化对信用利差曲线的影响，二是分析信用债市场容量、结构、流动性等变化趋势对信用利差曲线的影响，最后综合各种因素，分析信用利差曲线整体及分行业走势，确定信用债券总的及分行业投资比例。

（2）基于信用债信用变化策略：发行人信用发生变化后，将采用变化后债券信用级别所对应的信用利差曲线对公司债、企业债定价。影响信用债信用风险的因素分为行业风险、公司风险、现金流风险、资产负债风险和其他风险等五个方面。

本基金不参与信用评级 AA 以下的信用债投资。其中投资于信用评级 AA 的信用债占本基金信用债投资比例的 0-20%，投资于信用评级 AA+ 的信用债占本基金信用债投资比例的 0-50%，投资于信用评级 AAA 的信用债占本基金信用债投资比例的 50-100%。

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、公司财务状况、公司运营管理和公司发展前景等方面进行细致的调查研究，分析信用债券的违约风险及合理的信用利差水平，对信用债券进行独立、客观的价值评估，选择风险与收益相匹配的更优品种进行投资。

3、互换策略

不同券种在利息、违约风险、久期、流动性、税收和衍生条款等方面存在差别，基金管理人可以同时买入和卖出具有相近特性的两个或两个以上券种，赚取收益级差。

4、息差策略

通过正回购，融资买入收益率高于回购成本的债券，从而获得杠杆放大收益。

| | | |
|-----------------|--|--------------|
| | <p>5、可转换债券、可交换债券投资策略</p> <p>本基金可转换债券、可交换债券的投资通过对具体品种股性特征、债性特征、期权价值、流动性等各项指标的分析，通过运用量化估值工具对其投资价值进行评估。选择安全边际高、条款设计较好、对应上市公司基本面优良的债券进行投资，包括一级市场申购和二级市场买入，实现超额收益。</p> <p>（四）存托凭证投资策略</p> <p>本基金可投资存托凭证，本基金将结合对宏观经济状况、行业景气度、公司竞争优势、公司治理结构、估值水平等因素的分析判断，选择投资价值高的存托凭证进行投资。</p> <p>（五）资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将分析资产支持证券的资产特征，估计违约率和提前偿付比率，并利用收益率曲线和期权定价模型，对资产支持证券进行估值。本基金将严格控制资产支持证券的总体投资规模并进行分散投资，以降低流动性风险。</p> <p>（六）国债期货投资策略</p> <p>本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。</p> | |
| 业绩比较基准 | 中债综合全价(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×7%+恒生综合指数收益率×3% | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型基金，其长期平均预期风险与预期收益高于货币市场基金，低于混合型、股票型基金。</p> <p>本基金的基金资产如投资于港股，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> | |
| 基金管理人 | 中邮创业基金管理股份有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中邮睿丰增强债券 A | 中邮睿丰增强债券 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 013229 | 013230 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,152,793.08 份 | 124,015.12 份 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022年7月1日—2022年9月30日） | |
|-----------------|---------------------------|------------|
| | 中邮睿丰增强债券 A | 中邮睿丰增强债券 C |
| 1. 本期已实现收益 | 29,534.69 | 231.97 |
| 2. 本期利润 | -175,329.26 | -2,230.28 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0173 | -0.0193 |
| 4. 期末基金资产净值 | 9,764,054.32 | 118,893.01 |
| 5. 期末基金份额净值 | 0.9617 | 0.9587 |

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。

3.2 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

中邮睿丰增强债券 A

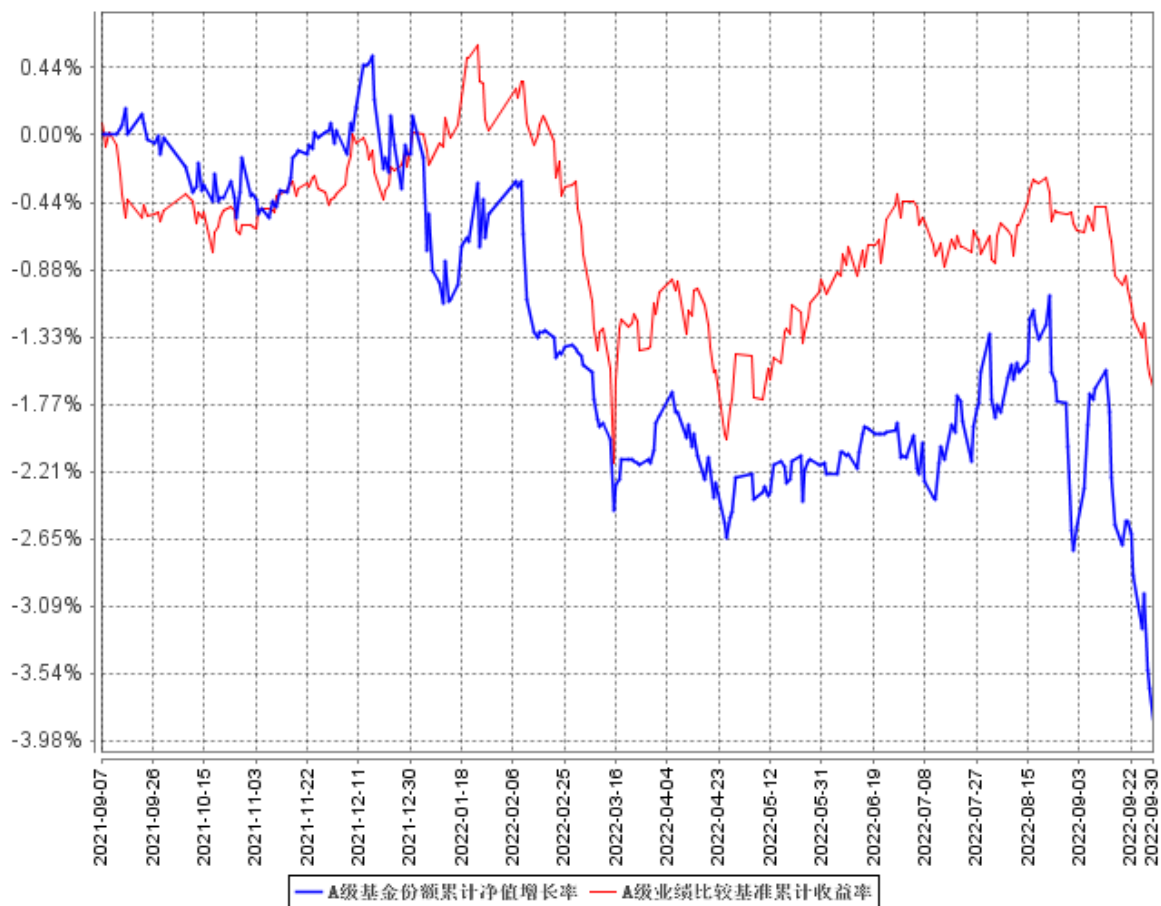
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.77% | 0.22% | -1.23% | 0.10% | -0.54% | 0.12% |
| 过去六个月 | -1.98% | 0.18% | -0.49% | 0.12% | -1.49% | 0.06% |
| 过去一年 | -3.81% | 0.17% | -1.17% | 0.13% | -2.64% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -3.83% | 0.17% | -1.66% | 0.13% | -2.17% | 0.04% |

中邮睿丰增强债券 C

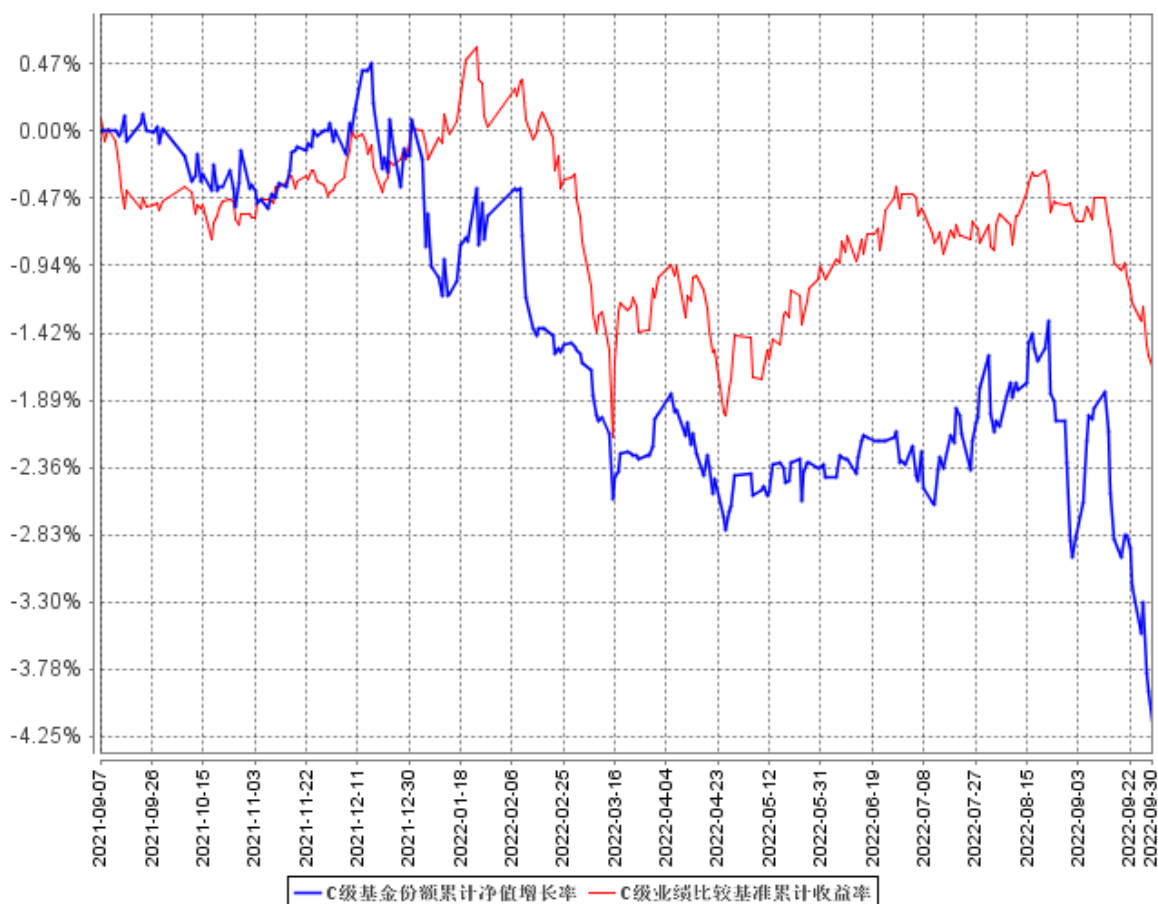
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月 | -1.85% | 0.22% | -1.23% | 0.10% | -0.62% | 0.12% |
| 过去六个月 | -2.15% | 0.18% | -0.49% | 0.12% | -1.66% | 0.06% |
| 过去一年 | -4.15% | 0.17% | -1.17% | 0.13% | -2.98% | 0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | -4.13% | 0.17% | -1.66% | 0.13% | -2.47% | 0.04% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：按相关法规及基金合同规定，本基金自合同生效日起 6 个月内为建仓期，报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 陈梁 | 基金经理 | 2021 年 9 月 7 日 | - | 13 年 | 曾任大连实德集团市场专员、华夏基金管理有限公司行业研究员、中信产业投资基金管理有限公司高级研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部副总经理、中邮乐享收益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 |

| | | | | |
|----|------|----------------|---|---|
| | | | | <p>证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮军民融合灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现任中邮创业基金管理股份有限公司权益投资部副总经理、中邮核心主题混合型证券投资基金、中邮瑞享两年定期开放混合型证券投资基金、中邮消费升级灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、中邮睿丰增强债券型证券投资基金基金经理。</p> |
| 张悦 | 基金经理 | 2021 年 9 月 7 日 | - | <p>9 年</p> <p>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。</p> |

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 公平交易专项说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

三季度经济基本面呈现弱复苏格局，疫情仍然零星爆发，政策宽松持续，资金面维持低位，债券市场总体偏强，短期受到外部冲击和地产政策放松预期的影响有所波动，宽松的资金面下期限利差维持高位，资产荒仍在持续，信用利差继续低位。权益市场二次探底，外部冲击导致风险偏好下滑打击市场情绪，弱复苏背景下偏松的政策和流动性格局有望延续。

三季度，我们坚持适度防御，组合久期维持中性。展望四季度，疫情发展仍有不确定性，弱复苏格局预计将受到各种扰动，国内宽松和刺激政策有望进一步加码，海外加息超预期硬着陆风险加大，组合久期继续维持中性，票息策略仍可提供较好的配置价值。权益方面，疫情和海外局势带来的不确定性仍大，策略上仍然偏防御，传统金融、交运、公用事业等高股息低估值品种是

首选，此外我们会结合估值的安全边际，选择景气度向上的板块进行配置，重点配置板块包括农业，军工和新能源。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中邮睿丰增强债券 A 基金份额净值为 0.9617 元，累计净值为 0.9617 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.77%；截至本报告期末中邮睿丰增强债券 C 基金份额净值为 0.9587 元，累计净值为 0.9587 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.85%；同期业绩比较基准收益率为-1.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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、连续六十个工作日基金净值规模低于五千万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 1,286,369.00 | 12.81 |
| | 其中：股票 | 1,286,369.00 | 12.81 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 8,616,398.04 | 85.83 |
| | 其中：债券 | 8,616,398.04 | 85.83 |
| | 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 | 132,241.01 | 1.32 |
| 8 | 其他资产 | 3,520.14 | 0.04 |
| 9 | 合计 | 10,038,528.19 | 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。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------|-----------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 82,940.00 | 0.84 |

| | | | |
|---|------------------|--------------|-------|
| B | 采矿业 | 189,210.00 | 1.91 |
| C | 制造业 | 625,369.00 | 6.33 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 289,250.00 | 2.93 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 99,600.00 | 1.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 1,286,369.00 | 13.02 |

注：由于四舍五入的原因公允价值占基金资产净值的比例分项之和与合计可能有尾差。

5.2.2 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股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 601985 | 中国核电 | 20,000 | 117,000.00 | 1.18 |
| 2 | 600938 | 中国海油 | 7,000 | 110,810.00 | 1.12 |
| 3 | 600795 | 国电电力 | 25,000 | 101,750.00 | 1.03 |
| 4 | 600233 | 圆通速递 | 4,800 | 99,600.00 | 1.01 |
| 5 | 000733 | 振华科技 | 800 | 92,784.00 | 0.94 |
| 6 | 300850 | 新强联 | 1,000 | 88,100.00 | 0.89 |
| 7 | 600975 | 新五丰 | 11,000 | 82,940.00 | 0.84 |
| 8 | 600699 | 均胜电子 | 6,000 | 79,320.00 | 0.80 |
| 9 | 601899 | 紫金矿业 | 10,000 | 78,400.00 | 0.79 |
| 10 | 600509 | 天富能源 | 15,000 | 70,500.00 | 0.71 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------|--------------|
|----|------|---------|--------------|

| | | | |
|----|-----------|--------------|-------|
| 1 | 国家债券 | 6,707,028.49 | 67.86 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 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） | 1,909,369.55 | 19.32 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 8,616,398.04 | 87.18 |

注：由于四舍五入的原因报告期末按债券品种分类各项目公允价值占基金资产净值比例分项之和与合计可能有尾差。

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|--------|--------------|--------------|
| 1 | 019666 | 22 国债 01 | 66,000 | 6,707,028.49 | 67.86 |
| 2 | 132026 | G 三峡 EB2 | 3,100 | 353,079.89 | 3.57 |
| 3 | 113052 | 兴业转债 | 3,000 | 319,775.59 | 3.24 |
| 4 | 113623 | 风 21 转债 | 2,500 | 274,507.19 | 2.78 |
| 5 | 113050 | 南银转债 | 2,000 | 240,369.37 | 2.43 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

5.10.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|----------|
| 1 | 存出保证金 | 3,520.14 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 3,520.14 |

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|---------|------------|--------------|
| 1 | 113052 | 兴业转债 | 319,775.59 | 3.24 |
| 2 | 113623 | 凤 21 转债 | 274,507.19 | 2.78 |
| 3 | 113050 | 南银转债 | 240,369.37 | 2.43 |
| 4 | 110059 | 浦发转债 | 215,102.47 | 2.18 |
| 5 | 110068 | 龙净转债 | 184,212.95 | 1.86 |
| 6 | 110075 | 南航转债 | 67,448.86 | 0.68 |
| 7 | 127032 | 苏行转债 | 58,990.40 | 0.60 |
| 8 | 110057 | 现代转债 | 57,470.82 | 0.58 |
| 9 | 113044 | 大秦转债 | 55,469.45 | 0.56 |
| 10 | 113021 | 中信转债 | 55,221.84 | 0.56 |
| 11 | 127039 | 北港转债 | 27,720.72 | 0.28 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 中邮睿丰增强债券 A | 中邮睿丰增强债券 C |
|--------------|---------------|------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 10,153,098.58 | 106,187.72 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 3,733.93 | 20,418.00 |

| | | |
|---------------------------|---------------|------------|
| 减:报告期期间基金总赎回份额 | 4,039.43 | 2,590.60 |
| 报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列) | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 10,152,793.08 | 124,015.12 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

| | |
|--------------------------|---------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 10,244,060.06 |
| 报告期期间买入/申购总份额 | - |
| 报告期期间卖出/赎回总份额 | - |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额 | 10,244,060.06 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%) | 99.68 |

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 20220701-20220930 | 10,244,060.06 | - | - | 10,244,060.06 | 99.68% |
| 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准中邮睿丰增强债券型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮睿丰增强债券型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮睿丰增强债券型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮睿丰增强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

9.2 存放地点

基金管理人或基金托管人的办公场所。

9.3 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 10 月 26 日