

# 中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 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：中国银行股份有限公司

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。

基金托管人中国银行股份有限公司（简称：中国银行）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

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>10</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2 基金净值表现.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>13</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
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
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>18</b>
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	23
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
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.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	56
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	57
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>59</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>60</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>64</b>
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.....	64

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>65</b>
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中邮中证 500 指数增强	
基金主代码	590007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 12 月 25 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	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	43,199,565.27 份	
下属分级基金的基金简称:	中邮中证 500 指数增强 A	中邮中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码:	590007	008124
报告期末下属分级基金的份额总额	29,432,067.26 份	13,767,498.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票指数增强型基金，以指数化分散投资为主，适度的增强型主动管理为辅，在严格控制跟踪偏离风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，分享中国经济增长的成果。在正常市场情况下，本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>
投资策略	<p>本基金为股票指数增强型基金，以中证 500 指数为基金投资组合跟踪的标的指数。本基金以指数化分散投资为主要投资策略，在此基础上进行适度的主动增强，在基本面深入研究与量化投资技术的结合中，谋求基金投资组合在严控跟踪偏离风险与力争获得适度超额收益之间的最佳匹配。</p> <p>当预期成分股发生调整和成分股发生分红、配股、增发等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪基准指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和跟踪基准指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并辅之以金融衍生产品投资管理等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。</p> <p>本基金的投资策略包括以下几个层面：</p> <p>1、资产配置策略</p> <p>本基金为股票指数增强型基金，采用“被动投资为主，主动增强为辅”国际通行的量化多因子选股模型进行的投资策略投资。为实现有效跟踪并力争超越标的指数的投资目标，在资产类别配置上，本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%，其余基金资产可适当投资于债券、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）。</p> <p>2、股票投资策略</p>

本基金采用的量化模型主要分为“多因子模型”和“组合优化模型”、“风险模型”三个部分：

#### （1）多因子模型

首先，我们筛选出在 A 股具备长期超额收益的单因子构建因子池，单因子选择上，既要保证单因子超额收益的稳定性和统计学上的显著，也要保证因子具备一定的投资逻辑。单因子主要基于财务数据和量价数据构建，包括但不限于以下指标：

- 1) 估值类因子：如市盈率、市净率、市销率等；
- 2) 盈利类因子：如总资产收益率、净资产收益率等；
- 3) 成长类因子：营业收入同比、净利润同比、经营现金流同比等；
- 4) 质量类因子：资产负债率、账面市值比等；
- 5) 一致预期类因子：预期净利润、预期营业收入等；
- 6) 动量/反转类因子：20 日收益率、240 日收益率等；
- 7) 波动性因子：过去一个月日收益标准差、过去六个月日收益标准差等；
- 8) 流动性因子：过去一个月日均成交量、过去一个月日均换手率等；
- 9) 规模类因子：总市值、流动市值等；
- 10) 其他：如分红类因子、其他技术类因子等；

之后，应用 ICIR、机器学习等方法对个股进行打分或收益率预测。

#### （2）组合优化模型

我们将通过组合优化模型确定最终的投资组合，在模型构建时，包括但不限于以下限制条件：

- 1) 交易成本；
- 2) 组合相对基准指数的行业、市值偏离以及各类风险因子敞口（详见风险模型）；
- 3) 投资于标的指数成分股及其备选成分股的比例；
- 4) 日均跟踪偏离度；

#### （3）风险模型

通过构建风险模型控制投资组合在各类风险因子上的敞口，降低组合相对指数超额收益的波动，风险因子包括但不限于行业、规模、波动、成长等；

#### 3、债券投资策略

本基金债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。本基金将通过对宏观经济形势和宏观经济政策分析，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；通过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；通过对不同类型债券的信用风险、流动性、税赋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。

#### 4、股票组合调整策略

本基金为股票指数增强型基金，基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、成分股流动性异常、成分股调整及配股、分红、增发等因素变化，对基金投资组合进行适时调整，以保证基金净值增长率与业绩比较基准间的高度正相关和跟踪误差最小化。

#### （1）定期调整

	<p>本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的中证 500 指数对其成分股的调整而进行相应的跟踪调整。根据标的指数的编制规则及调整公告，基金经理在指数成分股调整生效前，分析并确定组合调整策略，并报投资决策委员会批准。基金经理通过执行批准后的组合调整策略，尽量减少成分股变更带来的跟踪偏离度和跟踪误差。</p> <p>(2) 不定期调整</p> <p>若基金投资组合表现与指数组合表现偏离超过基金管理人确定的预警水平，基金经理将根据市场状况及个股权重偏离状况，制定组合调整策略，降低组合跟踪偏离度。</p> <p>此外，我们将根据组合效果、市场状况及交易成本等多个因素确定量化多因子选股模型的调仓频率。</p> <p>5、跟踪误差控制策略</p> <p>本基金采取“跟踪误差”和“跟踪偏离度”这两个指标对投资组合进行监控与评估。其中，跟踪误差为核心监控指标，跟踪偏离度为辅助监控指标，以求控制投资组合相对于业绩比较基准的偏离风险。</p> <p>6、股指期货投资策略</p> <p>本基金在风险可控的前提下，以套期保值为目的，参与股指期货的投资。选择流动性好且交易活跃的合约，根据对证券市场走势的判断，通过买入期货合约降低建仓期股票价格大幅上涨的风险，通过卖出期货合约对冲现货市场的下行风险。此外，通过股指期货的投资，还可以提升资金使用效率，降低仓位调整的交易成本以及跟踪误差。</p> <p>7、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>8、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p>
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
	中邮中证 500 指数增强 A
	中邮中证 500 指数增强 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	中国银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	侯玉春	许俊
	联系电话	010-82295160—157	95566
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		010—58511618	95566
传真		010-82295155	010-66594942
注册地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		北京市东城区和平里中街乙 16 号	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码		100013	100818
法定代表人		毕劲松	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	基金管理人及基金托管人住所。

## 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	中邮中证 500 指数增强 A	中邮中证 500 指数增强 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	-2,854,037.76	-301,597.15
本期利润	-2,646,646.49	930,018.67
加权平均基金份额本期利润	-0.0997	0.1737
本期加权平均净值利润率	-7.70%	13.21%
本期基金份额净值增长率	-8.29%	-8.42%
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	9,588,263.15	4,816,942.80
期末可供分配基金份额利润	0.3258	0.3499
期末基金资产净值	39,462,476.25	18,584,440.81
期末基金份额净值	1.3408	1.3499
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	35.85%	34.99%

#### 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

中邮中证 500 指数增强 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	7.53%	1.03%	6.74%	1.05%	0.79%	-0.02%
过去三个月	2.11%	1.58%	1.99%	1.66%	0.12%	-0.08%
过去六个月	-8.29%	1.49%	-11.65%	1.55%	3.36%	-0.06%
过去一年	-0.76%	1.25%	-4.83%	1.26%	4.07%	-0.01%
自基金合同生效起至今	35.85%	1.38%	24.05%	1.32%	11.80%	0.06%

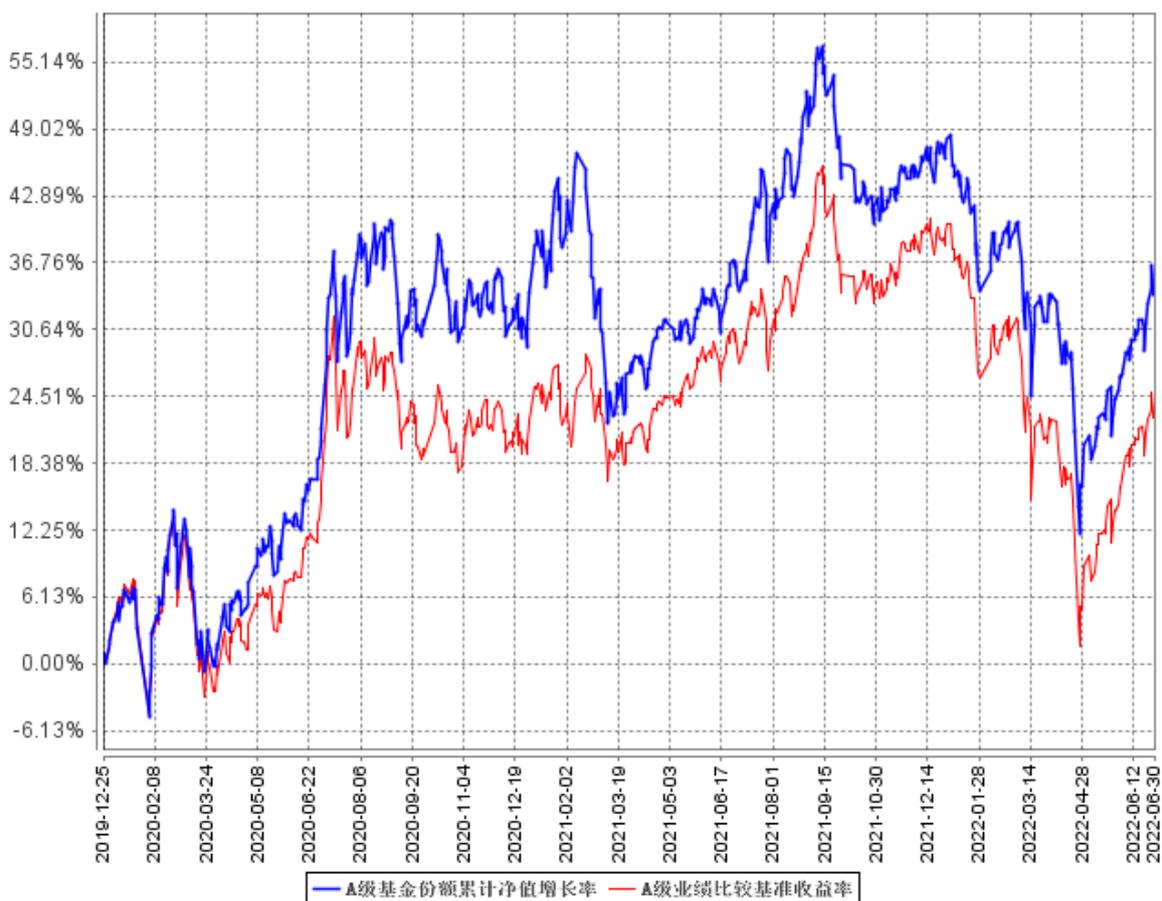
中邮中证 500 指数增强 C

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	7.51%	1.03%	6.74%	1.05%	0.77%	-0.02%
过去三个月	2.05%	1.58%	1.99%	1.66%	0.06%	-0.08%

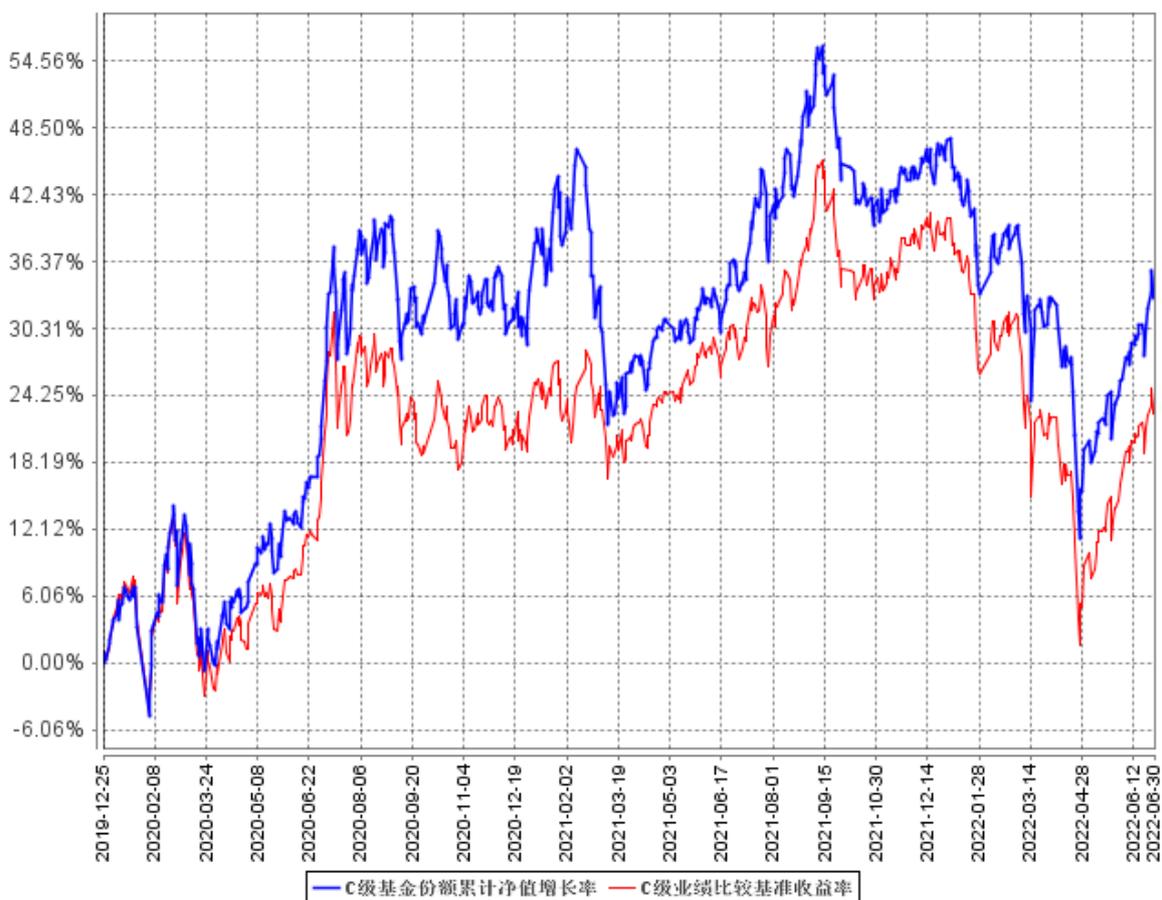
过去六个月	-8.42%	1.49%	-11.65%	1.55%	3.23%	-0.06%
过去一年	-1.05%	1.25%	-4.83%	1.26%	3.78%	-0.01%
自基金合同生效起至今	34.99%	1.38%	24.05%	1.32%	10.94%	0.06%

### 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		
王高	基金经理	2020年7月8日	-	7年	曾任中邮创业基金管理股份有限公司量化投资部量化分析师、基金经理助理。曾任中邮乐享收益灵活配置混合型证券投资基金基金经理。现担任中邮中证500指数增强型证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮价值优选一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、中邮多策略灵活配置混合型证券投资基金、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金基金经理。
王喆	基金经理	2018年11月16日	2022年4月15日	10年	曾就职于中国工商银行北京分行海淀西区支行、中国工商银行总行资产管理部从事投资管理及研究分析、中邮创业基金管理股份有限公司从事证券投资研究工作。曾任中邮乐享收益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、中邮绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、中邮稳健添利灵活配置混合型证券投资基金、中邮风格轮动灵活配置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、中邮悦享6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。

					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

今年前 4 月，受到全球流动性收缩以及国内经济预期走弱的影响，股票市场出现了连续性、大幅度的下跌；4 月底以来随着疫情形势逐步缓解，国家“稳增长”政策不断落地，经济复苏预期走强，市场迎来了较大幅度的反弹，尤其以新能源车、光伏、风电等为代表的需求端处于快速增长并且前期下跌较多的景气板块上涨较多，上半年市场经历了深 V 行情，个股波动明显比前两年增大。风格上来看，4 月份之前价值风格和低波动风格明显跑赢成长风格，小市值风格明显跑

赢大市值风格，而 4 月底以来，成长风格反弹较多，明显跑赢价值风格，低波动风格则落后于市场。

本基金是跟踪基准指数的指数增强型基金，主要应用量化投资模型，力求使基金净值增长超越基准指数，并严格控制跟踪误差，降低对基准指数的偏离风险。

上半年，本基金沿用基本面叠加量化多因子选股思路，优化因子的选择和权重配置，控制股票组合与基准指数的风格偏离，分散持仓股票组合的风格暴露，降低股票组合与基准指数的跟踪误差；后续本基金将不断改进现有量化选股模型，根据市场环境挖掘更多有效的选股因子，提高选股策略的有效性，并根据持仓股票的具体情况不定期对组合进行优化，力求基金净值增长稳定超越基准指数。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末中邮中证 500 指数增强 A 基金份额净值为 1.3408 元，累计净值为 1.8508 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.29%；截至本报告期末中邮中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.3499 元，累计净值为 1.3499 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.42%；同期业绩比较基准收益率为-11.65%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为市场在经历了大幅度、快速的反弹上涨之后，上半年因为疫情影响以及经济走弱预期所导致的过度下跌基本上已经完成了修复，下半年市场走势将依赖经济恢复及货币政策的影响。从行业板块和风格角度来看，下半年市场将趋向于均衡，行业边际向好幅度较大的行业将会有超额收益，个股层面的分化仍将持续，基本面向好、成长性高的股票仍将优于基本面变化较小、成长性较低的股票。

#### 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，本基金未进行利润分配。

#### 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

本基金本报告期内，有连续二十个工作日基金净值规模低于五千万元的情形。

## § 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对中邮中证 500 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，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应尽的义务。

### 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

本报告期内，本托管人根据《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，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，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地复核，未发现本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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 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：中邮中证 500 指数增强型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,742,620.10	2,693,336.09
结算备付金		274,820.88	7,061.12
存出保证金		21,303.87	13,003.22
交易性金融资产	6.4.7.2	53,226,940.22	30,719,455.74
其中：股票投资		53,226,940.22	30,719,455.74
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	-	-
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		2,373,303.98	263,346.09
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	266.10
资产总计		60,638,989.05	33,696,468.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		962,029.97	-

应付赎回款		1,140,092.32	296,660.99
应付管理人报酬		25,161.61	16,356.76
应付托管费		8,387.22	5,452.24
应付销售服务费		3,258.80	855.65
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	453,142.07	356,737.66
负债合计		2,592,071.99	676,063.30
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	43,199,565.27	22,561,806.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	14,847,351.79	10,458,598.59
净资产合计		58,046,917.06	33,020,405.06
负债和净资产总计		60,638,989.05	33,696,468.36

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，中邮中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.3408 元，基金份额总额 29,432,067.26 份；中邮中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.3499 元，基金份额总额 13,767,498.01 份。中邮中证 500 指数增强份额总额合计为 43,199,565.27 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮中证 500 指数增强型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-1,395,157.09	1,505,614.52
1.利息收入		8,919.82	4,990.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,919.82	4,990.97
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,900,273.65	2,318,756.79
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,444,034.20	1,990,359.73
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	543,760.55	328,397.06
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	1,439,007.09	-826,598.66
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	57,189.65	8,465.42
<b>减：二、营业总支出</b>		321,470.73	572,944.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	121,732.35	94,398.44
2. 托管费	6.4.10.2.2	40,577.47	31,466.17
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	10,147.43	2,526.47
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	149,013.48	444,553.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,716,627.82	932,669.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-1,716,627.82	932,669.78
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-1,716,627.82	932,669.78

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中邮中证 500 指数增强型证券投资基金

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	22,561,806.47	-	10,458,598.59	33,020,405.06

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)	22,561,806.47	-	10,458,598.59	33,020,405.06
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	20,637,758.80	-	4,388,753.20	25,026,512.00
(一)、综合收益总额	-	-	-1,716,627.82	-1,716,627.82
(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)	20,637,758.80	-	6,105,381.02	26,743,139.82
其中：1.基金申购款	65,313,481.64	-	20,970,332.28	86,283,813.92
2.基金赎回款	-44,675,722.84	-	-14,864,951.26	-59,540,674.10
(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)	43,199,565.27	-	14,847,351.79	58,046,917.06
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)	26,837,735.89	-	8,681,775.42	35,519,511.31
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)	26,837,735.89	-	8,681,775.42	35,519,511.31
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,859,912.73	-	-238,355.13	-3,098,267.86
(一)、综合收益总额	-	-	932,669.78	932,669.78
(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)	-2,859,912.73	-	-1,171,024.91	-4,030,937.64
其中：1.基金申购款	11,282,535.93	-	3,577,040.92	14,859,576.85
2.基金赎回款	-14,142,448.66	-	-4,748,065.83	-18,890,514.49
(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)	23,977,823.16	-	8,443,420.29	32,421,243.45

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 \_\_\_\_\_

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_ 唐亚明 \_\_\_\_\_

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_ 佟 珊 \_\_\_\_\_

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中邮中证 500 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）由中邮上证 380 指数增强型证券投资基金（以下简称“中邮上证 380 指数基金”）转型而来。根据基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司于 2019 年 12 月 12 日发布的《中邮创业基金管理股份有限公司关于中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，原中邮上证 380 指数基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会。基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效，基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，定于 2019 年 12 月 25 日正式实施基金转型。《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》自 2019 年 12 月 25 日起生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为中邮创业基金管理股份有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）。

根据《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》和《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据申购费用、销售服务费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者申购时收取申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用、但不计提销售服务费的基金份额，称为 A 类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式分别为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，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股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括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、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、股指期货、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）。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

## 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监会公告[2010]5号《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，真实完整地反映了基金财务状况、经营成果和所有者权益(基金净值)变动表等有关信息。

## 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在新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 266.10 元，全部调整至相关金融资产的账面价值中，其中 257.10 元重分类至银行存款，3.10 元重分类至结算备付金，5.90 元重分类至存出保证金，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 2,693,336.09 元，调整后账面金额为 2,693,593.19 元；结算备付金调整前账面金额为 7,061.12 元，调整后账面金额为 7,064.22 元；存出保证金调整前账面金额为 13,003.22 元，调整后账面金额为 13,009.12 元。

应付交易费用调整前账面金额为 70,320.63 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 286,417.03 元，调整后账面金额为 356,737.66 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[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部国家税务总局证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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；基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；对个人持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

2. 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

3. 对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

4. 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。对基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（2）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 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	4,742,620.10

等于：本金	4,742,218.92
加：应计利息	401.18
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：	4,742,620.10

#### 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	51,304,175.48	-	53,226,940.22	1,922,764.74
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,304,175.48	-	53,226,940.22	1,922,764.74

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

### 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

本基金本报告期末未持有债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告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	122,094.06
其中：交易所市场	122,094.06
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	269,630.98
应付指数使用费	50,000.00
其他	11,417.03
合计	453,142.07

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

中邮中证 500 指数增强 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	19,682,604.49	19,682,604.49
本期申购	14,607,032.73	14,607,032.73
本期赎回(以“-”号填列)	-4,857,569.96	-4,857,569.96
- 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	29,432,067.26	29,432,067.26

金额单位：人民币元

中邮中证 500 指数增强 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	2,879,201.98	2,879,201.98
本期申购	50,706,448.91	50,706,448.91
本期赎回(以“-”号填列)	-39,818,152.88	-39,818,152.88
- 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	13,767,498.01	13,767,498.01

#### 6.4.7.11 其他综合收益

无。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

中邮中证 500 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	8,600,123.96	493,707.95	9,093,831.91
本期利润	-2,854,037.76	207,391.27	-2,646,646.49
本期基金份额交易产生的变动数	3,842,176.95	-258,953.38	3,583,223.57
其中：基金申购款	5,668,157.72	-659,576.48	5,008,581.24
基金赎回款	-1,825,980.77	400,623.10	-1,425,357.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,588,263.15	442,145.84	10,030,408.99

单位：人民币元

中邮中证 500 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,431,858.81	-67,092.13	1,364,766.68
本期利润	-301,597.15	1,231,615.82	930,018.67
本期基金份额交易产生的变动数	4,148,778.27	-1,626,620.82	2,522,157.45
其中：基金申购款	20,821,806.42	-4,860,055.38	15,961,751.04
基金赎回款	-16,673,028.15	3,233,434.56	-13,439,593.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,279,039.93	-462,097.13	4,816,942.80

#### 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	6,006.19
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	1,705.86
其他	1,207.77
合计	8,919.82

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	97,841,400.80
减：卖出股票成本总额	100,964,355.58
减：交易费用	321,079.42
买卖股票差价收入	-3,444,034.20

#### 6.4.7.15 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本报告期间，本基金无资产支持证券投资。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	543,760.55
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	543,760.55

**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	1,439,007.09
——股票投资	1,439,007.09
——债券投资	-
——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	1,439,007.09

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	57,189.65
合计	57,189.65

注：本基金赎回费率按照持有时间递减，即基金份额持有时间越长，所适用的赎回费率越低。对于赎回时份额持有不满 30 天的，收取的赎回费全额计入基金财产。

**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	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	4,382.50
指数使用费	100,000.00

合计	149,013.48
----	------------

## 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
中国银行股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
首创证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

## 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，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 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	121,732.35	94,398.44
其中：支付销售机构的客户维护费	41,649.63	40,864.04

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 0.60% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.60%/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	40,577.47	31,466.17

注：支付基金托管人中国银行股份有限公司的基金托管费，按前一日基金资产净值 0.20%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×0.20%/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		
	中邮中证 500 指数增强 A	中邮中证 500 指数增强 C	合计
中邮创业基金管理股份有限公司	-	1,349.19	1,349.19
首创证券股份有限公司	-	51.94	51.94
合计	-	1,401.13	1,401.13
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		
	中邮中证 500 指数增强 A	中邮中证 500 指数增强 C	合计
合计	-	-	-

#### 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**

本报告期内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**

本报告期内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固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	中邮中证 500 指数增强 A	中邮中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 25 日）持有的基金份额	973,172.50	-
报告期初持有的基金份额	973,172.50	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	973,172.50	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.25%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	中邮中证 500 指数增强 A	中邮中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 25 日）持有的基金份额	973,172.50	-
报告期初持有的基金份额	973,172.50	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	973,172.50	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	4.06%	-
-------------------------	-------	---

#### 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

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的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		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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,742,620.10	6,006.19	2,085,102.70	3,813.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

#### 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

本报告期内本基金为发生利润分配。

#### 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

本报告期末本基金未持有因认购/增发而持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本期末本基金未持有暂时停牌流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期内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。

### 6.4.13.3 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，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股，如需对组合进行调整时，由于指数成份股流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度、持仓集中度、流通受限资产占比、7 日可变现资产占比等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在

不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

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	4,742,620.10	-	-	-	4,742,620.10
结算备付金	274,820.88	-	-	-	274,820.88
存出保证金	21,303.87	-	-	-	21,303.87
交易性金融资产	-	-	-	53,226,940.22	53,226,940.22
应收申购款	-	-	-	2,373,303.98	2,373,303.98
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	5,038,744.85	-	-	55,600,244.20	60,638,989.05
负债					
应付证券清算款	-	-	-	962,029.97	962,029.97
应付赎回款	-	-	-	1,140,092.32	1,140,092.32

应付管理人 报酬				25,161.61	25,161.61
应付托管费				8,387.22	8,387.22
应付销售服 务费				3,258.80	3,258.80
其他负债				453,142.07	453,142.07
负债总计				2,592,071.99	2,592,071.99
利率敏感度 缺口	5,038,744.85			-53,008,172.21	58,046,917.06
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	2,693,336.09				2,693,336.09
结算备付金	7,061.12				7,061.12
存出保证金	13,003.22				13,003.22
交易性金融 资产				-30,719,455.74	30,719,455.74
其他资产				266.10	266.10
应收申购款				263,346.09	263,346.09
资产总计	2,713,400.43			-30,983,067.93	33,696,468.36
负债					
应付赎回款				296,660.99	296,660.99
应付管理人 报酬				16,356.76	16,356.76
应付托管费				5,452.24	5,452.24
应付销售服 务费				855.65	855.65
其他负债				356,737.66	356,737.66
负债总计				676,063.30	676,063.30
利率敏感度 缺口	2,713,400.43			-30,307,004.63	33,020,405.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

本基金本期末及上年度末未持有债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括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、中期票据、短期融资券、次级债、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券或票据）、股指期货、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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金可以按照法律法规和监管部门的有关规定进行融资以及参与转融通等相关业务。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 90-95%，其中投资于标的指数成分股及其备选成分股的资产占非现金基金资产的比例不低于 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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：

#### 6.4.13.4.2.1 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	53,226,940.22	91.70	30,719,455.74	93.03
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	53,226,940.22	91.70	30,719,455.74	93.03

**6.4.13.4.2.2 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）
	基金净资产变动	499,950.76	325,553.69
	基金净资产变动	-499,950.76	-325,553.69

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 0.94。

**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	53,226,940.22	30,716,860.53
第二层次	-	2,595.21
第三层次	-	-
合计	53,226,940.22	30,719,455.74

#### **6.4.14.2 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。

#### **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	53,226,940.22	87.78
	其中：股票	53,226,940.22	87.78
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	5,017,440.98	8.27
8	其他各项资产	2,394,607.85	3.95
9	合计	60,638,989.05	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 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	110,700.00	0.19
B	采矿业	3,013,790.00	5.19
C	制造业	28,086,642.20	48.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	386,060.00	0.67
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,150,669.00	3.71
G	交通运输、仓储和邮政业	950,201.00	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,361,722.00	7.51
J	金融业	2,967,688.00	5.11
K	房地产业	935,948.00	1.61

L	租赁和商务服务业	134,135.00	0.23
M	科学研究和技术服务业	79,660.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	50,600.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	634,440.00	1.09
R	文化、体育和娱乐业	1,788,292.00	3.08
S	综合	-	-
	合计	45,650,547.20	78.64

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。

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	554,240.00	0.95
B	采矿业	110,607.00	0.19
C	制造业	5,599,510.02	9.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	198,627.00	0.34
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	113,220.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	764,422.00	1.32
J	金融业	69,381.00	0.12
K	房地产业	74,256.00	0.13
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	92,130.00	0.16
S	综合	-	-
	合计	7,576,393.02	13.05

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。

### 7.2.3 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。

## 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

## 7.3.1 期末指数投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002240	盛新锂能	15,000	905,400.00	1.56
2	600348	华阳股份	57,800	893,588.00	1.54
3	600546	山煤国际	45,700	889,322.00	1.53
4	600256	广汇能源	84,300	888,522.00	1.53
5	601615	明阳智能	25,000	845,000.00	1.46
6	601456	国联证券	67,700	830,679.00	1.43
7	600418	江淮汽车	47,000	806,520.00	1.39
8	002384	东山精密	35,100	804,843.00	1.39
9	000729	燕京啤酒	81,000	782,460.00	1.35
10	000738	航发控制	27,800	781,180.00	1.35
11	002867	周大生	50,000	776,500.00	1.34
12	002756	永兴材料	5,000	761,050.00	1.31
13	600298	安琪酵母	15,400	750,750.00	1.29
14	601555	东吴证券	108,300	750,519.00	1.29
15	300037	新宙邦	14,160	744,249.60	1.28
16	000553	安道麦 A	60,000	726,600.00	1.25
17	603712	七一二	22,800	718,200.00	1.24
18	300363	博腾股份	9,000	701,910.00	1.21
19	600160	巨化股份	53,300	700,895.00	1.21
20	002244	滨江集团	80,000	692,000.00	1.19
21	000975	银泰黄金	70,000	681,800.00	1.17
22	002439	启明星辰	34,000	677,620.00	1.17
23	600718	东软集团	58,400	672,184.00	1.16
24	000988	华工科技	29,000	671,930.00	1.16
25	600901	江苏租赁	130,000	666,900.00	1.15
26	300251	光线传媒	70,000	662,900.00	1.14
27	688188	柏楚电子	3,000	660,120.00	1.14
28	300182	捷成股份	120,000	660,000.00	1.14
29	600699	均胜电子	42,000	659,820.00	1.14
30	002326	永太科技	20,000	658,600.00	1.13
31	688099	晶晨股份	6,377	644,077.00	1.11
32	300244	迪安诊断	20,400	634,440.00	1.09

33	603939	益丰药房	12,000	633,960.00	1.09
34	000400	许继电气	33,000	633,600.00	1.09
35	688006	杭可科技	9,000	630,540.00	1.09
36	300357	我武生物	12,000	624,360.00	1.08
37	600867	通化东宝	60,000	620,400.00	1.07
38	002156	通富微电	40,000	616,000.00	1.06
39	300009	安科生物	60,000	606,600.00	1.05
40	603613	国联股份	6,835	605,581.00	1.04
41	600195	中牧股份	49,000	600,740.00	1.03
42	603707	健友股份	21,200	597,840.00	1.03
43	603077	和邦生物	140,000	596,400.00	1.03
44	600582	天地科技	120,000	573,600.00	0.99
45	600597	光明乳业	45,000	568,350.00	0.98
46	600835	上海机电	41,100	564,303.00	0.97
47	600037	歌华有线	60,000	563,400.00	0.97
48	600528	中铁工业	69,300	557,865.00	0.96
49	002203	海亮股份	48,000	554,400.00	0.96
50	002294	信立泰	19,700	553,570.00	0.95
51	603866	桃李面包	33,000	546,150.00	0.94
52	002128	电投能源	36,000	515,520.00	0.89
53	600377	宁沪高速	59,600	510,772.00	0.88
54	000807	云铝股份	50,000	494,000.00	0.85
55	600737	中粮糖业	65,100	489,552.00	0.84
56	601098	中南传媒	49,300	465,392.00	0.80
57	600522	中天科技	8,700	200,970.00	0.35
58	603883	老百姓	5,850	198,198.00	0.34
59	603858	步长制药	7,200	141,912.00	0.24
60	300285	国瓷材料	3,900	140,088.00	0.24
61	600511	国药股份	5,000	133,900.00	0.23
62	002572	索菲亚	4,800	132,000.00	0.23
63	002078	太阳纸业	10,700	131,717.00	0.23
64	600998	九州通	10,500	125,055.00	0.22
65	002500	山西证券	21,700	124,558.00	0.21
66	600392	盛和资源	5,500	124,300.00	0.21
67	600563	法拉电子	600	123,096.00	0.21
68	601077	渝农商行	33,200	122,840.00	0.21
69	000060	中金岭南	27,500	122,650.00	0.21
70	000623	吉林敖东	8,100	119,556.00	0.21
71	002673	西部证券	18,000	117,720.00	0.20

72	600598	北大荒	7,500	110,700.00	0.19
73	600549	厦门钨业	5,000	108,100.00	0.19
74	002373	千方科技	9,700	107,864.00	0.19
75	300724	捷佳伟创	1,200	107,220.00	0.18
76	000031	大悦城	26,700	106,800.00	0.18
77	600808	马钢股份	28,000	106,120.00	0.18
78	600399	抚顺特钢	5,800	103,820.00	0.18
79	600177	雅戈尔	15,600	103,428.00	0.18
80	300166	东方国信	11,100	102,342.00	0.18
81	601577	长沙银行	12,900	102,297.00	0.18
82	600282	南钢股份	32,000	100,800.00	0.17
83	603868	飞科电器	1,300	98,475.00	0.17
84	000039	中集集团	7,100	98,335.00	0.17
85	002152	广电运通	10,500	97,335.00	0.17
86	600236	桂冠电力	15,800	96,222.00	0.17
87	601187	厦门银行	16,100	95,956.00	0.17
88	300383	光环新网	9,100	94,822.00	0.16
89	002409	雅克科技	1,700	94,367.00	0.16
90	002385	大北农	11,900	92,939.00	0.16
91	600642	申能股份	16,300	92,584.00	0.16
92	000401	冀东水泥	8,800	92,576.00	0.16
93	000581	威孚高科	4,800	92,400.00	0.16
94	002985	北摩高科	1,560	91,384.80	0.16
95	002557	洽洽食品	1,600	91,088.00	0.16
96	000869	张裕 A	3,000	89,220.00	0.15
97	600859	王府井	3,400	88,332.00	0.15
98	600233	圆通速递	4,300	87,677.00	0.15
99	000887	中鼎股份	4,800	87,552.00	0.15
100	603056	德邦股份	6,500	87,295.00	0.15
101	002273	水晶光电	7,200	87,192.00	0.15
102	002390	信邦制药	12,600	87,066.00	0.15
103	000629	攀钢钒钛	22,700	86,260.00	0.15
104	300168	万达信息	9,100	85,904.00	0.15
105	002028	思源电气	2,400	85,584.00	0.15
106	600171	上海贝岭	3,400	85,102.00	0.15
107	600623	华谊集团	10,200	84,660.00	0.15
108	000547	航天发展	7,000	83,580.00	0.14
109	002595	豪迈科技	3,700	82,658.00	0.14
110	600827	百联股份	6,200	81,902.00	0.14

111	002925	盈趣科技	3,800	81,776.00	0.14
112	600705	中航产融	23,400	80,964.00	0.14
113	603127	昭衍新药	700	79,660.00	0.14
114	002508	老板电器	2,200	79,266.00	0.14
115	002131	利欧股份	40,800	79,152.00	0.14
116	000089	深圳机场	10,100	77,972.00	0.13
117	300257	开山股份	5,200	77,792.00	0.13
118	601636	旗滨集团	6,000	76,500.00	0.13
119	300001	特锐德	4,400	76,164.00	0.13
120	600517	国网英大	14,500	75,255.00	0.13
121	002815	崇达技术	5,800	74,298.00	0.13
122	601228	广州港	20,000	73,400.00	0.13
123	002603	以岭药业	3,000	72,900.00	0.13
124	603225	新凤鸣	6,300	72,702.00	0.13
125	002183	怡亚通	10,000	72,100.00	0.12
126	600027	华电国际	18,200	71,526.00	0.12
127	300699	光威复材	1,200	70,644.00	0.12
128	002268	卫士通	1,600	68,656.00	0.12
129	601000	唐山港	25,200	65,016.00	0.11
130	600516	方大炭素	8,500	64,600.00	0.11
131	600376	首开股份	13,100	64,321.00	0.11
132	000959	首钢股份	13,400	63,784.00	0.11
133	300618	寒锐钴业	1,100	63,712.00	0.11
134	300058	蓝色光标	9,500	62,035.00	0.11
135	600801	华新水泥	3,000	58,530.00	0.10
136	601608	中信重工	15,300	57,987.00	0.10
137	000027	深圳能源	8,900	57,049.00	0.10
138	000967	盈峰环境	10,000	50,600.00	0.09
139	600141	兴发集团	1,100	48,389.00	0.08
140	001965	招商公路	6,300	48,069.00	0.08
141	000540	中天金融	23,600	45,548.00	0.08
142	600157	永泰能源	28,100	44,679.00	0.08
143	002705	新宝股份	2,000	43,980.00	0.08
144	603650	彤程新材	1,300	42,354.00	0.07
145	600765	中航重机	1,260	40,546.80	0.07
146	601969	海南矿业	4,000	34,360.00	0.06
147	600875	东方电气	2,000	32,900.00	0.06
148	300088	长信科技	4,100	30,422.00	0.05
149	002180	纳思达	600	30,372.00	0.05

150	600885	宏发股份	700	29,295.00	0.05
151	000537	广宇发展	2,100	27,279.00	0.05
152	601016	节能风电	5,000	24,000.00	0.04

### 7.3.2 期末积极投资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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300316	晶盛机电	12,000	811,080.00	1.40
2	002852	道道全	58,000	748,200.00	1.29
3	688536	思瑞浦	1,200	673,908.00	1.16
4	002459	晶澳科技	8,000	631,200.00	1.09
5	601877	正泰电器	17,000	608,260.00	1.05
6	002539	云图控股	36,000	575,640.00	0.99
7	600975	新五丰	64,000	554,240.00	0.95
8	000625	长安汽车	30,000	519,600.00	0.90
9	300751	迈为股份	480	235,632.00	0.41
10	300763	锦浪科技	1,050	223,650.00	0.39
11	002340	格林美	24,300	221,130.00	0.38
12	688005	容百科技	1,200	155,328.00	0.27
13	000733	振华科技	1,000	135,970.00	0.23
14	603290	斯达半导	300	115,770.00	0.20
15	600754	锦江酒店	1,800	113,220.00	0.20
16	000090	天健集团	16,400	112,996.00	0.19
17	003022	联泓新科	3,400	112,982.00	0.19
18	000758	中色股份	22,900	110,607.00	0.19
19	002085	万丰奥威	19,100	102,567.00	0.18
20	600776	东方通信	8,500	95,625.00	0.16
21	300133	华策影视	18,500	92,130.00	0.16
22	300315	掌趣科技	27,100	90,514.00	0.16
23	601117	中国化学	9,100	85,631.00	0.15
24	000723	美锦能源	6,100	74,420.00	0.13
25	600266	城建发展	18,200	74,256.00	0.13
26	600643	爱建集团	11,700	69,381.00	0.12
27	603893	瑞芯微	700	63,658.00	0.11
28	600884	杉杉股份	1,700	50,524.00	0.09
29	300223	北京君正	300	31,875.00	0.05
30	601089	福元医药	1,194	25,133.70	0.04

31	001323	慕思股份	382	18,740.92	0.03
32	603051	鹿山新材	191	15,089.00	0.03
33	001318	阳光乳业	648	14,327.28	0.02
34	001268	联合精密	286	7,927.92	0.01
35	603272	联翔股份	236	5,180.20	0.01

## 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300251	光线传媒	1,653,044.00	5.01
2	300316	晶盛机电	1,618,479.00	4.90
3	002203	海亮股份	1,598,255.00	4.84
4	002244	滨江集团	1,584,704.00	4.80
5	600975	新五丰	1,579,961.00	4.78
6	600160	巨化股份	1,551,099.00	4.70
7	002539	云图控股	1,550,276.00	4.69
8	600901	江苏租赁	1,493,585.00	4.52
9	603613	国联股份	1,470,104.83	4.45
10	600195	中牧股份	1,455,082.00	4.41
11	600348	华阳股份	1,389,375.58	4.21
12	601928	凤凰传媒	1,287,061.00	3.90
13	600741	华域汽车	1,284,239.00	3.89
14	601098	中南传媒	1,283,341.00	3.89
15	000988	华工科技	1,277,796.00	3.87
16	002128	电投能源	1,238,082.00	3.75
17	600597	光明乳业	1,152,682.00	3.49
18	002384	东山精密	1,121,276.00	3.40
19	000729	燕京啤酒	1,121,034.00	3.39
20	000733	振华科技	1,111,249.00	3.37
21	688099	晶晨股份	1,107,972.77	3.36
22	601615	明阳智能	1,047,102.00	3.17
23	601200	上海环境	1,043,185.00	3.16
24	000629	攀钢钒钛	1,042,265.00	3.16

25	600315	上海家化	1,020,541.05	3.09
26	600487	亨通光电	1,020,337.00	3.09
27	600820	隧道股份	1,014,862.00	3.07
28	000553	安道麦 A	1,012,829.00	3.07
29	601555	东吴证券	1,010,509.00	3.06
30	000738	航发控制	992,588.00	3.01
31	601000	唐山港	985,899.00	2.99
32	000090	天健集团	981,411.00	2.97
33	000975	银泰黄金	977,007.00	2.96
34	600233	圆通速递	964,425.00	2.92
35	600867	通化东宝	960,763.00	2.91
36	600563	法拉电子	931,758.00	2.82
37	603868	飞科电器	921,396.00	2.79
38	000807	云铝股份	919,672.00	2.79
39	002156	通富微电	907,298.00	2.75
40	600256	广汇能源	906,677.00	2.75
41	300168	万达信息	903,686.00	2.74
42	600418	江淮汽车	897,129.00	2.72
43	002240	盛新锂能	888,740.00	2.69
44	600718	东软集团	887,032.00	2.69
45	000959	首钢股份	874,190.00	2.65
46	601899	紫金矿业	873,081.00	2.64
47	688005	容百科技	870,275.83	2.64
48	000400	许继电气	868,583.00	2.63
49	002410	广联达	868,523.00	2.63
50	601877	正泰电器	864,389.00	2.62
51	600754	锦江酒店	854,682.00	2.59
52	601985	中国核电	849,239.00	2.57
53	600582	天地科技	846,985.00	2.57
54	600271	航天信息	835,148.00	2.53
55	600037	歌华有线	831,041.00	2.52
56	000598	兴蓉环境	829,469.00	2.51
57	600380	健康元	828,592.00	2.51
58	002294	信立泰	824,985.00	2.50
59	600572	康恩贝	822,612.00	2.49
60	300244	迪安诊断	810,792.00	2.46

61	002019	亿帆医药	808,888.00	2.45
62	600919	江苏银行	805,490.00	2.44
63	000686	东北证券	805,344.00	2.44
64	600298	安琪酵母	796,057.00	2.41
65	600737	中粮糖业	793,259.00	2.40
66	603707	健友股份	791,440.34	2.40
67	601828	美凯龙	791,096.00	2.40
68	000625	长安汽车	786,958.00	2.38
69	600528	中铁工业	784,688.00	2.38
70	600546	山煤国际	782,219.00	2.37
71	002812	恩捷股份	773,657.00	2.34
72	600030	中信证券	771,708.00	2.34
73	000425	徐工机械	771,190.00	2.34
74	300680	隆盛科技	758,520.00	2.30
75	000685	中山公用	758,151.00	2.30
76	600649	城投控股	758,078.00	2.30
77	600377	宁沪高速	756,425.00	2.29
78	600835	上海机电	755,578.00	2.29
79	601231	环旭电子	752,625.00	2.28
80	601456	国联证券	746,679.00	2.26
81	002081	金螳螂	745,064.00	2.26
82	600729	重庆百货	742,119.00	2.25
83	002701	奥瑞金	740,515.00	2.24
84	600639	浦东金桥	738,268.00	2.24
85	600728	佳都科技	732,524.00	2.22
86	000683	远兴能源	730,168.61	2.21
87	002008	大族激光	708,381.00	2.15
88	300363	博腾股份	701,112.00	2.12
89	600153	建发股份	698,572.00	2.12
90	002326	永太科技	693,591.00	2.10
91	002852	道道全	692,113.00	2.10
92	002756	永兴材料	686,187.00	2.08
93	603806	福斯特	680,409.00	2.06
94	603712	七一二	675,318.00	2.05
95	688188	柏楚电子	663,237.02	2.01
96	002867	周大生	660,987.00	2.00

注：买入金额均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002244	滨江集团	1,468,929.00	4.45
2	000733	振华科技	1,410,683.00	4.27
3	600160	巨化股份	1,329,530.00	4.03
4	601928	凤凰传媒	1,234,089.00	3.74
5	603868	飞科电器	1,191,674.00	3.61
6	600741	华域汽车	1,151,749.00	3.49
7	600975	新五丰	1,136,303.00	3.44
8	600195	中牧股份	1,125,360.00	3.41
9	600348	华阳股份	1,122,394.94	3.40
10	601985	中国核电	1,108,606.00	3.36
11	600729	重庆百货	1,090,006.35	3.30
12	600233	圆通速递	1,066,075.00	3.23
13	002203	海亮股份	1,061,305.00	3.21
14	002539	云图控股	1,023,341.00	3.10
15	000999	华润三九	1,017,232.07	3.08
16	600820	隧道股份	1,011,189.00	3.06
17	300251	光线传媒	1,003,987.00	3.04
18	603613	国联股份	1,003,644.00	3.04
19	000090	天健集团	987,408.00	2.99
20	601200	上海环境	975,701.00	2.95
21	600535	天士力	957,838.00	2.90
22	002557	洽洽食品	949,677.00	2.88
23	300680	隆盛科技	947,950.00	2.87
24	000729	燕京啤酒	944,854.00	2.86
25	000629	攀钢钒钛	938,154.00	2.84
26	600728	佳都科技	931,536.00	2.82
27	000988	华工科技	929,639.00	2.82
28	002008	大族激光	919,316.50	2.78
29	600546	山煤国际	918,300.00	2.78
30	600315	上海家化	918,285.00	2.78
31	601000	唐山港	916,555.00	2.78
32	600597	光明乳业	906,628.00	2.75

33	601899	紫金矿业	888,641.00	2.69
34	300316	晶盛机电	887,033.00	2.69
35	600572	康恩贝	870,030.00	2.63
36	601615	明阳智能	862,529.00	2.61
37	600563	法拉电子	862,335.00	2.61
38	688005	容百科技	860,173.53	2.60
39	002410	广联达	859,908.00	2.60
40	600487	亨通光电	835,647.98	2.53
41	600256	广汇能源	824,060.00	2.50
42	002384	东山精密	823,470.00	2.49
43	600380	健康元	817,107.00	2.47
44	600901	江苏租赁	812,495.00	2.46
45	600967	内蒙一机	803,080.00	2.43
46	300168	万达信息	801,536.00	2.43
47	603589	口子窖	797,694.00	2.42
48	601231	环旭电子	795,484.00	2.41
49	000977	浪潮信息	785,962.00	2.38
50	600919	江苏银行	778,736.00	2.36
51	000425	徐工机械	777,799.00	2.36
52	601098	中南传媒	770,707.00	2.33
53	002180	纳思达	769,009.00	2.33
54	002422	科伦药业	768,077.00	2.33
55	600271	航天信息	767,588.00	2.32
56	000685	中山公用	766,388.00	2.32
57	600754	锦江酒店	762,250.00	2.31
58	601828	美凯龙	761,170.00	2.31
59	002019	亿帆医药	760,712.00	2.30
60	000683	远兴能源	755,030.00	2.29
61	000686	东北证券	751,713.00	2.28
62	000598	兴蓉环境	749,261.00	2.27
63	002812	恩捷股份	737,574.00	2.23
64	002081	金螳螂	734,131.00	2.22
65	600649	城投控股	709,497.40	2.15
66	603806	福斯特	707,561.80	2.14
67	000959	首钢股份	692,225.00	2.10
68	600639	浦东金桥	689,717.00	2.09
69	600030	中信证券	685,038.00	2.07
70	000778	新兴铸管	677,762.00	2.05

71	600141	兴发集团	670,134.00	2.03
----	--------	------	------------	------

注：卖出金额均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	122,032,832.97
卖出股票收入（成交）总额	97,841,400.80

注：买入股票成本及卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

### 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

本报告期末本基金未持有债券。

### 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，遵循有效管理原则经充分论证后适度运用股指期货。通过对股票现货和股指期货市场的运行趋势的研究，结合股指期货定价模型，采用估值合理、流动性好、交易活跃的期货合约，对本基金投资组合进行及时、有效地调整和优化，提高投资组合的运作效率。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

根据基金合同对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

#### 7.11.2 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 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山煤国际（600546），其发行主体山煤国际能源集团股份有限公司收到中国证券监督管理委员会山西监管局行政监管措施决定书【2021】8 号、上海证券交易所纪律处分决定书【2022】16 号；本基金投资的盛新锂能（002240），其发行主体盛新锂能集团股份有限公司高管 2021 年 9 月 3 日受到深圳证券交易所公开批评；其发行主体盛新锂能集团股份有限公司 2022 年 6 月 8 日受到深圳证券交易所监管关注—公司部监管函【2022】第 115 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。

### 7.12.2 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。

### 7.12.3 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	21,303.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,373,303.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,394,607.85

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金指数投资中不存在流通受限情况的股票。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金积极投资中不存在流通受限情况的股票。

## § 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
中邮中证 500 指数增强 A	4,106	7,168.06	8,207,479.76	27.89%	21,224,587.50	72.11%
中邮中证 500 指数增强 C	9,214	1,494.19	-	-	13,767,498.01	100.00%
合计	13,320	3,243.21	8,207,479.76	19.00%	34,992,085.51	81.00%

### 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	中邮中证 500 指数增强 A	14,721.72	0.05%
	中邮中证 500 指数增强 C	22.80	0.00%
	合计	14,744.52	0.03%

注：本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 0~10 万份。

### 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	中邮中证 500 指数增强 A	0
	中邮中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开	中邮中证 500 指数增	0

开放式基金	强 A	
	中邮中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中邮中证 500 指数 增强 A	中邮中证 500 指数 增强 C
基金合同生效日（2019 年 12 月 25 日）基 基金份额总额	35,901,078.89	-
本报告期期初基金份额总额	19,682,604.49	2,879,201.98
本报告期基金总申购份额	14,607,032.73	50,706,448.91
减：本报告期基金总赎回份额	4,857,569.96	39,818,152.88
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	29,432,067.26	13,767,498.01

## § 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

本报告期内，无涉及本基金管理人及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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

本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

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况；本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	
银河证券	1	123,345,343.75	56.14%	114,874.13	56.14%	-
中泰证券	1	96,383,081.16	43.86%	89,762.09	43.86%	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

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
银河证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

### 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参加国金证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 1 月 11 日
2	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定媒介	2022 年 1 月 14 日
3	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金参加国融证券股份有限公司费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 1 月 25 日
4	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在上海长量基金销售有限公司开	规定媒介	2022 年 2 月 22 日

	通定投业务并参加其费率优惠活动的公告		
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
6	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
7	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告	规定媒介	2022 年 3 月 11 日
8	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北京雪球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 4 月 15 日
9	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	规定媒介	2022 年 4 月 19 日
10	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金（中邮中证 500 指数增强 C 份额）基金产品资料概要（更新）	规定媒介	2022 年 4 月 20 日
11	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金（中邮中证 500 指数增强 A 份额）基金产品资料概要（更新）	规定媒介	2022 年 4 月 20 日
12	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	规定媒介	2022 年 4 月 20 日
13	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定媒介	2022 年 4 月 22 日
14	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在西部证券股份有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 4 月 25 日
15	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在广发证券股份有限公司开通定	规定媒介	2022 年 4 月 26 日

	投业务并参加其费率优惠活动的公告		
16	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度小满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 5 月 10 日
17	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北京微动利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 5 月 25 日
18	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 5 月 26 日
19	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在申万宏源西部证券有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 5 月 27 日
20	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在万家财富基金销售有限公司开通定投业务并调整其申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 5 月 31 日
21	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金在和讯信息科技有限公司开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2022 年 6 月 20 日
22	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首创证券股份有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2022 年 6 月 22 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	20220530-20220606	-	13,591,238.69	13,591,238.69	-	-
	2	20220301-20220529 20220607-20220614	-	7,233,596.18	-	7,233,596.18	16.74%
个人	1	20220217-20220221	-	7,266,913.74	7,266,913.74	-	-
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中证 500 指数增强型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮中证 500 指数增强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