中邮上证380指数增强型证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	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，分享中国经济成长的成果。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。
投资策略	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。 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。 本基金的投资策略包括以下几个层面： 1.资产配置策略 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度超配或配置。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；通过对债券市场中的国债、金融债、公司债等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、增发等变化，对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 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。 5.跟踪误差控制策略 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。
业绩比较基准	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%。 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，除剔除上证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纵的股票，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；指数样本每年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。 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，或指数提供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。
风险收益特征	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。

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

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.postfund.com.cn
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.

§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

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

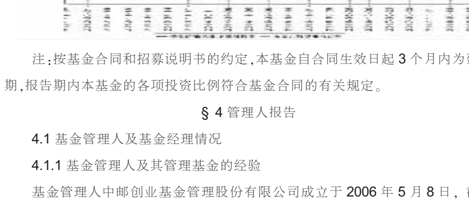
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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



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了培训，督促相关人员严格遵守该制度。为确保该制度的顺利执行，公司与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
资产：			
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
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
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
所有者权益：			
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
一、收入		-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
减：二、费用		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
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-11,271,607.44	2,744,828.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-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(基金净值)	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
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 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 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

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

注：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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

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

6.4.8.2.2 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

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：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。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 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	1.2500%	0.0300%

6.4.8.4.2 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

注：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。

6.4.8.5 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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 利润分配情况

6.4.10 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

6.4.10.2 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)。6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.11 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

注：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前十名股票投资明细

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

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的年度报告正文。

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前五名股票投资明细

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

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

注：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

注：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前十名资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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

注：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、个股分析的报告及丰富全面的信息咨询服务；有很强的分析能力，能根据中邮创业基金管理股份有限公司所管理基金的特定要求，提供研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力以及其他综合服务能力。

(3) 券商经纪人能提供最优惠合理的佣金率：与其他券商经纪人相比，该券商经纪人能够提供最优惠合理的佣金率。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。基金管理人与被选择的证券公司签订委托协议，报中国证监会备案并通知基金托管人。

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

无。

§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%
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。

中邮创业基金管理股份有限公司

2018年8月28日