

# 中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 28 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金管理人-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。本半年度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 2018 年 08 月 27 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新。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自 2018 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.....	9
2.4 信息披露方式.....	10
2.5 其他相关资料.....	10
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>11</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	11
3.2 基金净值表现.....	11
<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.....	15
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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、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 所有者权益（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注.....	21
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
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.....	50
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.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
<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>60</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.....	60

11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金
基金简称	中邮上证 380 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	2011 年 11 月 22 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	77,761,686.94 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%，年化跟踪误差不得超过 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，以上证 380 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数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”的投资策略。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基金资</p>

产的比例不低于 80%，其余基金资产可适当投资于债券、权证、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)。

## 2. 股票投资策略

本基金被动投资组合采用完全复制的方法进行组合构建，按照成分股在上证 380 指数成分股权重分散化投资于上证 380 指数成分股；主动投资组合构建主要依据对上市公司宏观和微观的深入研究，优先在上证 380 指数成分股中对行业、个股进行适度超配或者低配；同时，在公司股票池的基础上，根据研究员的研究成果，谨慎地挑选上证 380 指数成分股以外的股票作为增强股票库，进入基金股票池，构建主动型投资组合。

### (1) 构建被动投资组合

本基金采用完全复制基准指数的方法，按照个股在基准指数中的权重构建指数化股票投资组合，并根据基准指数成分股及其权重的变动而进行相应调整。当遇到基准指数成分股调整或停牌、流动性不足等其他市场因素而无法根据指数权重配置某成分股时，本基金将首选与该成分股行业属性一致、相关性高的其他成分股进行替代；若成分股中缺乏符合要求的替代品种，本基金将在成分股之外选择行业属性一致、相关性高且基本面优良的替代品种。

### (2) 构建增强型投资组合

本基金以指数化分散投资为主，基于中国证券市场作为一个新兴市场并非完全有效及指数编制本身的局限性，在严格控制跟踪误差的前提下，辅以适度的增强型主动管理；其目的有二，一是为了在跟踪目标指数的基础上适度获取超额收益；二是补偿较高的交易成本及其他费用。增强投资的方法包括：

#### 1) 仓位调整

在能够明确判断市场将经历一段长期下跌过程时，基金的股票投资仓位可进行下调，股票资产最低可下调到占基金资产净值的 90%以适度规避市场系统性风险。

#### 2) 基本面优化

基本面优化提高具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

- 上市公司基本面较好(根据财务指标等判断)，具有鲜明的竞争优势，有持续增长能力。
- 中长期估值水平明显高于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏低。
- 其他特殊个股，例如预期将纳入指数的个股。

●包括一级市场新股在内的具有重大投资机会的非成分股。

将降低具备以下一项或多项特征股票的投资权重：

●基本面较差，缺乏核心竞争力，经营业绩下滑。

●中长期估值水平明显低于目前估值水平，在同行业中，股票相对估值偏高。

●短期内股价涨幅过高，预期短期内股价将大幅回调。

●其他特殊个股，例如预期将从指数中剔除的个股等。

### 3) 个股优选

本基金将依托于本公司投研团队的研究成果，精选成分股之外的股票作为增强股票库，在合适的时机选择增强股票库中估值合理、成长明确的品种进行适量优化配置，获取超额收益。另外，本基金也可以适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发）。

### 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

本基金所构建的指数化投资组合将根据所跟踪的上证 380 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。

#### (2) 不定期调整



	<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>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>
业绩比较基准	<p>本基金业绩比较基准为：上证 380 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。</p> <p>上证 380 指数是上海证券交易所和中证指数有限公司于 2010 年 11 月 29 日新推出的代表上交所中小市值成长性新兴蓝筹股指数，以反映传统蓝筹股之外的一批规模适中、成长性好、盈利能力强的上市公司股票的整体表现。该指数在确定样本空间时，剔除上证 180 指数样本股外，还剔除了上市时间不足一个季度的股票、暂停上市的股票、经营状况异常或最近财务报告严重亏损的股票、股价波动较大市场表现明显受到操作的股票，以及成立 5 年以上且最近五年未派发现金红利或送股的公司，然后按照营业收入增长率、净资产收益率、成交金额和总市值的综合排名，根据行业配比原则确定各二级行业内上市公司家数，选择排名前 380 名的公司作为上证 380 指数样本股。上证 380 指数以 2003 年 12 月 31 日为基日，基点为 1000 点；指数样本每半年定期调整一次，实施时间分别为每年的 1 月和 7 月的第一个交易日。在两次定期调整之间，若上证 380 指数样本股进入上证 180 指数，该样本立即被调出上证 380 指数，并由该调出样本同行业排名最靠前的样本补足。</p> <p>随着市场环境的变化，如果上述业绩比较基准不适用本基金时(如基金变更投资比例范围，或原指数供应商变更或停止原指数的编制及发布，或今后法律法规发生变化，又或市场推出代表性更强、投资者认同度更高且更能够表征本基金风险收益特征的指数等)，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则，根据实际情况对业绩比较基准进行相应调整。调整业绩比较基准应经基金托管人同意，报中国证监会备案，基金管理人应在调整前 3 个工作日在中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。</p>
风险收益特征	<p>本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。</p>

### 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	王永民
	联系电话	010-82295160—157	010-66594896
	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		曹均	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.postfund.com.cn">http://www.postfund.com.cn</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所。

### 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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	2,055,108.30
本期利润	-11,271,607.44
加权平均基金份额本期利润	-0.1444
本期加权平均净值利润率	-13.35%
本期基金份额净值增长率	-13.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	-1,617,032.27
期末可供分配基金份额利润	-0.0208
期末基金资产净值	76,144,654.67
期末基金份额净值	0.979
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	45.70%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。3. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当前发生额）。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

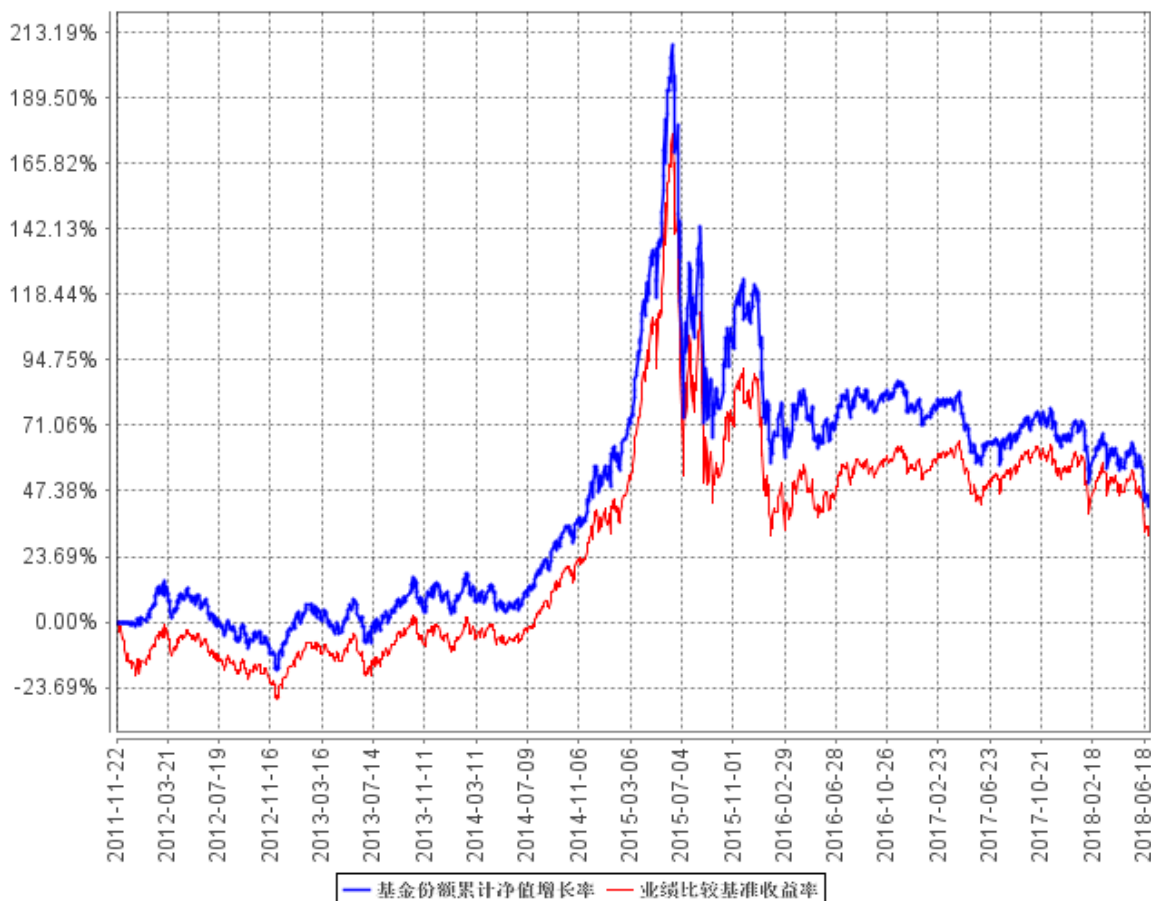
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.08%	1.70%	-9.61%	1.71%	1.53%	-0.01%
过去三个月	-10.02%	1.29%	-11.60%	1.29%	1.58%	0.00%
过去六个月	-13.06%	1.34%	-13.74%	1.37%	0.68%	-0.03%
过去一年	-11.72%	1.15%	-11.62%	1.14%	-0.10%	0.01%
过去三年	-40.53%	1.81%	-38.18%	1.86%	-2.35%	-0.05%
自基金合同生效起至今	45.70%	1.60%	34.58%	1.65%	11.12%	-0.05%

注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

本基金业绩比较基准为：上证 380 指数收益率×95% +银行活期存款利率(税后)×5%。

### 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

基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自合同生效日起 3 个月内为建仓期，报告期内本基金的各项投资比例符合基金合同的有关规定。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金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 2018 年 6 月 30 日，本公司共管理 38 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、中邮上证 380 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、中邮双动力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、中邮尊享一年定期开放灵活配置混合型发起式证券投资基金、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、中邮增力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、中邮稳健合赢债券型证券投资基金、中邮纯债恒利债券型证券投资基金、中邮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、中邮安泰双核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		
俞科进	基金经理	2015 年 6 月 3 日	-	9 年	经济学硕士，曾任安徽省池州市殷汇中学教师、中国人保寿险有限公司职员、长江证券股份有限公司金融工程分析师、中邮

					创业基金管理股份有限公司金融工程研究员、中邮核心竞争力灵活配置混合型基金基金经理助理、量化投资部员工，现任中邮创业基金管理股份有限公司投资部员工兼中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金经理、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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守了公平交易管理制度的规定，各基金在研究、投资、交易等各方面受到公平对待，确保各基金获得公平交易的机会。

报告期内，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规定的要求；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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金在报告期内未出现异常交易行为。

报告期内，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%。

#### 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

2018 年一季度各项数据显示经济基本面仍处于乏善可陈的阶段，受资源品价格波动的影响，周期类行业在延续前期趋势之后经历了一波较大幅度的调整，同时以老板电器为代表的部分白马股低于预期对市场的冲击较大，上证 50 为代表的蓝筹价值股开始受到市场怀疑，部分配置资金选择离场，而成长股经过前期充分调整开始具备较为合理的风险收益比，以创业板 50 为代表的绩优成长股受到市场追捧，部分投资者开始均衡配置。进入二季度，结构性去杠杆仍在推进，内有资管新规颁布外有中美贸易战的影响，市场对流动性改善存有预期，一季报及上一年年报披露完毕，蓝筹及部分白马股业绩低于预期使得价值板块的风险收益比有所下降，而成长板块良好的业绩预期及前期的持续下跌使其具备了相对较好的风险收益比，成长板块在二季度初继续呈相对优势。随着各项经济数据陆续公布及内外市场环境的变化，包括 CDR 发行及独角兽概念股上市预期，投资者风险偏好再有下行趋势，市场呈持续下跌趋势，价值股和成长股普跌。

本基金在做好常规跟踪复制之外，着重利用数量化策略进行增强投资。报告期内行业配置层面参照指数基准并结合量化模型对行业配置进行了权重调整，适当增加了低估值板块权重；选股方面，以业绩成长性指标结合交易性指标筛选股票组合，由于一季度以来各行业内部分化严重，大多行业仅行业内龙头股上涨，而本基金基准指数成分股大多非行业龙头，另外一季度以来成长股继续呈相对劣势状态，因而在行业配置基本吻合市场的情况下也未能获取超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2018 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.979 元，累计净值 1.489 元。份额净值增长率为-13.06%，业绩比较基准增长率为-13.74%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018 年下半年中美贸易战将继续对市场风险偏好形成重要影响且会长期持续，需要及时关注美国中期选举和通胀变化；国内三季度经济下行压力较大，政策趋向稳增长或使四季度经济企稳，下半年 PPI 同比回落带动名义 GDP 下行，全年通胀压力缓释；政策上的边际变化可能对市场形成一定的扰动，除非有较为明显的政策转向，整体市场的趋势性投资机会很难出现，但不排除因为信用风险降低或利率下行过程中出现结构性投资机会，特别是以中盘蓝筹为代表的板块已经具备相对较好的风险收益特征。

#### **4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金公司成立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”）在对中邮上证 380 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 托管人对本半年度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”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：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,545,430.25	6,397,884.91
结算备付金		4,206.19	12,750.30
存出保证金		4,035.41	55,499.50
交易性金融资产	6.4.7.2	69,086,139.22	82,958,486.83
其中：股票投资		69,086,139.22	82,958,486.83
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,329.13	1,392.07
应收股利		-	-
应收申购款		33,848.10	28,702.04
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		76,674,988.30	89,454,715.65
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2017 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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		155,489.61	83,098.49
应付管理人报酬		65,402.74	75,455.88
应付托管费		13,080.57	15,091.18
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	10,368.27	15,168.73
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	285,992.44	346,612.60
负债合计		530,333.63	535,426.88
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	77,761,686.94	78,995,628.04
未分配利润	6.4.7.10	-1,617,032.27	9,923,660.73
所有者权益合计		76,144,654.67	88,919,288.77
负债和所有者权益总计		76,674,988.30	89,454,715.65

注：报告截至日 2018 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.979 元，基金份额总额 77,761,686.94 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		-10,559,758.76	11,355,531.81
1.利息收入		27,727.57	1,824,697.39
其中：存款利息收入	6.4.7.11	27,727.57	1,590,904.34
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		-	233,793.05
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,734,322.52	-735,317.05
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,949,513.03	-2,574,467.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	784,809.49	1,839,150.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-13,326,715.74	7,015,944.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,906.89	3,250,207.01

<b>减：二、费用</b>		711,848.68	8,610,703.80
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	417,826.41	2,685,584.24
2. 托管费	6.4.10.2.2	83,565.28	537,116.86
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	49,334.82	5,210,019.41
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	161,122.17	177,983.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-11,271,607.44	2,744,828.01
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-11,271,607.44	2,744,828.01

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中邮上证 380 指数增强型证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	78,995,628.04	9,923,660.73	88,919,288.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,271,607.44	-11,271,607.44
三、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）	-1,233,941.10	-269,085.56	-1,503,026.66
其中：1.基金申购款	5,779,748.97	429,198.02	6,208,946.99
2.基金赎回款	-7,013,690.07	-698,283.58	-7,711,973.65
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益	77,761,686.94	-1,617,032.27	76,144,654.67

项目	上年度可比期间		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
(基金净值)			
一、期初所有者权益 (基金净值)	69,362,668.12	46,358,595.57	115,721,263.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,744,828.01	2,744,828.01
三、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)	3,731,362,086.12	3,092,741,486.48	6,824,103,572.60
其中：1.基金申购款	6,070,916,299.59	3,355,925,627.87	9,426,841,927.46
2.基金赎回款	-2,339,554,213.47	-263,184,141.39	-2,602,738,354.86
四、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)	-	-2,729,336,771.90	-2,729,336,771.90
五、期末所有者权益 (基金净值)	3,800,724,754.24	412,508,138.16	4,213,232,892.40

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：

曹均                                      曹均                                      吕伟卓  
 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

中邮上证 380 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2011]1261 号《关于核准中邮上证 380 指数增强型证券投资基金募集的批复》核准，由中邮创业基金管理股份有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》等有关规定和《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》发起，并于 2011 年 11 月 22 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集包括认购资金利息共募集 456,870,635.87 元，业经京都天华会计师事务所有限公司京都天华验字（2011）第 0203 号验资报告予以验证。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《中邮上证 380 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、债券、权证、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。在正常市场情况下，本基金投资组合中各类资产占基金净值的目标比例为：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基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；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”）和中国证券业协会 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会 2010 年 2 月 8 日颁布的证监会公告[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[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；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. 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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 2018年6月30日
活期存款	7,545,430.25
定期存款	-
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	-
合计：	7,545,430.25

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	79,914,772.35	69,086,139.22	-10,828,633.13
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	79,914,772.35	69,086,139.22	-10,828,633.13

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 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 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应收活期存款利息	1,325.80
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1.71
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	1.62
合计	1,329.13

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本期末未持有其他资产。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	10,368.27
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,368.27

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	69.85
预提费用	224,505.56

应付指数使用费	50,000.00
其他	11,417.03
合计	285,992.44

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	78,995,628.04	78,995,628.04
本期申购	5,779,748.97	5,779,748.97
本期赎回(以“-”号填列)	-7,013,690.07	-7,013,690.07
- 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	77,761,686.94	77,761,686.94

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,255,711.85	2,667,948.88	9,923,660.73
本期利润	2,055,108.30	-13,326,715.74	-11,271,607.44
本期基金份额交易产生的变动数	-133,398.12	-135,687.44	-269,085.56
其中：基金申购款	668,495.86	-239,297.84	429,198.02
基金赎回款	-801,893.98	103,610.40	-698,283.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,177,422.03	-10,794,454.30	-1,617,032.27

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
	活期存款利息收入
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	243.94
其他	3,661.25
合计	27,727.57

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	17,080,052.60
减：卖出股票成本总额	15,130,539.57
买卖股票差价收入	1,949,513.03

#### 6.4.7.13 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资。

##### 6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期内本基金无贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	784,809.49
基金投资产生的股利收益	-
合计	784,809.49

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-13,326,715.74
——股票投资	-13,326,715.74
——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	-13,326,715.74

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	4,906.89
合计	4,906.89

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	49,334.82
银行间市场交易费用	-
合计	49,334.82

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费	19,833.98

银行费用	1,616.61
指数使用费	100,000.00
合计	161,122.17

## 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

截至 2018 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
首创证券有限责任公司	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

本报告期内及上年度可比期间，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
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	417,826.41	2,685,584.24
其中：支付销售机构的客户维护费	88,017.22	222,057.92

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的

1.0%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×1.0% / 当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	83,565.28	537,116.86

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的 0.2% 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×0.2% / 当年天数

#### 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 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日
基金合同生效日（ 2011 年 11 月 22 日）持有的 基金份额	4,999,400.00	4,999,400.00
期初持有的基金份额	973,172.50	973,172.50
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	973,172.50	973,172.50
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.25%	0.03%

##### 6.4.10.4.2 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。

**6.4.10.5 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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	7,545,430.25	23,822.38	409,232,367.63	1,430,664.18

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。

**6.4.10.6 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。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本报告期内本基金无其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期内本基金未实施利润分配。

**6.4.12 期末（2018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新发/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**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002739	万达电影	2017年7月4日	重大事项	38.03	-	-	12,000	627,131.50	456,360.00	-
603939	益丰药房	2018年4月17日	重大事项	53.07	2018年7月16日	65.69	6,000	307,400.98	318,420.00	-
600490	鹏欣资源	2018年4月16日	重大事项	7.10	-	-	41,500	394,150.00	294,650.00	-

600122	宏图高科	2018年 6月 19日	重大 事项	6.89	-	-	35,835	395,497.47	246,903.15	-
600750	江中药业	2018年 5月 2日	重大 事项	17.57	2018年 8月 1日	16.12	9,100	226,567.06	159,887.00	-
600811	东方集团	2018年 5月 30日	重大 事项	3.76	-	-	41,560	215,247.89	156,265.60	-
600226	瀚叶股份	2017年 11月 28日	重大 事项	4.06	-	-	35,253	175,993.86	143,127.18	-
600175	美都能源	2018年 5月 30日	重大 事项	3.47	2018年 8月 17日	3.74	40,300	194,214.00	139,841.00	-
600399	*ST抚钢	2018年 1月 31日	重大 事项	4.36	-	-	32,000	203,398.45	139,520.00	-
600641	万业企业	2018年 4月 17日	重大 事项	10.42	2018年 8月 9日	10.96	13,200	167,092.74	137,544.00	-
600687	刚泰控股	2018年 6月 11日	重大 事项	7.93	2018年 8月 20日	8.18	13,500	179,483.71	107,055.00	-
600335	国机汽车	2018年 4月 3日	重大 事项	9.06	-	-	10,824	132,921.54	98,065.44	-
600850	华东电脑	2018年 5月 14日	重大 事项	16.00	2018年 8月 15日	18.00	4,800	97,576.93	76,800.00	-
600086	东方金钰	2018年 1月 19日	重大 事项	7.27	-	-	9,881	106,279.94	71,834.87	-



603997	继峰股份	2018年5月30日	重大事项	10.04	-	-	6,400	78,026.00	64,256.00	-
--------	------	------------	------	-------	---	---	-------	-----------	-----------	---

注：根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》（中国证券监督管理委员会公告【2017】13号）等有关规定，对上述股票估值方法进行调整（详见基金管理人中邮创业基金管理股份有限公司相关公告）。

### 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。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

#### （1）风险管理政策

本基金管理人根据中国证监会的要求，建立了科学合理层次分明的内控组织架构、控制程序、控制措施和控制职责。

本基金管理人已建立了一套较为完整的决策流程和业务操作流程，每个员工各司其责，监察稽核部定期对各部门、各业务流程进行监察稽核，充分保证了各项管理制度和业务流程的有效执行。

#### （2）风险管理组织架构

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、相关职能部门和业务部门构成的风险管理架构体系。

公司上述风险管理职能部门运转正常，充分发挥各自的职能，不断揭示并化解各类风险。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险指基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，而且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的困难而导致损失的风险。本基金的流动性风险来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。本基金所持大部分股票均是交易相对活跃的大盘股，变现能力较强。

本基金管理人设专人通过独立的检测系统对流动性指标进行监测和分析，并进行动态调整，充分保证本基金有充足的现金流。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金在运作过程中未发生过流动性风险情况，公司建立了防范流动性风险的有效机制。公司每日跟踪监测本基金持有股票资产的交易量、持仓集中度、流通受限股票占比、可流通股票变现天数、7 日可变现资产比例等涉及资产流动性风险的指标，设置合理有效的风控阈值；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

市场风险是指金融工具或证券的价值对市场参数变化的敏感性，是基金资产运作中所不可避免地承受因市场任何波动而产生的风险。本基金管理人已建立了一套较完整的系统性风险预警和监控系统，利用设定系统参数对市场风险进行度量和监控。主要通过调整 VaR 的最高和最低限以及日常 VaR 的值，实现对市场风险的控制和管理。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 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	7,545,430.25	-	-	-	7,545,430.25
结算备付金	4,206.19	-	-	-	4,206.19
存出保证金	4,035.41	-	-	-	4,035.41
交易性金融资产	-	-	-	69,086,139.22	69,086,139.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,329.13	1,329.13
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	33,848.10	33,848.10
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,553,671.85	-	-	69,121,316.45	76,674,988.30
负债					
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	155,489.61	155,489.61
应付管理人报酬	-	-	-	65,402.74	65,402.74
应付托管费	-	-	-	13,080.57	13,080.57
应付交易费用	-	-	-	10,368.27	10,368.27
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	285,992.44	285,992.44
负债总计	-	-	-	530,333.63	530,333.63
利率敏感度缺口	7,553,671.85	-	-	-68,590,982.82	76,144,654.67
上年度末 2017 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	6,397,884.91	-	-	-	6,397,884.91
结算备付金	12,750.30	-	-	-	12,750.30
存出保证金	55,499.50	-	-	-	55,499.50
交易性金融资产	-	-	-	82,958,486.83	82,958,486.83
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	1,392.07	1,392.07

应收股利	-	-	-	-
应收申购款	-	-	28,702.04	28,702.04
其他资产	-	-	-	-
资产总计	6,466,134.71	-	-82,988,580.94	89,454,715.65
负债	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	83,098.49	83,098.49
应付管理人报酬	-	-	75,455.88	75,455.88
应付托管费	-	-	15,091.18	15,091.18
应付交易费用	-	-	15,168.73	15,168.73
应交税费	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-
其他负债	-	-	346,612.60	346,612.60
负债总计	-	-	535,426.88	535,426.88
利率敏感度缺口	6,466,134.71	-	-82,453,154.06	88,919,288.77

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券投资，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（包括中小板和创业板，及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、权证、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基金资产的比例不低于 80%；现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%；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 2018 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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	69,086,139.22	90.73	82,958,486.83	93.30
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	69,086,139.22	90.73	82,958,486.83	93.30

## 6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 固定其它市场变量，当本基金基准上涨 1%		
	2. 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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	1. 基金净资产变动	662,377.40	864,259.58
	2. 基金净资产变动	-662,377.40	-864,259.58

注：我们利用 CAPM 模型计算得到上述结果；其中，无风险收益率取 2018 年 6 月 29 日十年期国债收益率 3.52%，利用 2018 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 0.96。

## 6.4.14 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	69,086,139.22	90.10
	其中：股票	69,086,139.22	90.10
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	7,549,636.44	9.85
8	其他各项资产	39,212.64	0.05
9	合计	76,674,988.30	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 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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	474,750.00	0.62
B	采矿业	3,117,530.32	4.09
C	制造业	39,847,360.36	52.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,311,810.61	4.35
E	建筑业	1,303,854.47	1.71
F	批发和零售业	4,206,260.08	5.52
G	交通运输、仓储和邮政业	3,593,721.74	4.72
H	住宿和餐饮业	360,695.28	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	918,091.71	1.21
J	金融业	38,324.00	0.05
K	房地产业	2,466,231.80	3.24
L	租赁和商务服务业	386,945.00	0.51

M	科学研究和技术服务业	122,027.80	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	508,655.00	0.67
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	121,350.00	0.16
Q	卫生和社会工作	322,779.44	0.42
R	文化、体育和娱乐业	676,609.51	0.89
S	综合	238,615.00	0.31
	合计	62,015,612.12	81.44

注：由于四舍五入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 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	采掘业	36,408.00	0.05
C	制造业	5,231,564.41	6.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	56,997.00	0.07
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	69,192.50	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	57,114.08	0.08
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	763,115.96	1.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	33,558.15	0.04
L	租赁和商务服务业	38,493.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	33,459.00	0.04
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	750,625.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	7,070,527.10	9.29

注：由于四舍五入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	600673	东阳光科	169,000	1,745,770.00	2.29
2	603288	海天味业	22,353	1,646,074.92	2.16
3	600487	亨通光电	54,040	1,191,582.00	1.56
4	600352	浙江龙盛	76,700	916,565.00	1.20
5	600176	中国巨石	87,000	890,010.00	1.17
6	603019	中科曙光	18,578	852,172.86	1.12
7	600398	海澜之家	62,100	791,154.00	1.04
8	600779	水井坊	14,000	773,220.00	1.02
9	600521	华海药业	25,769	687,774.61	0.90
10	600426	华鲁恒升	38,490	677,039.10	0.89
11	601233	桐昆股份	38,430	661,764.60	0.87
12	600674	川投能源	75,000	654,000.00	0.86
13	600201	生物股份	38,156	652,086.04	0.86
14	600584	长电科技	38,352	649,682.88	0.85
15	600239	云南城投	130,950	587,965.50	0.77
16	600346	恒力股份	39,500	579,070.00	0.76
17	600004	白云机场	43,906	574,729.54	0.75
18	600872	中炬高新	20,459	572,852.00	0.75
19	600498	烽火通信	23,000	571,550.00	0.75
20	600525	长园集团	53,900	569,723.00	0.75
21	600885	宏发股份	17,500	523,600.00	0.69
22	600879	航天电子	69,617	489,407.51	0.64
23	600566	济川药业	9,600	462,624.00	0.61
24	600642	申能股份	91,150	457,573.00	0.60
25	600600	青岛啤酒	10,173	445,882.59	0.59
26	600188	兖州煤业	33,964	442,890.56	0.58
27	600027	华电国际	109,100	427,672.00	0.56
28	603833	欧派家居	3,200	408,096.00	0.54
29	600583	海油工程	76,900	404,494.00	0.53
30	600975	新五丰	100,000	399,000.00	0.52
31	600183	生益科技	43,355	397,131.80	0.52
32	600388	龙净环保	30,300	387,234.00	0.51
33	600755	厦门国贸	51,000	371,790.00	0.49



34	600567	山鹰纸业	95,900	370,174.00	0.49
35	600062	华润双鹤	14,884	365,402.20	0.48
36	600325	华发股份	47,100	364,083.00	0.48
37	600486	扬农化工	6,420	359,070.60	0.47
38	603899	晨光文具	11,200	354,928.00	0.47
39	600056	中国医药	19,338	353,305.26	0.46
40	600460	士兰微	28,500	347,700.00	0.46
41	600418	江淮汽车	52,500	341,775.00	0.45
42	601799	星宇股份	5,700	341,373.00	0.45
43	600711	盛屯矿业	37,500	338,625.00	0.44
44	600967	内蒙一机	26,430	336,718.20	0.44
45	601877	正泰电器	14,995	334,688.40	0.44
46	600038	中直股份	8,300	331,917.00	0.44
47	600348	阳泉煤业	45,900	328,185.00	0.43
48	600763	通策医疗	6,632	322,779.44	0.42
49	603939	益丰药房	6,000	318,420.00	0.42
50	603883	老百姓	3,800	316,008.00	0.42
51	601098	中南传媒	24,500	309,680.00	0.41
52	600409	三友化工	35,100	302,211.00	0.40
53	600143	金发科技	57,833	301,888.26	0.40
54	600490	鹏欣资源	41,500	294,650.00	0.39
55	603369	今世缘	12,900	294,507.00	0.39
56	600823	世茂股份	70,020	292,683.60	0.38
57	600970	中材国际	43,500	290,580.00	0.38
58	603885	吉祥航空	18,490	284,930.90	0.37
59	603588	高能环境	30,000	281,400.00	0.37
60	603658	安图生物	3,400	280,364.00	0.37
61	600240	华业资本	38,200	280,006.00	0.37
62	600161	天坛生物	14,430	279,220.50	0.37
63	600729	重庆百货	8,400	276,780.00	0.36
64	601021	春秋航空	7,866	275,545.98	0.36
65	600511	国药股份	10,190	274,620.50	0.36
66	600260	凯乐科技	10,200	273,768.00	0.36
67	600138	中青旅	13,700	273,041.00	0.36
68	601168	西部矿业	42,900	269,412.00	0.35
69	600125	铁龙物流	32,100	268,677.00	0.35
70	601000	唐山港	114,140	268,229.00	0.35
71	600380	健康元	22,356	265,142.16	0.35
72	600803	新奥股份	22,951	264,854.54	0.35

73	601678	滨化股份	42,536	262,872.48	0.35
74	600655	豫园股份	27,700	261,765.00	0.34
75	600270	外运发展	12,400	259,904.00	0.34
76	603816	顾家家居	3,526	259,196.26	0.34
77	600648	外高桥	14,122	258,150.16	0.34
78	603077	和邦生物	146,880	254,102.40	0.33
79	600323	瀚蓝环境	16,600	252,652.00	0.33
80	600499	科达洁能	36,253	248,695.58	0.33
81	600122	宏图高科	35,835	246,903.15	0.32
82	601231	环旭电子	27,100	245,797.00	0.32
83	600563	法拉电子	4,927	243,837.23	0.32
84	601636	旗滨集团	54,600	242,970.00	0.32
85	600717	天津港	32,200	242,466.00	0.32
86	600166	福田汽车	110,000	223,300.00	0.29
87	600582	天地科技	59,900	219,833.00	0.29
88	603517	绝味食品	5,000	212,250.00	0.28
89	600988	赤峰黄金	43,400	211,358.00	0.28
90	600801	华新水泥	14,000	210,420.00	0.28
91	600141	兴发集团	18,000	209,700.00	0.28
92	600835	上海机电	11,069	208,761.34	0.27
93	600597	光明乳业	21,136	208,612.32	0.27
94	600754	锦江股份	5,613	207,456.48	0.27
95	603008	喜临门	10,400	205,712.00	0.27
96	603766	隆鑫通用	37,800	205,254.00	0.27
97	600039	四川路桥	62,300	204,344.00	0.27
98	600559	老白干酒	10,220	204,297.80	0.27
99	600273	嘉化能源	22,300	202,038.00	0.27
100	600372	中航电子	15,300	199,818.00	0.26
101	600580	卧龙电气	26,100	198,882.00	0.26
102	600881	亚泰集团	52,500	195,825.00	0.26
103	600026	中远海能	46,000	195,040.00	0.26
104	601880	大连港	100,500	194,970.00	0.26
105	600507	方大特钢	18,200	194,558.00	0.26
106	600694	大商股份	5,981	194,442.31	0.26
107	600990	四创电子	3,922	193,433.04	0.25
108	600410	华胜天成	22,045	192,893.75	0.25
109	601058	赛轮金宇	79,160	192,358.80	0.25
110	600171	上海贝岭	16,600	192,228.00	0.25
111	600206	有研新材	21,500	190,275.00	0.25

112	600562	国睿科技	10,971	188,152.65	0.25
113	600197	伊力特	8,300	187,165.00	0.25
114	601666	平煤股份	44,600	186,428.00	0.24
115	600612	老凤祥	5,138	184,659.72	0.24
116	600993	马应龙	10,800	183,708.00	0.24
117	600557	康缘药业	14,768	182,384.80	0.24
118	603515	欧普照明	3,900	182,286.00	0.24
119	600856	中天能源	27,800	179,032.00	0.24
120	600611	大众交通	44,750	178,105.00	0.23
121	600236	桂冠电力	31,000	177,010.00	0.23
122	600623	华谊集团	16,949	169,151.02	0.22
123	600420	现代制药	16,073	167,159.20	0.22
124	600998	九州通	9,800	166,208.00	0.22
125	600720	祁连山	23,860	160,816.40	0.21
126	600708	光明地产	37,259	160,213.70	0.21
127	600750	江中药业	9,100	159,887.00	0.21
128	603198	迎驾贡酒	8,690	159,635.30	0.21
129	600185	格力地产	29,160	158,338.80	0.21
130	600172	黄河旋风	36,020	156,326.80	0.21
131	600811	东方集团	41,560	156,265.60	0.21
132	600395	盘江股份	25,568	155,197.76	0.20
133	600123	兰花科创	22,200	154,734.00	0.20
134	601689	拓普集团	7,958	154,703.52	0.20
135	600685	中船防务	11,562	154,237.08	0.20
136	600587	新华医疗	11,300	154,019.00	0.20
137	601908	京运通	33,600	153,888.00	0.20
138	600377	宁沪高速	16,900	153,452.00	0.20
139	600258	首旅酒店	5,640	153,238.80	0.20
140	600633	浙数文化	18,239	152,113.26	0.20
141	603368	柳药股份	4,472	151,064.16	0.20
142	600477	杭萧钢构	31,298	149,917.42	0.20
143	600536	中国软件	6,800	147,084.00	0.19
144	600668	尖峰集团	12,000	146,400.00	0.19
145	600422	昆药集团	18,800	145,700.00	0.19
146	600502	安徽水利	36,120	145,202.40	0.19
147	601958	金钼股份	23,100	144,837.00	0.19
148	600366	宁波韵升	23,733	144,771.30	0.19
149	600114	东睦股份	14,800	144,596.00	0.19
150	603338	浙江鼎力	3,081	142,958.40	0.19

151	603866	桃李面包	2,500	142,850.00	0.19
152	600285	羚锐制药	15,900	141,669.00	0.19
153	600116	三峡水利	21,200	141,616.00	0.19
154	600596	新安股份	8,712	140,873.04	0.19
155	600326	西藏天路	23,800	140,658.00	0.18
156	600578	京能电力	44,900	140,088.00	0.18
157	600175	美都能源	40,300	139,841.00	0.18
158	600312	平高电气	24,400	137,616.00	0.18
159	600641	万业企业	13,200	137,544.00	0.18
160	600614	鹏起科技	24,000	137,040.00	0.18
161	600572	康恩贝	19,094	136,903.98	0.18
162	601001	大同煤业	27,400	135,904.00	0.18
163	603111	康尼机电	20,300	134,183.00	0.18
164	600756	浪潮软件	7,800	133,848.00	0.18
165	600787	中储股份	17,155	132,779.70	0.17
166	600742	一汽富维	10,440	127,681.20	0.17
167	600846	同济科技	16,900	127,257.00	0.17
168	603579	荣泰健康	1,800	125,928.00	0.17
169	600757	长江传媒	21,727	123,626.63	0.16
170	603188	亚邦股份	11,900	121,380.00	0.16
171	600661	新南洋	5,000	121,350.00	0.16
172	600765	中航重机	16,100	119,784.00	0.16
173	600416	湘电股份	16,654	119,742.26	0.16
174	603568	伟明环保	4,700	118,910.00	0.16
175	600216	浙江医药	9,200	117,484.00	0.15
176	600277	亿利洁能	22,200	116,328.00	0.15
177	601069	西部黄金	6,900	115,851.00	0.15
178	600006	东风汽车	28,300	115,747.00	0.15
179	600299	安迪苏	9,869	114,875.16	0.15
180	603686	龙马环卫	4,700	114,868.00	0.15
181	600093	易见股份	11,300	113,904.00	0.15
182	600682	南京新百	6,900	113,436.00	0.15
183	600261	阳光照明	29,700	111,672.00	0.15
184	601311	骆驼股份	9,709	111,362.23	0.15
185	603556	海兴电力	6,110	111,018.70	0.15
186	600635	大众公用	29,750	110,670.00	0.15
187	601139	深圳燃气	19,630	108,946.50	0.14
188	600054	黄山旅游	9,300	108,345.00	0.14
189	600387	海越股份	11,772	108,066.96	0.14

190	600987	航民股份	11,400	107,730.00	0.14
191	600687	刚泰控股	13,500	107,055.00	0.14
192	601567	三星医疗	14,700	107,016.00	0.14
193	603108	润达医疗	9,400	105,468.00	0.14
194	600500	中化国际	15,300	104,346.00	0.14
195	601158	重庆水务	19,200	104,064.00	0.14
196	603228	景旺电子	2,100	103,824.00	0.14
197	600337	美克家居	17,710	103,780.60	0.14
198	600007	中国国贸	7,100	102,737.00	0.13
199	600180	瑞茂通	10,600	102,714.00	0.13
200	603898	好莱客	3,900	102,336.00	0.13
201	600971	恒源煤电	14,000	99,960.00	0.13
202	600200	江苏吴中	13,100	98,774.00	0.13
203	600350	山东高速	24,300	98,415.00	0.13
204	600335	国机汽车	10,824	98,065.44	0.13
205	600667	太极实业	13,300	97,888.00	0.13
206	600863	内蒙华电	43,000	97,610.00	0.13
207	601222	林洋能源	19,400	96,612.00	0.13
208	600167	联美控股	9,600	96,000.00	0.13
209	600531	豫光金铅	19,300	95,342.00	0.13
210	600363	联创光电	10,300	95,172.00	0.12
211	603595	东尼电子	1,300	92,950.00	0.12
212	600664	哈药股份	23,340	92,659.80	0.12
213	600400	红豆股份	24,640	92,400.00	0.12
214	600105	永鼎股份	25,220	91,800.80	0.12
215	600459	贵研铂业	8,471	91,486.80	0.12
216	600748	上实发展	18,145	91,450.80	0.12
217	600329	中新药业	4,800	91,200.00	0.12
218	603888	新华网	5,400	91,044.00	0.12
219	603609	禾丰牧业	9,600	90,624.00	0.12
220	600859	王府井	4,260	90,610.20	0.12
221	601515	东风股份	11,500	88,780.00	0.12
222	600862	中航高科	14,400	88,560.00	0.12
223	603868	飞科电器	1,820	88,033.40	0.12
224	600075	新疆天业	13,460	87,490.00	0.11
225	600594	益佰制药	9,700	86,912.00	0.11
226	600517	置信电气	23,200	85,840.00	0.11
227	603737	三棵树	1,620	85,827.60	0.11
228	600343	航天动力	9,166	84,143.88	0.11

229	600986	科达股份	8,786	82,236.96	0.11
230	600391	航发科技	5,600	81,480.00	0.11
231	600255	梦舟股份	36,000	80,640.00	0.11
232	600897	厦门空港	3,901	80,438.62	0.11
233	600996	贵广网络	10,500	77,910.00	0.10
234	600758	红阳能源	17,800	77,252.00	0.10
235	600973	宝胜股份	21,160	77,234.00	0.10
236	600743	华远地产	29,900	76,843.00	0.10
237	600850	华东电脑	4,800	76,800.00	0.10
238	603806	福斯特	3,484	76,682.84	0.10
239	600548	深高速	9,700	76,145.00	0.10
240	600965	福成股份	7,500	75,750.00	0.10
241	600269	赣粤高速	18,500	75,665.00	0.10
242	600053	九鼎投资	4,400	75,548.00	0.10
243	603306	华懋科技	4,420	75,361.00	0.10
244	600568	中珠医疗	15,680	75,264.00	0.10
245	603877	太平鸟	2,200	73,326.00	0.10
246	601789	宁波建工	20,300	73,283.00	0.10
247	600280	中央商场	8,400	73,248.00	0.10
248	600305	恒顺醋业	7,930	72,638.80	0.10
249	600483	福能股份	10,553	72,499.11	0.10
250	600295	鄂尔多斯	8,000	71,920.00	0.09
251	600439	瑞贝卡	18,760	71,663.20	0.09
252	600012	皖通高速	11,800	70,328.00	0.09
253	601016	节能风电	24,500	70,315.00	0.09
254	600491	龙元建设	10,043	70,200.57	0.09
255	601890	亚星锚链	16,000	69,280.00	0.09
256	600073	上海梅林	10,100	67,064.00	0.09
257	603567	珍宝岛	5,000	67,000.00	0.09
258	600162	香江控股	26,500	66,780.00	0.09
259	603000	人民网	8,000	66,400.00	0.09
260	601368	绿城水务	9,800	66,150.00	0.09
261	603128	华贸物流	11,300	65,879.00	0.09
262	601015	陕西黑猫	9,300	64,821.00	0.09
263	603997	继峰股份	6,400	64,256.00	0.08
264	600577	精达股份	18,500	64,195.00	0.08
265	603225	新凤鸣	3,080	61,507.60	0.08
266	601595	上海电影	3,778	60,939.14	0.08
267	603355	莱克电气	2,023	60,791.15	0.08

268	600626	申达股份	11,800	60,770.00	0.08
269	600210	紫江企业	17,900	60,323.00	0.08
270	603118	共进股份	10,580	59,248.00	0.08
271	600814	杭州解百	9,500	58,900.00	0.08
272	600874	创业环保	6,300	58,842.00	0.08
273	603818	曲美家居	5,000	58,800.00	0.08
274	601199	江南水务	13,300	58,254.00	0.08
275	603959	百利科技	3,220	57,605.80	0.08
276	600684	珠江实业	10,060	56,738.40	0.07
277	600495	晋西车轴	14,500	55,680.00	0.07
278	600284	浦东建设	11,340	55,339.20	0.07
279	601020	华钰矿业	3,800	52,402.00	0.07
280	603639	海利尔	1,960	52,332.00	0.07
281	603258	电魂网络	2,500	49,875.00	0.07
282	603989	艾华集团	2,210	49,658.70	0.07
283	600020	中原高速	13,100	49,387.00	0.06
284	600428	中远海特	13,700	48,635.00	0.06
285	603358	华达科技	2,380	47,314.40	0.06
286	603929	亚翔集成	2,356	47,072.88	0.06
287	603025	大豪科技	2,380	46,029.20	0.06
288	603339	四方冷链	2,300	45,632.00	0.06
289	603165	荣晟环保	1,960	45,432.80	0.06
290	600829	人民同泰	6,100	43,676.00	0.06
291	601002	晋亿实业	7,000	42,770.00	0.06
292	603585	苏利股份	1,882	40,048.96	0.05
293	603298	杭叉集团	3,200	39,328.00	0.05
294	603328	依顿电子	3,587	38,918.95	0.05
295	600917	重庆燃气	5,700	38,817.00	0.05
296	603060	国检集团	2,300	38,387.00	0.05
297	601128	常熟银行	6,700	38,324.00	0.05
298	603239	浙江仙通	3,000	36,630.00	0.05
299	600828	茂业商业	7,000	35,700.00	0.05
300	600838	上海九百	5,100	35,700.00	0.05
301	603599	广信股份	2,300	33,028.00	0.04
302	603628	清源股份	2,900	30,711.00	0.04
303	600551	时代出版	3,422	30,250.48	0.04
304	603618	杭电股份	4,879	30,054.64	0.04
305	600526	菲达环保	4,800	28,224.00	0.04
306	603757	大元泵业	980	27,351.80	0.04

307	603126	中材节能	4,100	26,035.00	0.03
308	603600	永艺股份	2,700	25,488.00	0.03
309	603169	兰石重装	4,900	24,549.00	0.03
310	600657	信达地产	3,600	15,300.00	0.02

### 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	600867	通化东宝	61,709	1,479,164.73	1.94
2	600298	安琪酵母	19,956	712,030.08	0.94
3	000725	京东方 A	200,000	708,000.00	0.93
4	300287	飞利信	90,000	647,100.00	0.85
5	002739	万达电影	12,000	456,360.00	0.60
6	600309	万华化学	10,000	454,200.00	0.60
7	600884	杉杉股份	19,651	434,287.10	0.57
8	600373	中文传媒	22,900	294,265.00	0.39
9	601238	广汽集团	19,740	219,903.60	0.29
10	600226	瀚叶股份	35,253	143,127.18	0.19
11	600399	抚顺特钢	32,000	139,520.00	0.18
12	600267	海正药业	8,500	123,590.00	0.16
13	600666	奥瑞德	28,640	112,841.60	0.15
14	600651	飞乐音响	23,300	90,870.00	0.12
15	600894	广日股份	14,421	85,516.53	0.11
16	600571	信雅达	10,900	83,821.00	0.11
17	600481	双良节能	27,240	83,354.40	0.11
18	601777	力帆股份	15,400	80,542.00	0.11
19	600086	东方金钰	9,881	71,834.87	0.09
20	600697	欧亚集团	3,250	69,192.50	0.09
21	600458	时代新材	7,600	55,936.00	0.07
22	600405	动力源	9,910	50,739.20	0.07
23	600818	中路股份	2,800	42,868.00	0.06
24	603528	多伦科技	5,000	39,700.00	0.05
25	601126	四方股份	7,568	38,521.12	0.05
26	600113	浙江东日	4,700	38,493.00	0.05
27	603727	博迈科	2,400	36,408.00	0.05
28	600776	东方通信	7,500	36,300.00	0.05
29	600077	宋都股份	9,727	33,558.15	0.04



30	600292	远达环保	5,700	33,459.00	0.04
31	600864	哈投股份	7,236	32,562.00	0.04
32	600831	广电网络	5,348	32,194.96	0.04
33	600650	锦江投资	2,796	29,302.08	0.04
34	601700	风范股份	8,300	28,718.00	0.04
35	600119	长江投资	3,400	27,812.00	0.04
36	600617	国新能源	4,500	24,435.00	0.03

## 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	000725	京东方 A	2,398,800.00	2.70
2	600887	伊利股份	1,859,726.00	2.09
3	000002	万科 A	1,492,032.00	1.68
4	600048	保利地产	1,265,464.00	1.42
5	600383	金地集团	1,260,000.00	1.42
6	300287	飞利信	873,400.00	0.98
7	600867	通化东宝	841,978.00	0.95
8	600346	恒力股份	554,316.00	0.62
9	603833	欧派家居	286,472.00	0.32
10	603939	益丰药房	255,684.00	0.29
11	603517	绝味食品	208,773.00	0.23
12	600801	华新水泥	204,536.00	0.23
13	600600	青岛啤酒	203,428.00	0.23
14	600779	水井坊	197,898.00	0.22
15	600176	中国巨石	185,140.00	0.21
16	600499	科达洁能	174,995.00	0.20
17	600418	江淮汽车	149,686.00	0.17
18	603595	东尼电子	143,818.00	0.16
19	600141	兴发集团	140,832.00	0.16
20	600967	内蒙一机	138,000.00	0.16

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	601012	隆基股份	1,860,900.24	2.09
2	600309	万华化学	1,711,151.20	1.92
3	601888	中国国旅	1,576,350.00	1.77
4	600887	伊利股份	1,560,220.00	1.75
5	000002	万科 A	1,494,055.00	1.68
6	600660	福耀玻璃	1,484,686.41	1.67
7	600519	贵州茅台	1,288,220.00	1.45
8	600048	保利地产	1,085,764.00	1.22
9	000725	京东方 A	996,600.00	1.12
10	600383	金地集团	992,028.00	1.12
11	600522	中天科技	824,137.00	0.93
12	600282	南钢股份	515,500.00	0.58
13	600438	通威股份	386,584.00	0.43
14	601997	贵阳银行	345,249.00	0.39
15	600256	广汇能源	241,020.00	0.27
16	603588	高能环境	225,730.00	0.25
17	600289	*ST 信通	80,580.00	0.09
18	600176	中国巨石	41,758.86	0.05
19	600826	兰生股份	40,433.00	0.05
20	600891	秋林集团	39,381.30	0.04

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	14,584,907.70
卖出股票收入（成交）总额	17,080,052.60

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明****7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本报告期末本基金未持有股指期货。

**7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策**

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与股指期货的投资。

**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**

根据基金合同中对投资范围的规定，本基金不参与国债期货的投资。

**7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

本报告期末本基金未持有国债期货。

**7.11.3 本期国债期货投资评价**

本报告期末本基金未持有国债期货。

**7.12 投资组合报告附注****7.12.1**

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，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	4,035.41
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	1,329.13
5	应收申购款	33,848.10
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	39,212.64

#### 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

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	002739	万达电影	456,360.00	0.60	重大事项

## §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

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
6,088	12,772.94	42,375,275.86	54.49%	35,386,411.08	45.51%

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	118.55	0.0002%

### 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2011年11月22日）基金份额总额	456,870,635.87
本报告期期初基金份额总额	78,995,628.04
本报告期基金总申购份额	5,779,748.97
减:本报告期基金总赎回份额	7,013,690.07
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	77,761,686.94

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期没有举行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

自 2018 年 5 月 22 日起, 孔军先生、朱宗树先生任本基金管理人副总经理; 自 2018 年 5 月 22 日起, 张静女士、李小丽女士不再担任本基金管理人副总经理。

报告期内, 基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内, 无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管人业务的诉讼。

### 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

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、基金托管人的托管业务部门及其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	23,544,965.60	74.46%	21,927.73	74.46%	-

齐鲁证券	1	7,254,887.00	22.94%	6,756.55	22.94%	-
天风证券	1	822,283.00	2.60%	765.82	2.60%	-

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。

### 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	-	-	-	-	-	-
齐鲁证券	-	-	-	-	-	-
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	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2018 年第 1 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 1 月 4 日
2	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 1 月 16 日



3	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司、华瑞保险销售有限公司、北京植信基金销售有限公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 1 月 16 日
4	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 1 月 20 日
5	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中泰证券股份有限公司基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 1 月 31 日
6	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整北京展恒基金销售股份有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 1 日
7	中邮创业基金管理股份有限公司关于开通上海利得基金销售有限公司基金定投业务并参加定投申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 6 日
8	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 6 日
9	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加深圳市前海排排网基金销售有限责任公司为代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 2 月 6 日
10	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整一路财富（北京）信息科技股份有限公司申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 13 日
11	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 23 日
12	中邮创业基金管理股份有限公司关于增加厦门市鑫鼎盛控股有限	中国证券报、上海证券报、证券时报、	2018 年 3 月 23 日

	公司、北京坤元基金销售有限公司为代销机构的公告	证券日报	
13	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金调整代销机构申购起点金额、开通基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 28 日
14	关于修改中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同等法律文件的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 29 日
15	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 29 日
16	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 29 日
17	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 29 日
18	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 29 日
19	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加中国工商银行股份有限公司基金申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 30 日
20	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 30 日
21	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2017 年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 3 月 30 日
22	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通民生证券股份有限公司基金定投业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 4 月 21 日
23	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 4 月 23 日
24	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金开通银河证券基金定投业务并参加基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 5 月 18 日

25	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金手机银行申购及定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 6 月 29 日
26	中邮上证 380 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2018 年第 2 号）	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 年 6 月 30 日
27	关于中邮创业基金管理股份有限公司旗下部分基金参加交通银行股份有限公司基金网上银行定投优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2018 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	20180101-20180630	41,402,103.36	-	-	41,402,103.36	53.24%
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上证 380 指数增强型证券投资基金募集的文件
2. 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金基金合同》
3. 《中邮上证 380 指数增强型证券投资基金托管协议》
4. 《中邮上证 380 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指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的住所。

### 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](http://www.postfund.com.cn)

中邮创业基金管理股份有限公司

2018 年 8 月 28 日