上银中证500指数增强型证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:上银基金管理有限公司

基金托管人:海通证券股份有限公司

报告送出日期:2021年10月27日

§1 重要提示

基金管理人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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上银中证500指数增强型
基金主代码	009613
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年07月01日
报告期末基金份额总额	273,323,047.30份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。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%。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

基金管理人	上银基金管理有限公司	
基金托管人	海通证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	上银中证500指数增强型A	上银中证500指数增强型C
下属分级基金的交易代码	009613	009614
报告期末下属分级基金的份额总额	81,556,713.34份	191,766,333.96份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	上银中证500指数增强型A	上银中证500指数增强型C
1.本期已实现收益	3,550,075.32	5,040,626.83
2.本期利润	3,144,065.49	-4,095,191.08
3.加权平均基金份额本期利润	0.0494	-0.0374
4.期末基金资产净值	95,850,023.59	224,541,617.69
5.期末基金份额净值	1.1753	1.1709

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、上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。

3.2 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

上银中证500指数增强型A净值表现

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	4.39%	1.36%	4.14%	1.07%	0.25%	0.29%

过去六个月	21.30%	1.10%	12.90%	0.89%	8.40%	0.21%
过去一年	26.09%	1.12%	14.02%	1.01%	12.07%	0.11%
自基金合同生效起至今	17.53%	1.13%	20.13%	1.16%	-2.60%	-0.03%

上银中证500指数增强型C净值表现

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	4.31%	1.36%	4.14%	1.07%	0.17%	0.29%
过去六个月	21.12%	1.10%	12.90%	0.89%	8.22%	0.21%
过去一年	25.71%	1.11%	14.02%	1.01%	11.69%	0.10%
自基金合同生效起至今	17.09%	1.13%	20.13%	1.16%	-3.04%	-0.03%

注：本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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：本基金合同生效日为 2020 年 7 月 1 日，自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§4　管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基	证券	说明

		金经理期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
徐静远	基金经理	2020-07-01	-	6年	硕士研究生，历任上海东方证券资产管理有限公司量化研究员、高级量化研究员。2020年7月担任上银中证500指数增强型证券投资基金基金经理，2020年9月担任上银核心成长混合型证券投资基金基金经理。
陈旭	量化投资部总监兼量化投资总监、基金经理	2021-03-12	-	9年	硕士研究生，历任国信证券股份有限公司经济研究所分析师、自营金融工程部投资经理，万家基金管理有限公司量化投资部基金经理、总监助理、副总监（主持工作）等职。2021年3月担任上银中证500指数增强型证券投资基金基金经理，2021年3月担任上银核心成长混合型证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2、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

报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的约定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》相关规定及公司内部的公平交易管理制度，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易的公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在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超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年三季度，市场宽幅震荡，风格和板块分化显著、大幅切换。上证指数涨幅-0.64%，沪深300涨幅-6.85%，中证500涨幅4.34%，创业板指涨幅-6.69%。从行业看，煤炭、有色金属、钢铁、电力及公用事业、基础化工、石油石化、电力设备及新能源等行业表现较强势。从风格看，小市值、低估值、低波动、强动量均有显著超额，但九月下旬风格切换、波动快速放大。

宏观经济方面，三季度外需出口绝对值仍处于高景气，国内经济修复不均衡，消费社零数据承压。供需不平衡叠加双减及限电的一系列举措，部分中上游工业品价格持续上行，对中下游生产活动的影响可能持续发酵。当前国内整体流动性平稳，美联储Taper预期较为充分，四季度国内流动性预期边际或有改善、保持合理充裕。

在投资管理上，本基金是以中证500指数为基准的指数增强基金，我们坚持采用量化多因子的投资策略，在有效控制跟踪误差和偏离的基础上，力争为投资者获取持续的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末上银中证500指数增强型A基金份额净值为1.1753元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.39%，同期业绩比较基准收益率为4.14%；截至报告期末上银中证500指数增强型C基金份额净值为1.1709元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为4.31%，同期业绩比较基准收益率为4.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的基金份额持有人数量不满两百人或者基金资产净值低于五千万需要在本报告中予以披露的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	302,521,910.86	93.66
	其中：股票	302,521,910.86	93.66

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	19,311,246.66	5.98
8	其他资产	1,166,370.20	0.36
9	合计	322,999,527.72	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	14,705,219.00	4.59
C	制造业	174,766,977.50	54.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,616,109.37	2.38
E	建筑业	3,196,951.00	1.00
F	批发和零售业	4,735,086.00	1.48
G	交通运输、仓储和邮政业	6,151,995.00	1.92
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,225,242.70	3.19
J	金融业	12,163,318.00	3.80
K	房地产业	5,833,315.00	1.82
L	租赁和商务服务业	174,445.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管	3,457,098.00	1.08

	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	2,570,723.00	0.80
S	综合	1,797,166.00	0.56
	合计	247,393,645.57	77.22

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	18,077.03	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	37,152,677.16	11.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,707,096.22	3.34
E	建筑业	960,825.69	0.30
F	批发和零售业	71,030.01	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,898.08	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,116,050.04	1.60
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,020,672.00	0.32
M	科学研究和技术服务业	24,507.98	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	41,633.46	0.01
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	11,797.62	0.00
S	综合	-	-

	合计	55,128,265.29	17.21

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

5.3 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

5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	000799	酒鬼酒	25,900	6,416,207.00	2.00
2	300037	新宙邦	38,500	5,967,500.00	1.86
3	000937	冀中能源	660,000	5,953,200.00	1.86
4	002013	中航机电	397,900	5,268,196.00	1.64
5	000887	中鼎股份	319,300	4,674,552.00	1.46
6	601615	明阳智能	172,400	4,301,380.00	1.34
7	300223	北京君正	32,200	4,137,700.00	1.29
8	002080	中材科技	116,600	4,127,640.00	1.29
9	603486	科沃斯	26,628	4,044,793.20	1.26
10	600141	兴发集团	88,300	3,960,255.00	1.24

5.3.2 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	600905	三峡能源	907,763	6,299,875.22	1.97
2	601985	中国核电	550,100	3,966,221.00	1.24
3	300750	宁德时代	6,400	3,364,672.00	1.05
4	300760	迈瑞医疗	7,600	2,929,192.00	0.91
5	300014	亿纬锂能	25,100	2,485,653.00	0.78

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计（元）					-
股指期货投资本期收益（元）					-716,836.00
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低由于申赎等原因股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-

3	应收股利	-
4	应收利息	9,278.58
5	应收申购款	1,157,091.62
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	1,166,370.20

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 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	600905	三峡能源	6,299,875.22	1.97	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	上银中证500指数增强型A	上银中证500指数增强型C
报告期期初基金份额总额	69,851,811.08	60,993,048.75
报告期期间基金总申购份额	45,490,752.41	161,720,246.41
减：报告期期间基金总赎回份额	33,785,850.15	30,946,961.20
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	81,556,713.34	191,766,333.96

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例无达到或超过20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立上银中证500指数增强型证券投资基金的文件

2、《上银中证500指数增强型证券投资基金基金合同》

3、《上银中证500指数增强型证券投资基金托管协议》

4、《上银中证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、报告期内在中国证监会规定报刊上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：021-60231999，公司网址：www.boscam.com.cn。

上银基金管理有限公司

2021年10月27日