

中邮睿信增强债券型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：中邮创业基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 1 月 20 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 01 月 19 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 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 中邮睿信增强债券 |
| 交易代码 | 002474 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2016 年 8 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 501,430,151.46 份 |
| 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，力争为投资者提供稳健持续增长的投资收益。 |
| 投资策略 | <p>1、大类资产配置策略</p> <p>本基金根据各项重要的经济指标分析宏观经济发展变动趋势，判断当前所处的经济周期，进而对未来做出科学预测。在此基础上，结合对流动性及资金流向的分析，综合股市和债市估值及风险分析进行灵活的大类资产配置。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。</p> <p>2、股票投资策略</p> <p>本基金将重点关注在中国经济转型过程中，符合经济转型方向、业绩前景明朗的成长型上市公司股票。采用自下而上个股精选的股票投资策略，从战略新兴行业及传统行业处于转型期的企业中精选成长型上市公司股票。</p> <p>3、债券投资策略</p> <p>(1) 平均久期配置</p> <p>本基金通过对宏观经济形势和宏观经济政策进行分析，预测未来的利率趋势，并据此积极调整债券组合的平均久期，在控制债券组合风险的基础上提高组合</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>收益。</p> <p>(2) 期限结构配置 结合对宏观经济形势和政策的判断,运用统计和数量分析技术,本基金对债券市场收益率曲线的期限结构进行分析,预测收益率曲线的变化趋势,制定组合的期限结构配置策略。</p> <p>(3) 类属配置 本基金对不同类型债券的信用风险、流动性、税负水平等因素进行分析,研究同期限的国债、金融债、央票、企业债、公司债、短期融资券之间的利差和变化趋势,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。</p> <p>(4) 回购套利 本基金将在相关法律法规以及基金合同限定的比例内,适时适度运用回购交易套利策略以增强组合的收益率,比如运用回购与现券之间的套利、不同回购期限之间的套利进行低风险的套利操作。</p> <p>4、权证投资策略 本基金将按照相关法律法规通过利用权证及其他金融工具进行套利、避险交易,控制基金组合风险,获取超额收益。</p> <p>5、中小企业私募债券投资策略 中小企业私募债是指中小微企业在中国境内以非公开方式发行和转让,约定在一定期限还本付息的公司债券。与传统的信用债相比,中小企业私募债具有高风险和高收益的显著特点。</p> <p>6、资产支持证券投资策略 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>7、国债期货投资策略 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。</p> |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率*15%+中债综合财富指数*80%+金融机构人民币活期存款基准利率*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,属于证券投资基金中的较低风险品种。 |
| 基金管理人 | 中邮创业基金管理股份有限公司 |
| 基金托管人 | 中国农业银行股份有限公司 |

§ 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 10 月 1 日 — 2022 年 12 月 31 日) |
|-----------------|---|
| 1. 本期已实现收益 | -1,509,807.88 |
| 2. 本期利润 | -8,482,071.57 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.0169 |
| 4. 期末基金资产净值 | 529,630,845.09 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.056 |

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。

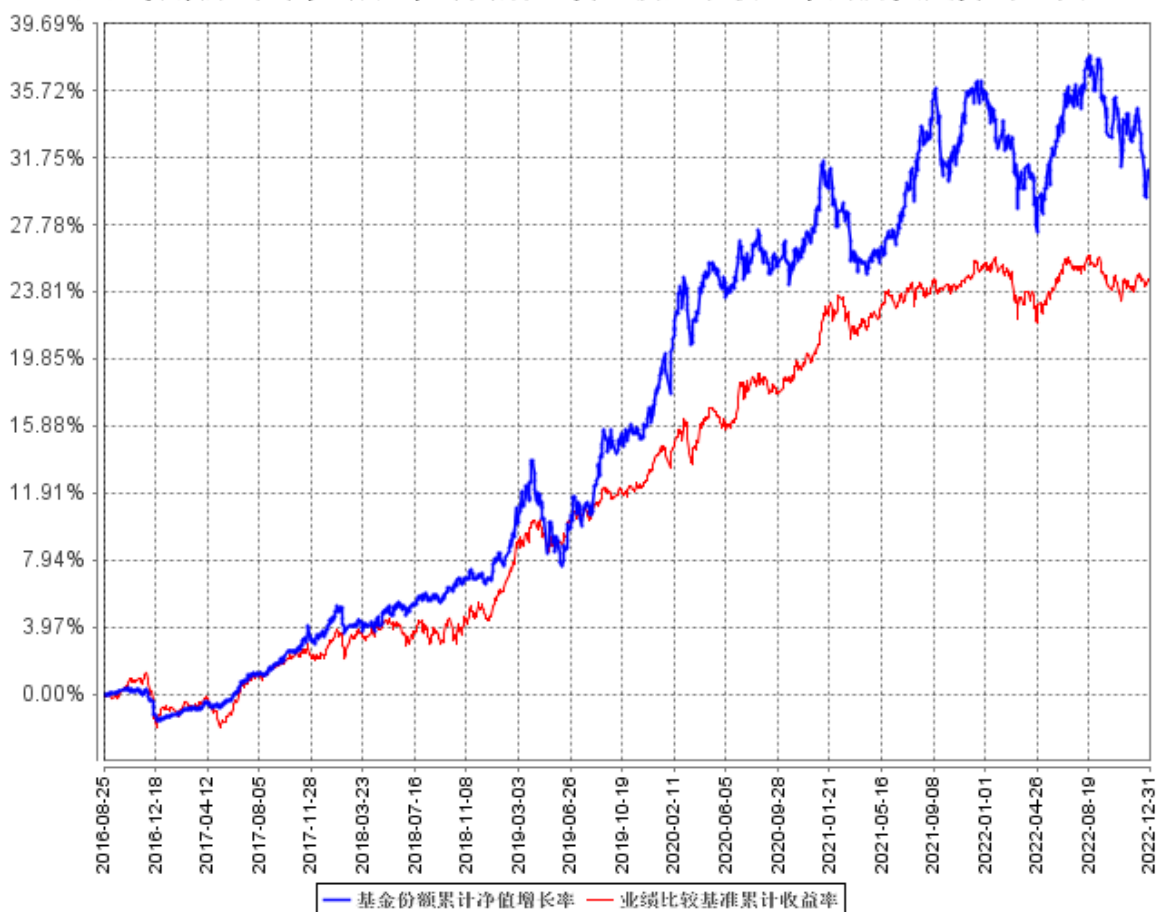
3.2 基金净值表现

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

| 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 | -1.53% | 0.42% | 0.31% | 0.18% | -1.84% | 0.24% |
| 过去六个月 | -3.14% | 0.39% | -0.94% | 0.16% | -2.20% | 0.23% |
| 过去一年 | -3.42% | 0.39% | -0.77% | 0.19% | -2.65% | 0.20% |
| 过去三年 | 11.63% | 0.35% | 9.35% | 0.19% | 2.28% | 0.16% |
| 过去五年 | 26.50% | 0.32% | 21.74% | 0.19% | 4.76% | 0.13% |
| 自基金合同 生效起至今 | 31.06% | 0.29% | 24.59% | 0.18% | 6.47% | 0.11% |

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

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 | | |
| 闫宜乘 | 基金经理 | 2020年9月2日 | - | 7年 | 曾任中国工商银行股份有限公司北京市分行营业部对公客户经理、中信建投证券股份有限公司资金运营部高级经理、中邮创业基金管理股份有限公司中邮中债-1-3年久期央企20债券指数 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | | | | <p>证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债汇利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、中邮纯债聚利债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮货币市场基金、中邮现金驿站货币市场基金基金经理助理、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、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、中邮货币市场基金、中邮现金驿站货币市场基金、中邮淳悦 39 个月定期开放债券型证券投资基金基金经理。现任中邮中债-1-3 年久期央企 20 债券指数证券投资基金、中邮纯债优选一年定期开放债券型证券投资基金、中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮稳定收益债券型证券投资基金、中邮睿利增强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、中邮多策略灵活配置混合型</p> |
|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|------|----------------|---|-----|--|
| | | | | | 证券投资基金基金经理。 |
| 江刘玮 | 基金经理 | 2021 年 3 月 5 日 | - | 6 年 | 曾任中国出口信用保险公司资产管理事业部研究员、中邮创业基金管理股份有限公司研究部研究员、固定收益部研究员、中邮货币市场基金基金、中邮核心优选混合型证券投资基金、中邮战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理助理。现任中邮景泰灵活配置混合型证券投资基金、中邮睿信增强债券型证券投资基金、中邮乐享收益灵活配置混合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基金经理注册或变更等通知的日期。

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

四季度地产和防疫放松引发市场复苏预期，在强预期弱现实的背景下股债发生了大幅波动。展望后市实体经济的复苏仍需等待数据层面的验证，偏松的政策格局短期仍将持续，债券市场仍处在较好的政策环境中，信用利差有望超调后反弹，权益市场受益复苏预期和偏宽松的政策环境整体仍有修复空间。

四季度，我们坚持适度防御，组合久期维持中性。展望 2023 年一季度，疫情感染高峰和病毒变异短期仍对经济有一定影响，但复苏格局基本明确，国内宽松和刺激政策仍有加码空间，海外加息拐点逐步明显，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，周期反转仍需地产层面数据改善，整体策略上仍然偏防御，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，重点配置板块包括医药，黄金。

4.5 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 1.056 元，累计净值为 1.318 元；本报告期基金份额净值增长率为-1.53%，业绩比较基准收益率为 0.31%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警的说明。

§ 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 | 105,308,464.00 | 15.75 |

| | | | |
|---|-------------------|----------------|--------|
| | 其中：股票 | 105,308,464.00 | 15.75 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 501,618,219.01 | 75.04 |
| | 其中：债券 | 501,618,219.01 | 75.04 |
| | 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 | 24,732,223.92 | 3.70 |
| 8 | 其他资产 | 36,813,654.50 | 5.51 |
| 9 | 合计 | 668,472,561.43 | 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 | - | - |
| B | 采矿业 | 9,766,000.00 | 1.84 |
| C | 制造业 | 27,704,664.00 | 5.23 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 27,867,200.00 | 5.26 |
| E | 建筑业 | 986,000.00 | 0.19 |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 22,278,800.00 | 4.21 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 8,018,400.00 | 1.51 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | 2,526,000.00 | 0.48 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,963,900.00 | 0.75 |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,197,500.00 | 0.41 |
| 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 | 105,308,464.00 | 19.88 |

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

本报告期末本基金未投资港股通股票。

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 | 600900 | 长江电力 | 250,000 | 5,250,000.00 | 0.99 |
| 2 | 601985 | 中国核电 | 850,000 | 5,100,000.00 | 0.96 |
| 3 | 600642 | 申能股份 | 800,000 | 4,392,000.00 | 0.83 |
| 4 | 600483 | 福能股份 | 400,000 | 4,232,000.00 | 0.80 |
| 5 | 600025 | 华能水电 | 500,000 | 3,300,000.00 | 0.62 |
| 6 | 601816 | 京沪高铁 | 650,000 | 3,198,000.00 | 0.60 |
| 7 | 002352 | 顺丰控股 | 55,000 | 3,176,800.00 | 0.60 |
| 8 | 600941 | 中国移动 | 45,000 | 3,045,150.00 | 0.57 |
| 9 | 600588 | 用友网络 | 125,000 | 3,021,250.00 | 0.57 |
| 10 | 600233 | 圆通速递 | 140,000 | 2,812,600.00 | 0.53 |

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 | 24,470,292.60 | 4.62 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,105,688.77 | 0.78 |
| | 其中：政策性金融债 | 4,105,688.77 | 0.78 |
| 4 | 企业债券 | 149,445,236.27 | 28.22 |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | 39,673,910.68 | 7.49 |
| 7 | 可转债（可交换债） | 283,923,090.69 | 53.61 |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 501,618,219.01 | 94.71 |

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。

5.5 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 | 132026 | G 三峡 EB2 | 248,950 | 26,255,985.78 | 4.96 |
| 2 | 019666 | 22 国债 01 | 220,000 | 22,444,610.96 | 4.24 |
| 3 | 132018 | G 三峡 EB1 | 162,170 | 21,533,354.69 | 4.07 |
| 4 | 113044 | 大秦转债 | 190,000 | 20,863,795.89 | 3.94 |
| 5 | 163110 | 20 东方 01 | 200,000 | 20,562,113.97 | 3.88 |

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投资。

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投资。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 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。

5.9.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.9.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货。

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

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。

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 | 53,578.90 |

| | | |
|---|---------|---------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 36,750,612.29 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 9,463.31 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 36,813,654.50 |

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 | 132018 | G 三峡 EB1 | 21,533,354.69 | 4.07 |
| 2 | 113044 | 大秦转债 | 20,863,795.89 | 3.94 |
| 3 | 113052 | 兴业转债 | 16,897,115.10 | 3.19 |
| 4 | 113050 | 南银转债 | 14,681,993.16 | 2.77 |
| 5 | 127061 | 美锦转债 | 12,351,368.28 | 2.33 |
| 6 | 110061 | 川投转债 | 11,434,213.70 | 2.16 |
| 7 | 127056 | 中特转债 | 11,371,640.28 | 2.15 |
| 8 | 113623 | 凤 21 转债 | 11,181,617.26 | 2.11 |
| 9 | 113046 | 金田转债 | 9,015,142.60 | 1.70 |
| 10 | 128023 | 亚太转债 | 7,016,924.37 | 1.32 |
| 11 | 127012 | 招路转债 | 6,383,312.39 | 1.21 |
| 12 | 113043 | 财通转债 | 5,837,882.30 | 1.10 |
| 13 | 127018 | 本钢转债 | 5,241,667.81 | 0.99 |
| 14 | 128127 | 文科转债 | 5,009,433.84 | 0.95 |
| 15 | 113024 | 核建转债 | 4,742,514.93 | 0.90 |
| 16 | 127053 | 豪美转债 | 4,692,653.23 | 0.89 |
| 17 | 110068 | 龙净转债 | 4,677,768.77 | 0.88 |
| 18 | 127039 | 北港转债 | 4,391,045.75 | 0.83 |
| 19 | 123132 | 回盛转债 | 4,158,925.90 | 0.79 |
| 20 | 128136 | 立讯转债 | 3,922,156.60 | 0.74 |
| 21 | 110067 | 华安转债 | 3,636,969.91 | 0.69 |
| 22 | 128125 | 华阳转债 | 3,148,191.78 | 0.59 |
| 23 | 113057 | 中银转债 | 2,935,101.37 | 0.55 |

| | | | | |
|----|--------|----------|--------------|------|
| 24 | 128075 | 远东转债 | 2,859,969.18 | 0.54 |
| 25 | 123113 | 仙乐转债 | 2,765,827.29 | 0.52 |
| 26 | 128144 | 利民转债 | 2,609,932.88 | 0.49 |
| 27 | 110081 | 闻泰转债 | 2,477,532.90 | 0.47 |
| 28 | 113641 | 华友转债 | 2,324,202.90 | 0.44 |
| 29 | 113636 | 甬金转债 | 2,316,216.44 | 0.44 |
| 30 | 123075 | 贝斯转债 | 2,243,030.14 | 0.42 |
| 31 | 123115 | 捷捷转债 | 2,032,059.95 | 0.38 |
| 32 | 110047 | 山鹰转债 | 1,950,405.34 | 0.37 |
| 33 | 113045 | 环旭转债 | 1,826,445.15 | 0.34 |
| 34 | 110062 | 烽火转债 | 1,770,356.71 | 0.33 |
| 35 | 127015 | 希望转债 | 1,724,423.89 | 0.33 |
| 36 | 127022 | 恒逸转债 | 1,575,018.90 | 0.30 |
| 37 | 110079 | 杭银转债 | 1,510,648.44 | 0.29 |
| 38 | 127020 | 中金转债 | 1,465,320.82 | 0.28 |
| 39 | 128130 | 景兴转债 | 1,360,315.07 | 0.26 |
| 40 | 113616 | 韦尔转债 | 1,295,223.12 | 0.24 |
| 41 | 127060 | 湘佳转债 | 1,237,872.90 | 0.23 |
| 42 | 127044 | 蒙娜转债 | 1,111,112.33 | 0.21 |
| 43 | 113638 | 台 21 转债 | 1,096,032.88 | 0.21 |
| 44 | 113037 | 紫银转债 | 1,008,160.82 | 0.19 |
| 45 | 127063 | 贵轮转债 | 983,656.11 | 0.19 |
| 46 | 110073 | 国投转债 | 945,375.53 | 0.18 |
| 47 | 123108 | 乐普转 2 | 823,434.93 | 0.16 |
| 48 | 113545 | 金能转债 | 690,718.36 | 0.13 |
| 49 | 123092 | 天壕转债 | 595,502.60 | 0.11 |
| 50 | 113605 | 大参转债 | 562,478.08 | 0.11 |
| 51 | 127019 | 国城转债 | 554,513.01 | 0.10 |
| 52 | 132022 | 20 广版 EB | 367,688.71 | 0.07 |
| 53 | 110060 | 天路转债 | 360,130.90 | 0.07 |

5.10.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|----------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 489,518,480.33 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 137,385,771.08 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 125,474,099.95 |
| 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 | 501,430,151.46 |

§ 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 | 35,605,654.15 |
| 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 | 35,605,654.15 |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例（%） | 7.10 |

注：本期无变动

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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|---|----------------|------------|

| 资 者 类 别 | 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 | 20221001-20221114 202211 24-20221204 20221230-202 21231 | 101,907,111.62 | 0.00 | 0.00 | 101,907,111.62 | 20.32% |
| 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信增强债券型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮睿信增强债券型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮睿信增强债券型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮睿信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住所。

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

2023 年 1 月 20 日