

# 中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 年 8 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 2023 年 1 月 1 日起至 6 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.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</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.....	58

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 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	61,470,271.01 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	23,162,460.69 份	38,307,810.32 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	010-66596688
	电子邮箱	houyc@postfund.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.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	葛海蛟

## 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(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)	报告期(2023 年 1 月 1 日 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	156,158.84	1,809,078.08
本期利润	332,259.19	3,417,975.62
加权平均基金份额本期利润	0.0144	0.0586
本期加权平均净值利润率	1.19%	4.82%
本期基金份额净值增长率	1.17%	1.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	3,935,945.17	6,677,099.53
期末可供分配基金份额利润	0.1699	0.1743
期末基金资产净值	27,098,405.86	44,984,909.85
期末基金份额净值	1.1699	1.1743
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	18.53%	17.43%

#### 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	-0.30%	0.77%	-0.77%	0.89%	0.47%	-0.12%
过去三个月	-4.74%	0.69%	-5.10%	0.78%	0.36%	-0.09%
过去六个月	1.17%	0.68%	2.20%	0.75%	-1.03%	-0.07%
过去一年	-12.75%	0.89%	-6.65%	0.91%	-6.10%	-0.02%
过去三年	-0.22%	1.18%	2.48%	1.13%	-2.70%	0.05%
自基金合同生效起至今	18.53%	1.26%	15.80%	1.22%	2.73%	0.04%

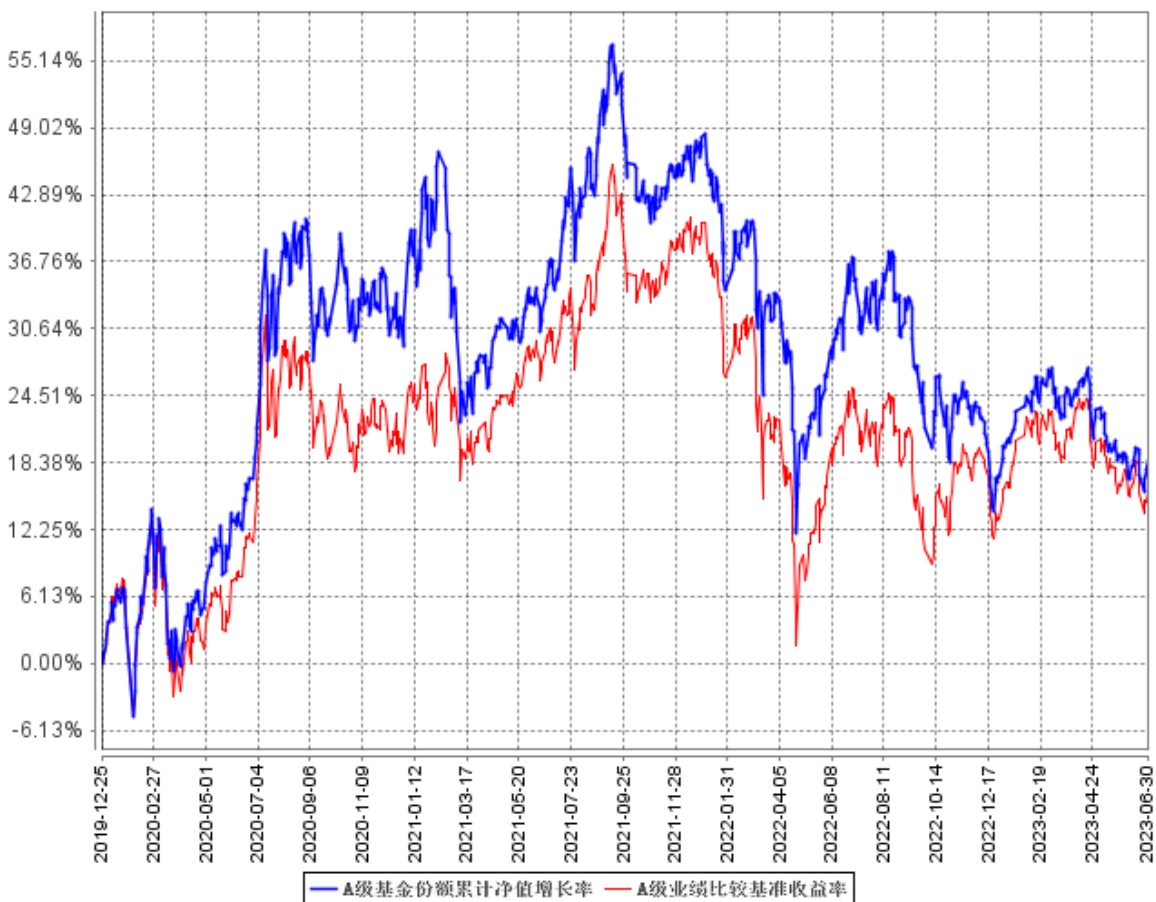
中邮中证 500 指数增强 C

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	-0.31%	0.77%	-0.77%	0.89%	0.46%	-0.12%

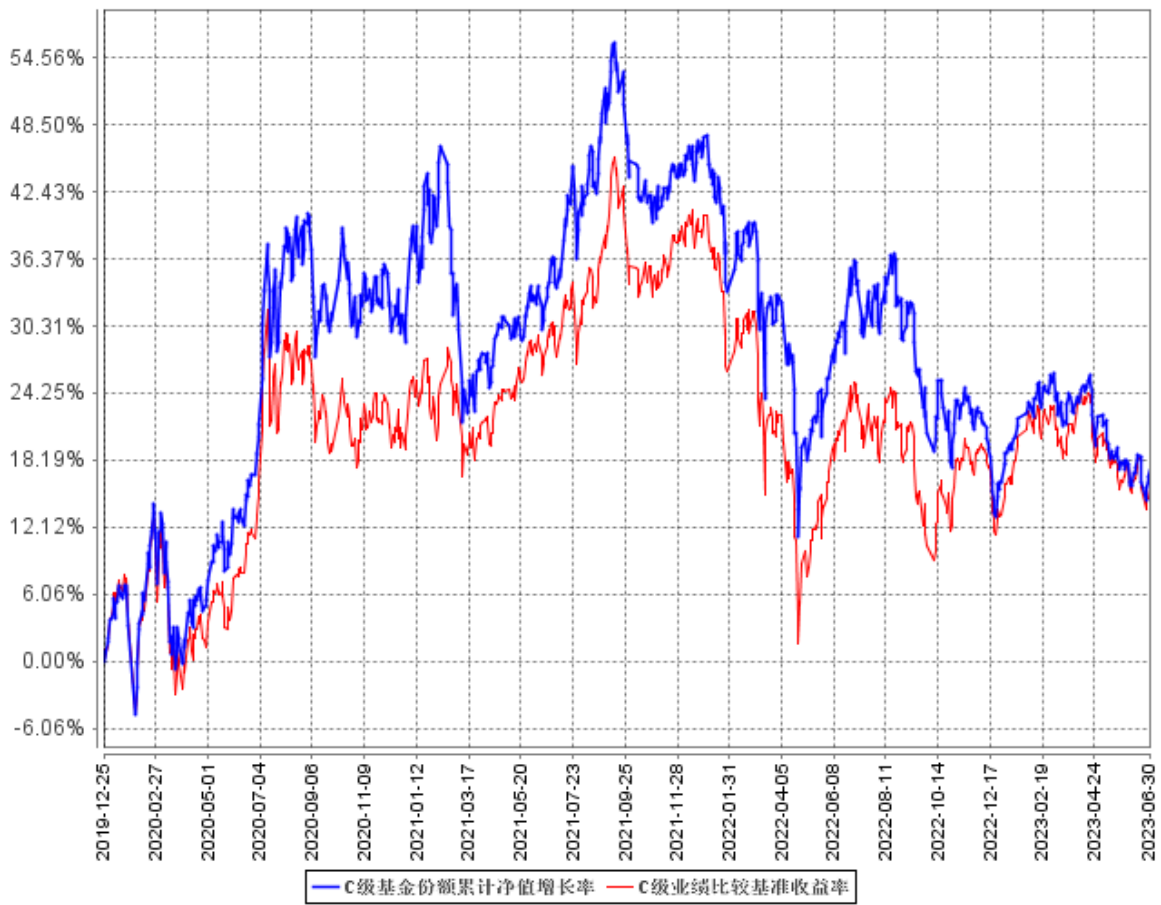
过去三个月	-4.81%	0.69%	-5.10%	0.78%	0.29%	-0.09%
过去六个月	1.02%	0.68%	2.20%	0.75%	-1.18%	-0.07%
过去一年	-13.01%	0.89%	-6.65%	0.91%	-6.36%	-0.02%
过去三年	-1.10%	1.18%	2.48%	1.13%	-3.58%	0.05%
自基金合同生效起至今	17.43%	1.26%	15.80%	1.22%	1.63%	0.04%

### 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 2023 年 6 月 30 日，本公司共管理 56 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、中邮专精特新一年持有期混合型证券投资基金。

#### 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	-	8 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、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。

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。

证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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

今年上半年，A 股整体呈现震荡格局，不同板块行情分化加剧。在人工智能科技浪潮的带动下，相关的算力硬件、模型开发、AI 应用等子板块和个股大幅上涨，成交金额急剧放大，行情火热；受到风险偏好下行及国企改革政策利好的双重影响，以“中特估”为代表的盈利稳定、估值偏低的确定性高的资产受到市场追捧，相关个股出现了“拔估值”的行情；与前两个主题呈现明显对比的是，基金重仓的传统板块如大消费、新能源、医药等行业表现较弱，震荡下行。上半年从风格上来讲，成长风格普遍表现不佳，尤其是大盘成长不断下跌，而估值、低波类风格表现较好，小市值风格表现强劲。

本基金是跟踪中证 500 指数的指数增强型基金，主要应用量化模型进行指数产品的收益增强和风险控制。

上半年，本基金沿用以量化多因子选股为主并以基本面优选作为辅助的投资思路，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 1.1699 元，累计净值为 1.6799 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.17%；截至本报告期末中邮中证 500 指数增强 C 基金份额净值为 1.1743 元，累计净值为 1.1743 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.02%；同期业绩比较基

准收益率为 2.20%。

#### **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，海内外流动性将边际趋于宽松，而国内经济支持政策逐步出台，经济增长及消费预期将迎来一定修复，企业盈利将逐步见底；另一方面当下市场对未来盈利端的预期反应过于悲观，如果基本面好转，A 股将迎来不错的反弹机会。

#### **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**

报告期内本基金持有人数或基金资产净值无预警说明。



## § 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,688,916.35	8,984,220.81
结算备付金		412,708.18	445,639.72
存出保证金		29,456.21	40,355.91
交易性金融资产	6.4.7.2	67,753,023.10	108,423,571.34
其中：股票投资		67,753,023.10	108,423,571.34
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		1,143,551.25	649,937.36
应收股利		-	-
应收申购款		57,183.05	763,557.32
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		74,084,838.14	119,307,282.46
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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		1,023,106.00	1,650,811.83

应付赎回款		228,233.58	424,467.89
应付管理人报酬		35,897.55	56,553.13
应付托管费		11,965.85	18,851.04
应付销售服务费		11,316.98	21,351.19
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	691,002.47	763,109.69
负债合计		2,001,522.43	2,935,144.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	61,470,271.01	100,225,129.17
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	10,613,044.70	16,147,008.52
净资产合计		72,083,315.71	116,372,137.69
负债和净资产总计		74,084,838.14	119,307,282.46

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，中邮中证 500 指数增强 A 基金份额净值 1.1699 元，基金份额总额 23,162,460.69 份；中邮中证 500 指数增强 C 基金份额净值 1.1743 元，基金份额总额 38,307,810.32 份。中邮中证 500 指数增强份额总额合计为 61,470,271.01 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		4,437,555.80	-1,395,157.09
1.利息收入		17,930.00	8,919.82
其中：存款利息收入	6.4.7.13	17,930.00	8,919.82
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）		2,594,288.80	-2,900,273.65
其中：股票投资收益	6.4.7.14	1,832,922.68	-3,444,034.20
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	761,366.12	543,760.55
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	1,784,997.89	1,439,007.09
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	40,339.11	57,189.65
<b>减：二、营业总支出</b>		687,320.99	321,470.73
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	297,019.04	121,732.35
2. 托管费	6.4.10.2.2	99,006.26	40,577.47
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	107,043.10	10,147.43
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	184,252.59	149,013.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		3,750,234.81	-1,716,627.82
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		3,750,234.81	-1,716,627.82
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		3,750,234.81	-1,716,627.82

### 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	100,225,129.17	-	16,147,008.52	116,372,137.69

资产(基金净值)				
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)	100,225,129.17	-	16,147,008.52	116,372,137.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-38,754,858.16	-	-5,533,963.82	-44,288,821.98
(一)、综合收益总额	-	-	3,750,234.81	3,750,234.81
(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)	-38,754,858.16	-	-9,284,198.63	-48,039,056.79
其中: 1.基金申购款	67,659,436.73	-	13,942,470.22	81,601,906.95
2.基金赎回款	-106,414,294.89	-	-23,226,668.85	-129,640,963.74
(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)	61,470,271.01	-	10,613,044.70	72,083,315.71
项目	上年度可比期间 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)	22,561,806.47	-	10,458,598.59	33,020,405.06
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

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。

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）。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份股及其备选成份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》、财政部发布的《资产管理产品相关会计处理规定》、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>》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净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。



## 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

本报告期内本基金无会计政策变更。

### 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。

本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

2. 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。

3. 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。

4. 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。

## 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,688,916.35
等于：本金	4,688,502.79
加：应计利息	413.56
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：	4,688,916.35

**6.4.7.2 交易性金融资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	68,325,347.38	-	67,753,023.10	-572,324.28
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	68,325,347.38	-	67,753,023.10	-572,324.28

**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**

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**

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**

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 2023 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	275,242.28
其中：交易所市场	275,242.28
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	354,343.16
应付指数使用费	50,000.00
其他	11,417.03
合计	691,002.47

**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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	23,149,296.64	23,149,296.64
本期申购	2,013,728.11	2,013,728.11
本期赎回(以“-”号填列)	-2,000,564.06	-2,000,564.06
- 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	23,162,460.69	23,162,460.69

金额单位：人民币元

中邮中证 500 指数增强 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	77,075,832.53	77,075,832.53
本期申购	65,645,708.62	65,645,708.62
本期赎回(以“-”号填列)	-104,413,730.83	-104,413,730.83
- 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	38,307,810.32	38,307,810.32

#### 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	4,512,458.13	-892,063.66	3,620,394.47
本期利润	156,158.84	176,100.35	332,259.19
本期基金份额交易产生的变动数	-9,277.23	-7,431.26	-16,708.49
其中：基金申购款	432,647.56	-13,460.87	419,186.69
基金赎回款	-441,924.79	6,029.61	-435,895.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,659,339.74	-723,394.57	3,935,945.17

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	19,265,538.86	-6,738,924.81	12,526,614.05
本期利润	1,809,078.08	1,608,897.54	3,417,975.62
本期基金份额交易产生的变动数	-11,330,601.63	2,063,111.49	-9,267,490.14
其中：基金申购款	17,022,369.43	-3,499,085.90	13,523,283.53
基金赎回款	-28,352,971.06	5,562,197.39	-22,790,773.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,744,015.31	-3,066,915.78	6,677,099.53

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	11,318.07
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	3,627.35
其他	2,984.58
合计	17,930.00

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	355,728,350.64
减：卖出股票成本总额	352,867,075.70
减：交易费用	1,028,352.26
买卖股票差价收入	1,832,922.68

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	761,366.12
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	761,366.12

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,784,997.89
——股票投资	1,784,997.89
——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	1,784,997.89

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	40,339.11
合计	40,339.11

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	4,909.43
指数使用费	100,000.00
合计	184,252.59

#### 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 2023 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

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，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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	297,019.04	121,732.35
其中：支付销售机构的客户维护费	104,824.95	41,649.63

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：

日基金管理费 = 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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	99,006.26	40,577.47

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		
	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	-	15,473.76	15,473.76

有限公司			
首创证券股份有限公司	-	173.55	173.55
合计	-	15,647.31	15,647.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 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
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 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	1.58%	-

项目	上年度可比期间 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	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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	4,688,916.35	11,318.07	4,742,620.10	6,006.19

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（2023 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。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的债券投资。

### 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 2023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	4,688,502.79	-	-	413.56	4,688,916.35
结算备付金	412,541.14	-	-	167.04	412,708.18
存出保证金	29,444.33	-	-	11.88	29,456.21
交易性金融资产	-	-	-	67,753,023.10	67,753,023.10
应收清算款	-	-	-	1,143,551.25	1,143,551.25
应收申购款	-	-	-	57,183.05	57,183.05
资产总计	5,130,488.26	-	-	68,954,349.88	74,084,838.14
负债					
应付清算款	-	-	-	1,023,106.00	1,023,106.00
应付赎回款	-	-	-	228,233.58	228,233.58
应付管理人报酬	-	-	-	35,897.55	35,897.55
应付托管费	-	-	-	11,965.85	11,965.85
应付销售服务费	-	-	-	11,316.98	11,316.98
其他负债	-	-	-	691,002.47	691,002.47
负债总计	-	-	-	2,001,522.43	2,001,522.43
利率敏感度缺口	5,130,488.26	-	-	66,952,827.45	72,083,315.71
上年度末 2022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	8,983,402.27	-	-	818.54	8,984,220.81
结算备付金	445,439.42	-	-	200.30	445,639.72
存出保证金	40,337.81	-	-	18.10	40,355.91
交易性金融资产	-	-	-	108,423,571.34	108,423,571.34
应收清算款	-	-	-	649,937.36	649,937.36
应收申购款	-	-	-	763,557.32	763,557.32
资产总计	9,469,179.50	-	-	109,838,102.96	119,307,282.46
负债					
应付清算款	-	-	-	1,650,811.83	1,650,811.83
应付赎回款	-	-	-	424,467.89	424,467.89
应付管理人报酬	-	-	-	56,553.13	56,553.13
应付托管费	-	-	-	18,851.04	18,851.04
应付销售服务费	-	-	-	21,351.19	21,351.19
其他负债	-	-	-	763,109.69	763,109.69
负债总计	-	-	-	2,935,144.77	2,935,144.77
利率敏感度缺口	9,469,179.50	-	-	-106,902,958.19	116,372,137.69

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规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 2023 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	67,753,023.10	93.99	108,423,571.34	93.17
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	67,753,023.10	93.99	108,423,571.34	93.17

#### 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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	基金净资产变动	548,209.14	1,026,135.84
	基金净资产变动	-548,209.14	-1,026,135.84



注:我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果;其中,利用 2023 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 0.81。

## 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	67,753,023.10	108,423,571.34
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	67,753,023.10	108,423,571.34

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的金融工具,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关金融工具的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金于本期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### **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，其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	67,753,023.10	91.45
	其中：股票	67,753,023.10	91.45
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	5,101,624.53	6.89
8	其他各项资产	1,230,190.51	1.66
9	合计	74,084,838.14	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	1,939,900.00	2.69
B	采矿业	2,923,270.00	4.06
C	制造业	39,426,980.60	54.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,245,100.00	3.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,565,503.00	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	1,969,150.00	2.73
H	住宿和餐饮业	663,250.00	0.92
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,689,620.00	5.12
J	金融业	3,156,387.50	4.38
K	房地产业	970,200.00	1.35

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	2,322,240.00	3.22
S	综合	-	-
	合计	60,871,601.10	84.45

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	-	-
B	采矿业	1,638,700.00	2.27
C	制造业	4,216,272.00	5.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
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	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,026,450.00	1.42
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	6,881,422.00	9.55

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	002867	周大生	60,000	1,066,800.00	1.48
2	600486	扬农化工	12,000	1,049,040.00	1.46
3	600109	国金证券	120,000	1,040,400.00	1.44
4	002465	海格通信	100,000	1,034,000.00	1.43
5	600066	宇通客车	70,000	1,031,800.00	1.43
6	300146	汤臣倍健	43,000	1,031,140.00	1.43
7	000739	普洛药业	58,000	1,028,920.00	1.43
8	688390	固德威	6,160	1,027,857.60	1.43
9	603688	石英股份	9,000	1,024,560.00	1.42
10	002025	航天电器	16,000	1,020,800.00	1.42
11	000997	新大陆	54,000	1,020,600.00	1.42
12	600968	海油发展	330,000	1,013,100.00	1.41
13	603156	养元饮品	41,000	1,012,700.00	1.40
14	600377	宁沪高速	103,000	1,012,490.00	1.40
15	002422	科伦药业	34,000	1,009,120.00	1.40
16	603737	三棵树	15,400	1,007,468.00	1.40
17	002372	伟星新材	49,000	1,006,460.00	1.40
18	600998	九州通	96,850	1,005,303.00	1.39
19	002850	科达利	7,600	1,005,100.00	1.39
20	002128	电投能源	76,000	1,004,720.00	1.39
21	600161	天坛生物	37,000	1,004,550.00	1.39
22	002600	领益智造	145,000	1,001,950.00	1.39
23	002056	横店东磁	55,000	1,001,550.00	1.39
24	002152	广电运通	85,000	996,200.00	1.38
25	000623	吉林敖东	62,000	994,480.00	1.38
26	600060	海信视像	40,000	990,000.00	1.37
26	002429	兆驰股份	180,000	990,000.00	1.37
27	000027	深圳能源	150,000	988,500.00	1.37
28	600535	天士力	68,000	986,680.00	1.37
29	002384	东山精密	38,000	984,200.00	1.37
30	000998	隆平高科	64,000	982,400.00	1.36
31	603444	吉比特	2,000	982,220.00	1.36
32	688029	南微医学	12,000	978,720.00	1.36

33	000738	航发控制	40,000	976,000.00	1.35
34	002244	滨江集团	110,000	970,200.00	1.35
35	688002	睿创微纳	21,600	967,680.00	1.34
36	002299	圣农发展	50,000	957,500.00	1.33
37	603885	吉祥航空	62,000	956,660.00	1.33
38	600901	江苏金租	231,000	954,030.00	1.32
39	688188	柏楚电子	5,000	942,800.00	1.31
40	002409	雅克科技	12,000	874,560.00	1.21
41	600373	中文传媒	62,000	825,840.00	1.15
42	300285	国瓷材料	30,000	822,000.00	1.14
43	000423	东阿阿胶	15,000	801,750.00	1.11
44	300866	安克创新	9,000	787,500.00	1.09
45	002739	万达电影	60,000	752,400.00	1.04
46	300144	宋城演艺	60,000	744,000.00	1.03
46	002439	启明星辰	25,000	744,000.00	1.03
47	688819	天能股份	20,000	736,800.00	1.02
48	002745	木林森	80,000	736,000.00	1.02
49	002223	鱼跃医疗	20,000	719,800.00	1.00
50	688006	杭可科技	23,000	700,810.00	0.97
51	600642	申能股份	100,000	699,000.00	0.97
52	002563	森马服饰	110,000	684,200.00	0.95
53	600489	中金黄金	65,000	671,450.00	0.93
54	601869	长飞光纤	18,000	666,180.00	0.92
55	600258	首旅酒店	35,000	663,250.00	0.92
56	002568	百润股份	17,300	628,855.00	0.87
57	000060	中金岭南	130,000	617,500.00	0.86
58	601108	财通证券	80,000	579,200.00	0.80
59	002028	思源电气	12,000	560,640.00	0.78
60	603233	大参林	20,000	560,200.00	0.78
61	603338	浙江鼎力	10,000	560,100.00	0.78
62	600167	联美控股	80,000	557,600.00	0.77
63	600282	南钢股份	160,000	539,200.00	0.75
64	002595	豪迈科技	15,000	526,950.00	0.73
65	000960	锡业股份	30,000	466,500.00	0.65
66	601058	赛轮轮胎	40,000	455,600.00	0.63
67	000987	越秀资本	55,000	349,250.00	0.48
68	603225	新凤鸣	30,000	331,500.00	0.46
69	600580	卧龙电驱	21,000	306,810.00	0.43
70	300604	长川科技	6,000	284,940.00	0.40

71	300037	新宙邦	5,000	259,450.00	0.36
72	000975	银泰黄金	20,000	234,000.00	0.32
73	002966	苏州银行	35,650	233,507.50	0.32
74	603866	桃李面包	13,000	131,560.00	0.18

### 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	600761	安徽合力	52,000	1,036,360.00	1.44
2	002434	万里扬	115,000	1,029,250.00	1.43
3	603979	金诚信	32,000	995,200.00	1.38
4	601567	三星医疗	65,000	820,950.00	1.14
5	603605	珀莱雅	6,320	710,368.00	0.99
6	600583	海油工程	110,000	643,500.00	0.89
7	002555	三七互娱	18,000	627,840.00	0.87
8	000063	中兴通讯	13,600	619,344.00	0.86
9	600570	恒生电子	9,000	398,610.00	0.55

### 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	603939	益丰药房	4,120,092.00	3.54
2	300777	中简科技	3,425,697.00	2.94
3	300888	稳健医疗	3,253,522.00	2.80
4	002372	伟星新材	3,120,422.00	2.68
5	603225	新凤鸣	3,093,724.00	2.66
6	603688	石英股份	2,936,923.00	2.52
7	002299	圣农发展	2,859,245.96	2.46
8	000738	航发控制	2,858,902.00	2.46
9	600350	山东高速	2,847,324.00	2.45
10	601137	博威合金	2,776,814.00	2.39
11	300146	汤臣倍健	2,736,880.28	2.35
12	600377	宁沪高速	2,674,815.00	2.30

13	002152	广电运通	2,645,946.00	2.27
14	601869	长飞光纤	2,627,054.00	2.26
15	002738	中矿资源	2,618,992.81	2.25
16	601138	工业富联	2,568,175.00	2.21
17	000807	云铝股份	2,530,505.00	2.17
18	688188	柏楚电子	2,340,790.00	2.01
19	603345	安井食品	2,336,982.00	2.01
20	600315	上海家化	2,325,408.00	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	000807	云铝股份	4,441,854.00	3.82
2	002738	中矿资源	4,111,421.00	3.53
3	603939	益丰药房	3,865,706.00	3.32
4	002158	汉钟精机	3,598,912.99	3.09
5	601138	工业富联	3,400,065.00	2.92
6	603056	德邦股份	3,335,577.00	2.87
7	600985	淮北矿业	3,252,234.00	2.79
8	300777	中简科技	3,230,080.00	2.78
9	300888	稳健医疗	3,158,160.10	2.71
10	600566	济川药业	3,026,023.00	2.60
11	601699	潞安环能	2,916,881.00	2.51
12	601958	金钼股份	2,902,450.00	2.49
13	300724	捷佳伟创	2,883,656.00	2.48
14	001914	招商积余	2,874,533.00	2.47
15	600350	山东高速	2,870,169.12	2.47
16	688777	中控技术	2,869,163.11	2.47
17	600895	张江高科	2,835,566.84	2.44
18	000999	华润三九	2,823,394.00	2.43
19	601098	中南传媒	2,784,890.00	2.39
20	600195	中牧股份	2,772,850.00	2.38
21	603596	伯特利	2,765,634.19	2.38
22	000400	许继电气	2,700,902.76	2.32
23	000728	国元证券	2,676,997.10	2.30
24	002281	光迅科技	2,661,568.12	2.29



25	002409	雅克科技	2,657,641.00	2.28
26	600563	法拉电子	2,641,159.00	2.27
27	600039	四川路桥	2,609,654.00	2.24
28	603127	昭衍新药	2,584,129.00	2.22
29	601137	博威合金	2,541,701.00	2.18
30	603225	新凤鸣	2,487,529.00	2.14
31	603233	大参林	2,460,945.00	2.11
32	600377	宁沪高速	2,379,347.00	2.04
33	000729	燕京啤酒	2,369,012.00	2.04

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	310,411,529.57
卖出股票收入（成交）总额	355,728,350.64

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。

### 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	29,456.21
2	应收清算款	1,143,551.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	57,183.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,230,190.51

### 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	3,743	6,188.21	975,672.50	4.21%	22,186,788.19	95.79%
中邮中证 500 指数增强 C	14,460	2,649.23	-	-	38,307,810.32	100.00%
合计	18,203	3,376.93	975,672.50	1.59%	60,494,598.51	98.41%

### 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	29,109.82	0.13%
	中邮中证 500 指数增强 C	96,888.45	0.25%
	合计	125,998.27	0.21%

注：本公司从业人员持有本基金份额总量的数量区间为 10~50 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	23,149,296.64	77,075,832.53
本报告期基金总申购份额	2,013,728.11	65,645,708.62
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,564.06	104,413,730.83
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	23,162,460.69	38,307,810.32

## § 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期管理人及其高级管理人员无受到稽查或处罚情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，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	
中泰证券	1	346,061,515.10	51.97%	322,288.24	51.97%	-
天风证券	1	216,242,417.33	32.47%	201,384.34	32.47%	-
银河证券	1	103,631,457.58	15.56%	96,514.87	15.56%	-
东吴证券	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
中泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-

### 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	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	规定媒介	2023 年 1 月 20 日
2	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南京证券股份有限公司申购及定投起点金额的公告	规定媒介	2023 年 2 月 1 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泛华普益基金销售有限公司为代销机构及开通相关业务	规定媒介	2023 年 2 月 6 日



	的公告		
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博时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	2023 年 2 月 6 日
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创金启富基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023 年 2 月 21 日
6	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中欧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	2023 年 3 月 23 日
7	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加兴业银行股份有限公司银银平台为代销机构及开通相关业务的公告	规定媒介	2023 年 3 月 29 日
8	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2022 年年度报告	规定媒介	2023 年 3 月 30 日
9	中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	规定媒介	2023 年 4 月 22 日
10	中邮创业基金管理股份有限公司关于在直销中心开通基金转换业务及参加转换补差费率优惠活动的公告	规定媒介	2023 年 6 月 20 日
11	中邮创业基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023 年 6 月 30 日
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陆亨基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告	规定媒介	2023 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	20230209-20230319	-	21,022,536.16	21,022,536.16	-	-
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

2023 年 8 月 31 日