

# 中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告

## 更正公告

中邮创业基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）于 2024 年 4 月 22 日在中国证监会基金电子披露网站和本公司官网披露了《中邮中证 500 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告》，现就“4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析”部分内容更正如下：

### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年一月份，A 股市场大幅下跌，尤其是中小股票受到各种资金面的影响，出现了一定的流动性危机，股价出现了非基本面导致的非理性下跌；春节之后，流动性危机解除，压制市场的资金面利空因素不复存在，市场企稳反弹，尤其以中小股票反弹幅度较大。整体来看，一季度 A 股呈现了较大的分化，大盘风格波动率明显较小，表现也较好，小盘风格表现较差，大幅波动的同时录得了下跌；成长板块表现明显落后于价值板块，一季度市场风险偏好仍然不高，一方面追求资产的稳健性和确定性，高股息风格受到追捧，另一方面追求新颖性，低空经济等新的主题概念炒作较热。

展望二季度，从外围环境看，美国降息存在一定的不确定性，美债收益率甚至有可能阶段性走高，全球市场流动性阶段性变差，权益资产的配置性价比承压。从国内基本面来看，二季度经济平稳修复，部分行业的消费数据表现将会超预期，出口有望继续拉动经济增速，政策层面也会进一步推出提振信心的举措，所以我们对国内的经济修复保持乐观。综合起来看，二季度权益市场将呈现振荡的走势，业绩稳健、估值较低的资产将会表现较好。

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。

一季度，本基金沿用去年下半年以来的以基本面因子选股为主的投资思路，提高了低估值、低波动、高盈利等基本面的因子的权重，并适度加入了人工智能选股因子，严格控制股票组合与基准指数的风格偏离。一季度本基金大幅跑赢了

基准指数,后续我们将继续优化现有量化选股模型,根据市场环境进行细微调整,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。

除以上更正内容外,其他内容不变。具体内容请以中国证监会基金电子披露网站和本公司官网披露的信息为准。由此给投资者带来的不便,公司深表歉意。

特此公告。

中邮创业基金管理股份有限公司

2024年5月16日