

中邮定期开放债券型证券投资基金

2018年半年度报告摘要

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(或基金经理助理)的任职日期	解聘日期	基金经理从业年限	说明
张勇	基金经理	2013年11月5日	-	13年	张勇先生,毕业于上海财经大学,曾在中国工商银行总行资产管理部、交通银行总行资产管理部、中邮证券资产管理部担任重要职务,具有多年基金投资管理经验,2013年加入中邮证券,任中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理,现任中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理。张勇先生持有基金从业资格,并通过了中国证券投资基金业协会基金从业资格考试,符合中国证监会规定的基金经理任职条件。张勇先生为基金行业高级管理人员,曾任中国工商银行总行资产管理部、交通银行总行资产管理部、中邮证券资产管理部担任重要职务,具有多年基金投资管理经验,2013年加入中邮证券,任中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理,现任中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理。张勇先生持有基金从业资格,并通过了中国证券投资基金业协会基金从业资格考试,符合中国证监会规定的基金经理任职条件。
李恒	基金经理	2018年5月18日	-	4年	李恒先生毕业于南开大学,具有多年证券从业经验,曾任中邮证券资产管理部研究员、中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理助理,现任中邮定期开放债券型证券投资基金基金经理。李恒先生持有基金从业资格,并通过了中国证券投资基金业协会基金从业资格考试,符合中国证监会规定的基金经理任职条件。

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。

证券投资基金的从业行为应当符合《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》等相关规定。

4.2 管理人报告期内本基金遵守法律法规的情况说明
 报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等相关法律法规,未发生重大违法违规行为,本基金在研究、投资、交易等各方面受到公平对待,确保各基金获得公平交易的机会。

4.3 公平交易制度的执行情况
 在证监会颁发《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》后,由基金工程部组织,对交易部和投资部相关人员进行了培训,督促相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的顺利执行,公司与华泰软件公司共同开发了公平交易系统,并按月度、季度、年度生成各只基金之间的交易价差分析报告,逐一分析得出结论后发送给相关部门和人员。对于报告中产生的异常情况,在做合理解释后,提请各部门相关人员引起重视,完善公司内部公平交易制度,使之更符合监管指导意见精神,并避免类似情况再次发生,最后妥善保存分析报告备查。

4.4 异常交易行为的专项说明
 报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.5 基金管理人内部控制制度的总体评价
 报告期内,本基金管理人内部控制制度健全,并得到有效执行。本基金管理人建立了较为完善的内部控制制度,涵盖了基金管理业务的各个环节,并定期进行评估和更新。本基金管理人将继续加强内部控制建设,提升风险管理水平,确保基金财产的安全和基金份额持有人的合法权益。

4.6 基金管理人报告期内基金估值程序等事项的说明
 本基金管理人按照相关法律法规和中国证监会的有关规定,制定了基金估值程序,并得到有效执行。本基金管理人将继续加强估值管理,提升估值准确性,确保基金份额持有人的合法权益。

4.7 基金管理人报告期内基金净值变动情况的说明
 报告期内,本基金净值出现波动,主要原因在于市场利率波动较大,导致债券价格波动。本基金管理人将继续关注市场动态,灵活调整投资策略,力争实现基金资产的保值增值。

项目	基金	业绩比较基准	所有可比投资组合
报告期所有者权益(基金净值)	1,535,526,119.79	16,141,761.01	1,551,667,880.80
2.本期应计入所有者权益的公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
3.本期公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-29,941,216.87	-678,755.69	-30,619,972.56
4.本期经营活动产生现金流量净额(为损失以“-”号填列)	60,004.55	2,970.88	63,075.43
5.本期经营活动产生的现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-30,000,221.62	-681,728.35	-30,681,950.00
6.本期现金及现金等价物净增加额	-2,915,106.70	-681,728.35	-2,915,106.70
7.期末现金及现金等价物余额	311,327.17	327,097.83	311,327.17
8.期末可供分配的基金份额	42,612,357.65	22,956,672.54	42,612,357.65
9.期末可供分配的基金份额净值	42,612,357.65	22,956,672.54	42,612,357.65

基金管理人报告期内基金净值变动情况的说明
 报告期内,本基金净值出现波动,主要原因在于市场利率波动较大,导致债券价格波动。本基金管理人将继续关注市场动态,灵活调整投资策略,力争实现基金资产的保值增值。

项目	基金	业绩比较基准	所有可比投资组合
报告期所有者权益(基金净值)	2,730,209,694.83	126,208,081.81	2,856,477,776.64
2.本期应计入所有者权益的公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	22,956,672.54	22,956,672.54
3.本期公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-210,668.79	-834,424.68	-227,450,806.06
4.本期经营活动产生现金流量净额(为损失以“-”号填列)	3,000,668.79	60,705.88	3,061,374.67
5.本期经营活动产生的现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-222,119,483.37	-8,627,738.64	-230,747,222.01
6.本期现金及现金等价物净增加额	-219,668.00	-8,567,032.76	-219,668.00
7.期末现金及现金等价物余额	2,730,209,694.83	126,208,081.81	2,856,477,776.64

基金管理人报告期内基金净值变动情况的说明
 报告期内,本基金净值出现波动,主要原因在于市场利率波动较大,导致债券价格波动。本基金管理人将继续关注市场动态,灵活调整投资策略,力争实现基金资产的保值增值。

项目	基金	业绩比较基准	所有可比投资组合
报告期所有者权益(基金净值)	1,505,584,902.92	57,875,363.17	1,563,460,266.09
2.本期应计入所有者权益的公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
3.本期公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
4.本期经营活动产生现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
5.本期经营活动产生的现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
6.本期现金及现金等价物净增加额	-	-	-
7.期末现金及现金等价物余额	-	-	-

基金管理人报告期内基金净值变动情况的说明
 报告期内,本基金净值出现波动,主要原因在于市场利率波动较大,导致债券价格波动。本基金管理人将继续关注市场动态,灵活调整投资策略,力争实现基金资产的保值增值。

项目	基金	业绩比较基准	所有可比投资组合
报告期所有者权益(基金净值)	1,505,584,902.92	57,875,363.17	1,563,460,266.09
2.本期应计入所有者权益的公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
3.本期公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
4.本期经营活动产生现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
5.本期经营活动产生的现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
6.本期现金及现金等价物净增加额	-	-	-
7.期末现金及现金等价物余额	-	-	-

基金管理人报告期内基金净值变动情况的说明
 报告期内,本基金净值出现波动,主要原因在于市场利率波动较大,导致债券价格波动。本基金管理人将继续关注市场动态,灵活调整投资策略,力争实现基金资产的保值增值。

项目	基金	业绩比较基准	所有可比投资组合
报告期所有者权益(基金净值)	1,505,584,902.92	57,875,363.17	1,563,460,266.09
2.本期应计入所有者权益的公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
3.本期公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
4.本期经营活动产生现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
5.本期经营活动产生的现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
6.本期现金及现金等价物净增加额	-	-	-
7.期末现金及现金等价物余额	-	-	-

基金管理人报告期内基金净值变动情况的说明
 报告期内,本基金净值出现波动,主要原因在于市场利率波动较大,导致债券价格波动。本基金管理人将继续关注市场动态,灵活调整投资策略,力争实现基金资产的保值增值。

净值 1.039 元,基金份额总额 1,459,499,136.93 份;中邮定期开放债券 C 基金份额净值 1.035 元,基金份额总额 46,085,765.99 份。中邮定期开放债券基金份额总额合计为 1,505,584,902.92 份。

6.2 利润分配
 会计主体:中邮定期开放债券型证券投资基金
 本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

项目	期初	本期	上期可比期间
一、收入	62,270,028.86	61,573,568.71	62,270,028.86
1.利息收入	65,107,647.93	107,001,240.94	65,107,647.93
其中:存款利息收入	2,283,613.09	17,681,660.03	2,283,613.09
债券利息收入	62,786,192.56	89,101,796.08	62,786,192.56
资产支持证券利息收入	-	-	-
公允价值变动损益	77,841.85	47,884.83	77,841.85
二、费用	21,656,271.21	38,078,267.17	21,656,271.21
1.管理人报酬	4,602,299.57	5,006,968.66	4,602,299.57
2.托管费	1,564,099.91	3,023,332.84	1,564,099.91
3.销售服务费	64,823	311,325.36	64,823
4.交易费用	12,526.68	16,308.89	12,526.68
5.利息支出	14,918,029.17	26,292,229.66	14,918,029.17
6.其他费用	202,010.98	-	202,010.98
7.其他损益	301,327.17	327,097.83	301,327.17
8.其他损益	42,612,357.65	22,956,672.54	42,612,357.65
9.其他损益	-	-	-
10.其他损益	-	-	-
11.其他损益	-	-	-
12.其他损益	-	-	-
13.其他损益	-	-	-
14.其他损益	-	-	-
15.其他损益	-	-	-
16.其他损益	-	-	-
17.其他损益	-	-	-
18.其他损益	-	-	-
19.其他损益	-	-	-
20.其他损益	-	-	-
21.其他损益	-	-	-
22.其他损益	-	-	-
23.其他损益	-	-	-
24.其他损益	-	-	-
25.其他损益	-	-	-
26.其他损益	-	-	-
27.其他损益	-	-	-
28.其他损益	-	-	-
29.其他损益	-	-	-
30.其他损益	-	-	-
31.其他损益	-	-	-
32.其他损益	-	-	-
33.其他损益	-	-	-
34.其他损益	-	-	-
35.其他损益	-	-	-
36.其他损益	-	-	-
37.其他损益	-	-	-
38.其他损益	-	-	-
39.其他损益	-	-	-
40.其他损益	-	-	-
41.其他损益	-	-	-
42.其他损益	-	-	-
43.其他损益	-	-	-
44.其他损益	-	-	-
45.其他损益	-	-	-
46.其他损益	-	-	-
47.其他损益	-	-	-
48.其他损益	-	-	-
49.其他损益	-	-	-
50.其他损益	-	-	-
51.其他损益	-	-	-
52.其他损益	-	-	-
53.其他损益	-	-	-
54.其他损益	-	-	-
55.其他损益	-	-	-
56.其他损益	-	-	-
57.其他损益	-	-	-
58.其他损益	-	-	-
59.其他损益	-	-	-
60.其他损益	-	-	-
61.其他损益	-	-	-
62.其他损益	-	-	-
63.其他损益	-	-	-
64.其他损益	-	-	-
65.其他损益	-	-	-
66.其他损益	-	-	-
67.其他损益	-	-	-
68.其他损益	-	-	-
69.其他损益	-	-	-
70.其他损益	-	-	-
71.其他损益	-	-	-
72.其他损益	-	-	-
73.其他损益	-	-	-
74.其他损益	-	-	-
75.其他损益	-	-	-
76.其他损益	-	-	-
77.其他损益	-	-	-
78.其他损益	-	-	-
79.其他损益	-	-	-
80.其他损益	-	-	-
81.其他损益	-	-	-
82.其他损益	-	-	-
83.其他损益	-	-	-
84.其他损益	-	-	-
85.其他损益	-	-	-
86.其他损益	-	-	-
87.其他损益	-	-	-
88.其他损益	-	-	-
89.其他损益	-	-	-
90.其他损益	-	-	-
91.其他损益	-	-	-
92.其他损益	-	-	-
93.其他损益	-	-	-
94.其他损益	-	-	-
95.其他损益	-	-	-
96.其他损益	-	-	-
97.其他损益	-	-	-
98.其他损益	-	-	-
99.其他损益	-	-	-
100.其他损益	-	-	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
 会计主体:中邮定期开放债券型证券投资基金
 本报告期:2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

项目	2018 年 1 月 1 日	2018 年 6 月 30 日	上期可比期间
报告期所有者权益(基金净值)	1,535,526,119.79	16,141,761.01	1,551,667,880.80
2.本期应计入所有者权益的公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
3.本期公允价值变动损益(为损失以“-”号填列)	-	42,612,357.65	42,612,357.65
4.本期经营活动产生现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
5.本期经营活动产生的现金流量净额(为损失以“-”号填列)	-	-	-
6.本期现金及现金等价物净增加额	-	-	-
7.期末现金及现金等价物余额	-	-	-
8.期末可供分配的基金份额	-	-	-
9.期末可供分配的基金份额净值	-	-	-
10.其他损益	-	-	-
11.其他损益	-	-	-
12.其他损益	-	-	-
13.其他损益	-	-	-
14.其他损益	-	-	-
15.其他损益	-	-	-
16.其他损益	-	-	-
17.其他损益	-	-	-
18.其他损益	-	-	-
19.其他损益	-	-	-
20.其他损益	-	-	-
21.其他损益	-	-	-
22.其他损益	-	-	-
23.其他损益	-	-	-
24.其他损益	-	-	-
25.其他损益	-	-	-
26.其他损益	-	-	-
27.其他损益	-	-	-
28.其他损益	-	-	-
29.其他损益	-	-	-
30.其他损益	-	-	-
31.其他损益	-	-	-
32.其他损益	-	-	-
33.其他损益	-	-	-
34.其他损益	-	-	-
35.其他损益	-	-	-
36.其他损益	-	-	-
37.其他损益	-	-	-
38.其他损益	-	-	-
39.其他损益	-	-	-
40.其他损益	-	-	-
41.其他损益	-	-	-
42.其他损益	-	-	-
43.其他损益	-	-	-
44.其他损益	-	-	-
45.其他损益	-	-	-
46.其他损益	-	-	-
47.其他损益	-	-	-
48.其他损益	-	-	-
49.其他损益	-	-	-
50.其他损益	-	-	-
51.其他损益	-	-	-
52.其他损益	-	-	-
53.其他损益	-	-	-
54.其他损益	-	-	-
55.其他损益	-	-	-
56.其他损益	-	-	-
57.其他损益	-	-	-
58.其他损益	-	-	-
59.其他损益	-	-	-
60.其他损益	-	-	-
61.其他损益	-	-	-
62.其他损益	-	-	-
63.其他损益	-	-	-
64.其他损益	-	-	-
65.其他损益	-	-	-
66.其他损益	-	-	-
67.其他损益	-	-	-
68.其他损益	-	-	-
69.其他损益	-	-	