

# 浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

## 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 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>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53

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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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情况.....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>55</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.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
<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>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
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	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	浦银安盛沪深 300 指数增强
基金主代码	519116
前端交易代码	519116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 10 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	535,626,625.36 份
基金合同存续期	不定期

### 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，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，主要通过数量化模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。</p> <p>本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力争使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%。</p>
投资策略	<p>本基金以沪深 300 指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在跟踪目标指数的同时，力争获得超越业绩比较基准的收益。</p>
业绩比较基准	<p>沪深 300 指数收益率×95%+1% (1%指年收益率，评价时按期间累计天数折算)。</p>
风险收益特征	<p>本基金为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、债券型基金与货币市场基金。</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	浦银安盛基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛香
	联系电话	021-23212888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	021-60637111
传真	021-23212985	021-60635778
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1	北京市西城区金融大街 25 号

	层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层	
办公地址	上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	200020	100033
法定代表人	谢伟	田国立

## 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.py-axa.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-41,034,444.04
本期利润	-96,977,140.01
加权平均基金份额本期利润	-0.1692
本期加权平均净值利润率	-12.74%
本期基金份额净值增长率	-8.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	160,429,007.71
期末可供分配基金份额利润	0.2995
期末基金资产净值	713,954,905.52
期末基金份额净值	1.333
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	113.19%

注：1、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。

2、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、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

。

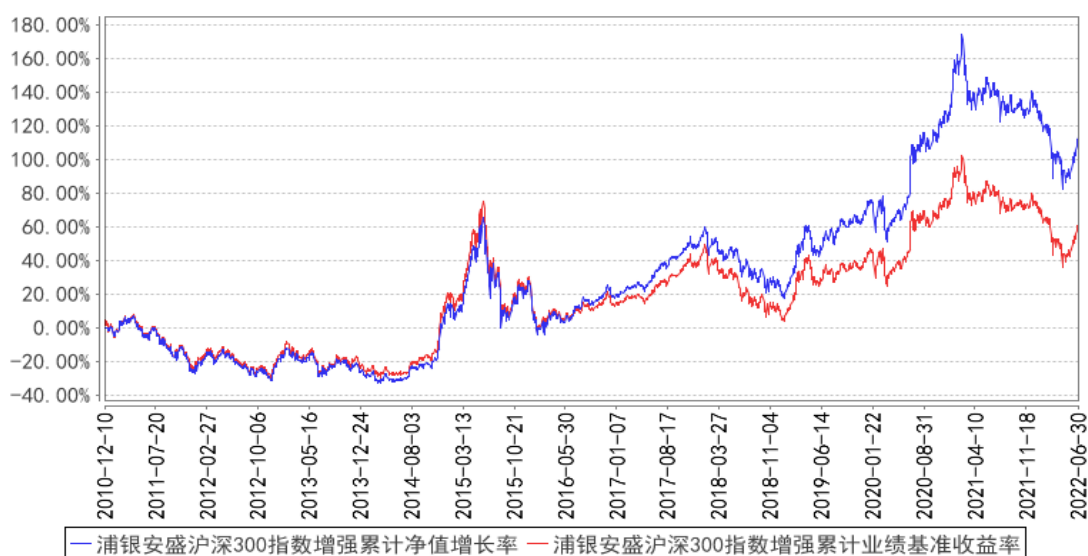
## 3.2 基金净值表现

### 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	9.80%	1.02%	9.21%	1.02%	0.59%	0.00%
过去三个月	5.72%	1.36%	6.19%	1.36%	-0.47%	0.00%
过去六个月	-8.84%	1.40%	-8.27%	1.38%	-0.57%	0.02%
过去一年	-13.07%	1.23%	-12.54%	1.18%	-0.53%	0.05%
过去三年	38.79%	1.23%	20.19%	1.20%	18.60%	0.03%
自基金合同生效起至今	113.19%	1.34%	60.47%	1.35%	52.72%	-0.01%

### 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

浦银安盛沪深300指数增强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：本基金根据基金合同中投资策略及投资限制的有关规定，本基金业绩比较基准=95%×沪深 300 指数收益率+1%（指年收益率，评价时按期间累计天数折算）。

本基金每个交易日对业绩比较基准进行再平衡处理，1 日收益率（benchmark）按下列公式计算：

$$\text{benchmark} = 95\% \times [\text{沪深 300 指数 } t / \text{沪深 300 指数}(t-1) - 1] + 1\% / 365 \times (D_t - D_{t-1});$$

其中， $t=1, 2, 3, \dots, T$ ， $T$  表示时间截止日， $D_t - D_{t-1}$  表示第  $t$  日和第  $(t-1)$  日之间的间隔天数（含第  $t$  日）。

期间  $T$  日收益率（benchmark）按下列公式计算：

$$\text{benchmark}_T = \left[ \prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t) \right] - 1;$$

其中， $T=2, 3, 4, \dots$ ； $\prod_{t=1}^T (1 + \text{benchmark}_t)$  表示  $t$  日至  $T$  日的  $(1 + \text{benchmark}_t)$  数学连乘。

## § 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

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币 19.1 亿元，股东持股比例分别为 51%、39% 和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2022 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 100 只基金，即浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛货币市场证券投资基金、浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛日日盈货币市场基金、浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安



盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金 (QDII)、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛科技创新优选三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证智能电

动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深游戏及文化传媒交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛 CFETS 0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银安盛颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛品质优选混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银安盛普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴耀优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统也主要是采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

#### 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		
陈士	公司指数	2010 年	-	21 年	陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001

俊	及量化投资部总监，公司职工监事，公司旗下部分基金基金经理。	12 月 10 日		年至 2003 年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员 2 年；2003 年至 2007 年 10 月在银河基金管理有限公司工作 4 年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于 2010 年 12 月起担任浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。2012 年 3 月担任本公司职工监事。2012 年 5 月起，担任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金经理。2017 年 4 月起，担任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理。2018 年 9 月起，担任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 1 月起，担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 4 月起，担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金及浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 9 月起，担任浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021 年 5 月起，担任浦银安盛鑫福混合型证券投资基金基金经理。2021 年 7 月起担任浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月起担任浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金及浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
---	-------------------------------	-----------	--	--

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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《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，以及公司的规章制度，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，

在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

报告期内，本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3 日，5 日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下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超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 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

2022 年上半年，美联储加息和俄、乌两国爆发战争，原油和粮食价格大幅上涨，使得市场对全球通胀的预期升温，高估值的新能源、半导体等成长板块率先进行调整。4 月份，上海新冠病毒变异株传染蔓延，防疫形势陡然严峻，给社会经济生活带来重大影响。疫情期间，制造业 PMI 指数和工业增加值大幅回落，服务业受损严重，不佳的经济数据更加剧了股票市场的调整。此后，政府出台了一系列稳增长举措，经济企稳回升，二季度 GDP 实现正增长，稳定了投资者信心。国内货币环境保持宽松，实体经济需求缓慢恢复，对成长股的估值形成有力支撑，受到光伏装机量超预期、新能源汽车补贴政策落地等利好因素影响，光伏、新能源汽车等高景气板块二季度大幅反弹。由于房地产企业信用风险不断，房地产、建材以及银行等相关板块的股价持续低迷。2022 年上半年，沪深 300 指数下跌 9.22%。从量化因子来看，一季度价值因子表现较好，二季度盈利

动量因子表现较好。

本报告期内，本基金严格执行量化增强的投资策略，根据指数成份股定期调整，以及因子表现和市场风格变化，对组合进行相应的调整，组合表现略低于业绩比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛沪深 300 指数增强基金份额净值为 1.333 元，本报告期基金份额净值增长率为-8.84%；同期业绩比较基准收益率为-8.27%。

#### 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，随着稳增长政策效力逐渐显现，我国经济增长将回到正常轨道。国常会提出因城施策促进房地产市场平稳健康发展，有望化解当前备受关注的房地产风险隐患，从而投资和消费将会显著提升。同时，中国正处于经济结构转型的关键时期，面对着外部不利因素挑战，新能源汽车、半导体等高端制造业会加速发展。当前市场价值和成长风格的投资机会相对均衡，前期表现低迷的价值股有望随经济复苏而迎来补涨行情，高景气赛道的成长股则需要结合估值和内生增长潜力进行甄别筛选。在海外经济衰退和流动性风险可控的前提下，我们对下半年的 A 股市场保持相对乐观的判断。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司产品估值条线分管领导、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、产品估值部负责人以及所涉及投资品种的投研部门负责人（包括但不限于权益投资部、研究部、权益专户部、固定收益投资部、固定收益专户部、信用研究部等）组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司以及中债金融估值中心有限公司签订了《中

债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于每次收益分配基准日可供分配利润的 10%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金自 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间进行 1 次收益分配，实际分配收益：36,379,140.17 元，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

#### 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

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

## § 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

### 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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

### 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

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

## § 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：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	6.4.7.1	43,455,436.66	55,778,633.12
结算备付金		107,050.48	688,840.35
存出保证金		128,491.32	198,813.13
交易性金融资产	6.4.7.2	671,728,447.62	836,930,770.71
其中: 股票投资		671,728,447.62	836,930,770.71
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		175,337.99	238,517.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	11,016.56
资产总计		715,594,764.07	893,846,591.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 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		22.60	-
应付赎回款		643,823.04	401,317.47
应付管理人报酬		555,839.67	751,410.90
应付托管费		83,375.95	112,711.64
应付销售服务费		-	-
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	356,797.29	1,103,065.56
负债合计		1,639,858.55	2,368,505.57
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	535,626,625.36	581,888,465.24
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	178,328,280.16	309,589,620.82
净资产合计		713,954,905.52	891,478,086.06
负债和净资产总计		715,594,764.07	893,846,591.63

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.333 元，基金份额总额 535,626,625.36。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-92,424,193.23	35,094,109.25
1. 利息收入		96,675.35	178,201.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	96,675.35	175,747.45
债券利息收入		-	158.79
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		-	2,294.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-36,781,712.79	71,646,769.45
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-43,641,133.12	62,007,408.62
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	6,859,420.33	9,639,360.83
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	-55,942,695.97	-37,250,824.15
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	203, 540. 18	519, 962. 95
<b>减: 二、营业总支出</b>		4, 552, 946. 78	9, 513, 732. 63
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 781, 346. 53	5, 774, 531. 34
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	567, 201. 90	866, 179. 67
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
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	204, 398. 35	2, 873, 021. 62
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		-96, 977, 140. 01	25, 580, 376. 62
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		-96, 977, 140. 01	25, 580, 376. 62
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-96, 977, 140. 01	25, 580, 376. 62

### 6.3 净资产 (基金净值) 变动表

会计主体: 浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期: 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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)	581, 888, 465. 24	-	309, 589, 620. 82	891, 478, 086. 06
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末初净	581, 888, 465. 24	-	309, 589, 620. 82	891, 478, 086. 06

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-46,261,839.88	-	-131,261,340.66	-177,523,180.54
(一)、综合收益总额	-	-	-96,977,140.01	-96,977,140.01
(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)	-46,261,839.88	-	2,094,939.52	-44,166,900.36
其中: 1. 基金申购款	93,125,294.41	-	29,844,297.97	122,969,592.38
2. 基金赎回款	-139,387,134.29	-	-27,749,358.45	-167,136,492.74
(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)	-	-	-36,379,140.17	-36,379,140.17
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期末净资产(基金净值)	535,626,625.36	-	178,328,280.16	713,954,905.52
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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)	368,028,135.99	-	322,724,691.61	690,752,827.60
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净资产(基金净值)	368,028,135.99	-	322,724,691.61	690,752,827.60
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	337,370,803.83	-	214,075,546.48	551,446,350.31
(一)、综合收益总额	-	-	25,580,376.62	25,580,376.62
(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)	337,370,803.83	-	300,318,884.31	637,689,688.14
其中: 1.	574,413,443.62	-	493,473,796.78	1,067,887,240.40

基金申购款				
2. 基金赎回款	-237,042,639.79	-	-193,154,912.47	-430,197,552.26
(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)	-	-	-111,823,714.45	-111,823,714.45
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	705,398,939.82	-	536,800,238.09	1,242,199,177.91

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：

郁蓓华

基金管理人负责人

郁蓓华

主管会计工作负责人

钱琨

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

浦银安盛沪深 300 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[2010]961 号文批准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。

本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集

814,650,876.35 元,经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2010)第 393 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 815,083,164.39 份基金份额,其中认购资金利息折合 432,288.04 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》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、存托凭证、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中,股票资产占基金资产的比例不低于 90%,投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%,其中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%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等;权证及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。本基金可根据相关法律法规,参与转融通证券出借业务。本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+1%(指年收益率,评价时按期间累计天数折算)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 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的说明

除 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明中所述以外,其余会计政策、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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

新金融工具准则:

金融资产和金融负债的分类:

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产或金融负债。

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具, 分别采用以下两种方式进行计量:

以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标, 且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致, 即在特定日期产生的现金流量, 仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益:

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具, 以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资, 在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认：

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余

成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

收入/(损失)的确认和计量：

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息



继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产和金融负债的分类：

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认：

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

收入/(损失)的确认和计量:

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

于 2022 年 1 月 1 日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款,金额分别为 55,778,633.12 元、688,840.35 元、198,813.13 元、11,016.56 元和 238,517.76 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款,金额分别为 55,789,250.18 元、689,150.35 元、198,902.63 元、0.00 元和 238,517.76 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 836,930,770.71 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产,金额为 836,930,770.71 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为 401,317.47 元、751,410.90 元、112,711.64 元、851,773.66 元和 51,291.90 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款,金额分别为 401,317.47 元、751,410.90 元、112,711.64 元、851,773.66 元和 51,291.90 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 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[2008]1号《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《关于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《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，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非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、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) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金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。

(5) 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。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	43,455,436.66
等于：本金	43,451,435.88
加：应计利息	4,000.78
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	43,455,436.66

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	712,467,029.11	-	671,728,447.62	-40,738,581.49
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	712,467,029.11	-	671,728,447.62	-40,738,581.49

### 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

注：本基金本报告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

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

注：本基金在本报告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

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内无债权投资减值准备计提情况。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内无其他债权投资减值准备计提情况。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末不存在其他权益工具投资情况。

#### 6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告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 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,696.70
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	150,962.24
其中：交易所市场	150,962.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	100,000.00
合计	356,797.29

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	581,888,465.24	581,888,465.24
本期申购	93,125,294.41	93,125,294.41
本期赎回（以“-”号填列）	-139,387,134.29	-139,387,134.29
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	535,626,625.36	535,626,625.36

注：注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	252,608,469.00	56,981,151.82	309,589,620.82
本期利润	-41,034,444.04	-55,942,695.97	-96,977,140.01
本期基金份额交易产生的变动数	-14,765,877.08	16,860,816.60	2,094,939.52
其中：基金申购款	34,510,411.03	-4,666,113.06	29,844,297.97

基金赎回款	-49,276,288.11	21,526,929.66	-27,749,358.45
本期已分配利润	-36,379,140.17	-	-36,379,140.17
本期末	160,429,007.71	17,899,272.45	178,328,280.16

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	89,360.02
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	5,238.20
其他	2,077.13
合计	96,675.35

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-43,641,133.12
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-43,641,133.12

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	244,574,163.04
减：卖出股票成本总额	287,528,781.15
减：交易费用	686,515.01
买卖股票差价收入	-43,641,133.12

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期间无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期间无债券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金在本报告期间无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期间无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期间无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期间无贵金属投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期间无贵金属投资收益——申购差价收入。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。



**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	6,859,420.33
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	6,859,420.33

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-55,942,695.97
股票投资	-55,942,695.97
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-55,942,695.97

**6.4.7.21 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	203,534.09
基金转换费收入	6.09
合计	203,540.18

注：注：1. 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。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

**6.4.7.22 信用减值损失**

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	260.00
指数使用费	100,000.00
合计	204,398.35

#### 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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2022 年 7 月 5 日宣告 2022 年度的第 2 次分红，向截至 2022 年 7 月 6 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的份额持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.55 元。

#### 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
浦银安盛基金管理有限公司(“浦银安盛”)	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“上海浦东发展银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：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，并以一般交易价格为定价基础。

#### 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

###### 6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

**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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,781,346.53	5,774,531.34
其中：支付销售机构的客户维护费	415,100.13	437,555.23

注：支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	567,201.90	866,179.67

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

注：本基金无销售服务费。

**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**

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

**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**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 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

注：基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

##### 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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
中国建设银行	43,455,436.66	89,360.02	132,377,582.74	148,379.86

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022年4月15日	-	2022年4月15日	0.6000	19,964,665.83	16,414,474.34	36,379,140.17	-
合计	-	-	-	0.6000	19,964,665.83	16,414,474.34	36,379,140.17	-

#### 6.4.12 期末(2022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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	491	27,284.87	14,744.73	-

301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股锁定	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股锁定	34.81	16.14	1,131	26,246.74	18,254.34	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301151	冠龙节能	2022年3月30日	6个月	新股锁定	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股锁定	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62	-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	377	21,443.76	21,270.34	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	779	27,794.72	23,245.36	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	216	20,877.60	18,969.12	-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股锁定	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301236	软通动力	2022年3月	6个月	新股锁定	72.88	31.38	956	46,424.56	29,999.28	-

		8 日									
301237	和顺科技	2022 年 3 月 16 日	6 个月	新股锁定	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-	
301258	富士莱	2022 年 3 月 21 日	6 个月	新股锁定	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-	
301268	铭利达	2022 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-	
600941	中国移动	2021 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	57.58	60.26	43,681	2,515,151.98	2,632,217.06	-	
688175	高凌信息	2022 年 3 月 8 日	6 个月	新股锁定	51.68	32.23	2,851	147,339.68	91,887.73	-	

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无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

本基金是一只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、债券型基金与货币市场基金。

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、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证及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。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层级的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部、法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长和审计。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司常设的议事决策机构和公司经营层面的最高风险管理机构，主要负责制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部、法律合规部监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，法律合规部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和

评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。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。而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金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券投资和资产支持证券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。



于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场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所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，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

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金持有及承担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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	43,455,436.66	-	-	-	43,455,436.66
结算备付金	107,050.48	-	-	-	107,050.48
存出保证金	128,491.32	-	-	-	128,491.32
交易性金融资产	-	-	-	671,728,447.62	671,728,447.62
应收申购款	-	-	-	175,337.99	175,337.99
资产总计	43,690,978.46	-	-	671,903,785.61	715,594,764.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	643,823.04	643,823.04
应付管理人报酬	-	-	-	555,839.67	555,839.67
应付托管费	-	-	-	83,375.95	83,375.95
应付清算款	-	-	-	22.60	22.60
其他负债	-	-	-	356,797.29	356,797.29
负债总计	-	-	-	1,639,858.55	1,639,858.55
利率敏感度缺口	43,690,978.46	-	-	670,263,927.06	713,954,905.52
上年度末 2021 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	55,778,633.12	-	-	-	55,778,633.12
结算备付金	688,840.35	-	-	-	688,840.35
存出保证金	198,813.13	-	-	-	198,813.13
交易性金融资产	-	-	-	836,930,770.71	836,930,770.71

应收利息	-	-	-	11,016.56	11,016.56
应收申购款	-	-	-	238,517.76	238,517.76
资产总计	56,666,286.60	-	-	-837,180,305.03	893,846,591.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	401,317.47	401,317.47
应付管理人报酬	-	-	-	751,410.90	751,410.90
应付托管费	-	-	-	112,711.64	112,711.64
应付交易费用	-	-	-	851,773.66	851,773.66
其他负债	-	-	-	251,291.90	251,291.90
负债总计	-	-	-	2,368,505.57	2,368,505.57
利率敏感度缺口	56,666,286.60	-	-	-834,811,799.46	891,478,086.06

注：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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金以沪深 300 指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在跟踪目标指数的同时，力争获得超越业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中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%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证及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。此外，本基金的基金

管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪与控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日		上年度末 2021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	671,728,447.62	94.09	836,930,770.71	93.88
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	671,728,447.62	94.09	836,930,770.71	93.88

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
	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(2022年6月30日)	上年度末(2021年12月31日)
分析	业绩比较基准上升 500 基点	35,877,906.43	43,997,036.34
	业绩比较基准下降 500 基点	-35,877,906.43	-43,997,036.34

#### 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	668,689,969.59	829,144,978.59
第二层次	-	3,598,554.07
第三层次	3,038,478.03	4,187,238.05
合计	671,728,447.62	836,930,770.71

##### 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股票和债券，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股票和债券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，确定相关股票、债券和基金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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	671,728,447.62	93.87
	其中：股票	671,728,447.62	93.87
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	43,562,487.14	6.09
8	其他各项资产	303,829.31	0.04
9	合计	715,594,764.07	100.00

## 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

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	4,155,253.87	0.58
B	采矿业	16,279,638.36	2.28
C	制造业	370,015,557.38	51.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,053,552.00	1.97
E	建筑业	7,216,097.00	1.01
F	批发和零售业	4,398,584.00	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	13,052,538.00	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,267,623.07	2.28
J	金融业	162,506,440.50	22.76
K	房地产业	28,947,696.80	4.05
L	租赁和商务服务业	11,816,387.00	1.66
M	科学研究和技术服务业	19,848,059.26	2.78
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	2,678,808.00	0.38

	业		
S	综合	-	-
	合计	671,236,235.24	94.02

### 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

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	-	-
C	制造业	357,519.53	0.05
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	38,048.98	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	23,441.56	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	37,008.39	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	16,234.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	492,212.38	0.07

### 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：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	24,551	50,206,795.00	7.03
2	600036	招商银行	640,371	27,023,656.20	3.79
3	601318	中国平安	406,803	18,993,632.07	2.66

4	000858	五粮液	93,728	18,926,495.04	2.65
5	601012	隆基绿能	246,029	16,392,912.27	2.30
6	300750	宁德时代	29,900	15,966,600.00	2.24
7	603259	药明康德	150,274	15,626,993.26	2.19
8	601166	兴业银行	733,523	14,597,107.70	2.04
9	000333	美的集团	215,872	13,036,510.08	1.83
10	300059	东方财富	474,521	12,052,833.40	1.69
11	600048	保利发展	682,630	11,918,719.80	1.67
12	600887	伊利股份	289,616	11,280,543.20	1.58
13	600030	中信证券	517,128	11,200,992.48	1.57
14	002142	宁波银行	281,091	10,065,868.71	1.41
15	601398	工商银行	1,939,819	9,252,936.63	1.30
16	000568	泸州老窖	37,500	9,245,250.00	1.29
17	300122	智飞生物	82,200	9,125,022.00	1.28
18	601899	紫金矿业	897,892	8,377,332.36	1.17
19	000001	平安银行	543,759	8,145,509.82	1.14
20	600309	万华化学	80,840	7,840,671.60	1.10
21	600958	东方证券	763,208	7,792,353.68	1.09
22	002594	比亚迪	23,163	7,724,628.87	1.08
23	001979	招商蛇口	551,900	7,412,017.00	1.04
24	600031	三一重工	386,300	7,362,878.00	1.03
25	002129	TCL 中环	123,000	7,243,470.00	1.01
26	002709	天赐材料	115,600	7,174,136.00	1.00
27	002415	海康威视	185,800	6,725,960.00	0.94
28	600585	海螺水泥	187,000	6,597,360.00	0.92
29	600383	金地集团	471,500	6,336,960.00	0.89
30	600926	杭州银行	422,000	6,321,560.00	0.89
31	600690	海尔智家	227,324	6,242,317.04	0.87
32	601009	南京银行	592,064	6,169,306.88	0.86
33	601919	中远海控	436,700	6,070,130.00	0.85
34	601888	中国中免	26,000	6,056,180.00	0.85
35	600900	长江电力	261,000	6,034,320.00	0.85
36	002179	中航光电	93,086	5,894,205.52	0.83
37	000776	广发证券	315,111	5,892,575.70	0.83
38	300124	汇川技术	89,200	5,875,604.00	0.82
39	002027	分众传媒	855,900	5,760,207.00	0.81
40	600176	中国巨石	316,683	5,513,451.03	0.77
41	300760	迈瑞医疗	17,500	5,481,000.00	0.77
42	002271	东方雨虹	99,424	5,117,353.28	0.72
43	300316	晶盛机电	68,121	4,604,298.39	0.64
44	600426	华鲁恒升	157,420	4,596,664.00	0.64
45	601088	中国神华	136,500	4,545,450.00	0.64



46	600111	北方稀土	128,700	4,525,092.00	0.63
47	601658	邮储银行	835,100	4,501,189.00	0.63
48	000963	华东医药	97,400	4,398,584.00	0.62
49	601688	华泰证券	300,500	4,267,100.00	0.60
50	601601	中国太保	180,200	4,240,106.00	0.59
51	002049	紫光国微	22,200	4,211,784.00	0.59
52	600660	福耀玻璃	100,666	4,208,845.46	0.59
53	600196	复星医药	94,500	4,166,505.00	0.58
54	002714	牧原股份	75,181	4,155,253.87	0.58
55	600406	国电南瑞	150,000	4,050,000.00	0.57
56	603501	韦尔股份	22,800	3,945,084.00	0.55
57	600010	包钢股份	1,654,100	3,887,135.00	0.54
58	002812	恩捷股份	15,500	3,881,975.00	0.54
59	600104	上汽集团	213,161	3,796,397.41	0.53
60	600941	中国移动	62,401	3,764,777.06	0.53
61	002352	顺丰控股	66,100	3,689,041.00	0.52
62	002460	赣锋锂业	24,800	3,687,760.00	0.52
63	600019	宝钢股份	612,100	3,684,842.00	0.52
64	601985	中国核电	529,700	3,633,742.00	0.51
65	000977	浪潮信息	136,300	3,609,224.00	0.51
66	601838	成都银行	213,200	3,534,856.00	0.50
67	000786	北新建材	99,200	3,434,304.00	0.48
68	300601	康泰生物	76,002	3,433,770.36	0.48
69	600905	三峡能源	545,000	3,428,050.00	0.48
70	600018	上港集团	564,900	3,293,367.00	0.46
71	000002	万 科 A	160,000	3,280,000.00	0.46
72	002475	立讯精密	94,191	3,182,713.89	0.45
73	300347	泰格医药	25,400	2,907,030.00	0.41
74	601618	中国中冶	830,300	2,906,050.00	0.41
75	000063	中兴通讯	112,400	2,869,572.00	0.40
76	002493	荣盛石化	183,550	2,824,834.50	0.40
77	002050	三花智控	99,700	2,739,756.00	0.38
78	300413	芒果超媒	80,300	2,678,808.00	0.38
79	600438	通威股份	44,500	2,663,770.00	0.37
80	002241	歌尔股份	77,329	2,598,254.40	0.36
81	000157	中联重科	420,700	2,591,512.00	0.36
82	002601	龙佰集团	129,000	2,586,450.00	0.36
83	601668	中国建筑	467,400	2,486,568.00	0.35
84	603986	兆易创新	17,400	2,474,454.00	0.35
85	600745	闻泰科技	28,100	2,391,591.00	0.33
86	300595	欧普康视	41,300	2,361,947.00	0.33
87	300896	爱美客	3,900	2,340,039.00	0.33

88	601225	陕西煤业	110,400	2,338,272.00	0.33
89	601238	广汽集团	153,400	2,337,816.00	0.33
90	600845	宝信软件	41,610	2,271,906.00	0.32
91	603833	欧派家居	14,400	2,169,792.00	0.30
92	600570	恒生电子	49,737	2,165,548.98	0.30
93	600999	招商证券	140,583	2,025,801.03	0.28
94	601336	新华保险	62,280	2,004,793.20	0.28
95	601100	恒立液压	32,427	2,001,394.44	0.28
96	600741	华域汽车	86,464	1,988,672.00	0.28
97	601628	中国人寿	63,200	1,964,256.00	0.28
98	600600	青岛啤酒	18,100	1,880,952.00	0.26
99	002311	海大集团	31,200	1,872,312.00	0.26
100	000338	潍柴动力	146,800	1,830,596.00	0.26
101	601669	中国电建	231,700	1,823,479.00	0.26
102	002821	凯莱英	5,800	1,676,200.00	0.23
103	300450	先导智能	25,300	1,598,454.00	0.22
104	601377	兴业证券	220,200	1,552,410.00	0.22
105	002008	大族激光	45,700	1,514,041.00	0.21
106	000301	东方盛虹	88,700	1,499,917.00	0.21
107	601728	中国电信	394,011	1,469,661.03	0.21
108	002938	鹏鼎控股	47,900	1,447,059.00	0.20
109	000661	长春高新	6,100	1,423,862.00	0.20
110	600584	长电科技	52,200	1,409,400.00	0.20
111	603185	上机数控	8,960	1,397,670.40	0.20
112	603486	科沃斯	11,400	1,389,546.00	0.19
113	002230	科大讯飞	33,100	1,364,382.00	0.19
114	603392	万泰生物	8,700	1,351,110.00	0.19
115	300759	康龙化成	13,800	1,314,036.00	0.18
116	600089	特变电工	44,700	1,224,333.00	0.17
117	002410	广联达	21,700	1,181,348.00	0.17
118	603369	今世缘	23,100	1,178,100.00	0.17
119	300919	中伟股份	9,500	1,177,050.00	0.16
120	600132	重庆啤酒	7,920	1,161,072.00	0.16
121	300223	北京君正	10,900	1,158,125.00	0.16
122	000768	中航西飞	37,500	1,135,875.00	0.16
123	300142	沃森生物	23,400	1,132,326.00	0.16
124	300957	贝泰妮	5,200	1,131,156.00	0.16
125	002920	德赛西威	7,600	1,124,800.00	0.16
126	600760	中航沈飞	18,400	1,112,280.00	0.16
127	000408	藏格矿业	33,700	1,110,078.00	0.16
128	603659	璞泰来	13,000	1,097,200.00	0.15
129	300408	三环集团	35,900	1,080,590.00	0.15

130	601877	正泰电器	29,500	1,055,510.00	0.15
131	002371	北方华创	3,700	1,025,344.00	0.14
132	600188	兖矿能源	25,800	1,018,584.00	0.14
133	600183	生益科技	59,900	1,017,701.00	0.14
134	000792	盐湖股份	32,500	973,700.00	0.14
135	001289	龙源电力	44,000	957,440.00	0.13
136	601995	中金公司	20,400	907,596.00	0.13
137	300782	卓胜微	5,440	734,400.00	0.10
138	603806	福斯特	10,360	678,787.20	0.10
139	002916	深南电路	6,900	646,599.00	0.09

### 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688175	高凌信息	2,851	91,887.73	0.01
2	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
3	301236	软通动力	956	29,999.28	0.00
4	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
5	301216	万凯新材	779	23,245.36	0.00
6	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
7	301207	华兰疫苗	377	21,270.34	0.00
8	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
9	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.00
10	301219	腾远钴业	216	18,969.12	0.00
11	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
12	301109	军信股份	1,131	18,254.34	0.00
13	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
14	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
15	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
16	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
17	300834	星辉环材	491	14,744.73	0.00
18	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
19	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
20	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
21	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
22	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
23	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
24	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00

### 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	600036	招商银行	9,360,528.00	1.05
2	600383	金地集团	7,943,422.00	0.89
3	601166	兴业银行	7,266,328.00	0.82
4	603259	药明康德	6,733,336.84	0.76
5	000002	万科 A	5,985,907.00	0.67
6	300122	智飞生物	5,377,612.00	0.60
7	002709	天赐材料	5,254,498.00	0.59
8	300750	宁德时代	4,784,419.00	0.54
9	601318	中国平安	4,776,915.00	0.54
10	001979	招商蛇口	4,720,319.00	0.53
11	601985	中国核电	4,527,938.00	0.51
12	601012	隆基绿能	4,136,827.00	0.46
13	300316	晶盛机电	3,850,398.84	0.43
14	002142	宁波银行	3,601,826.00	0.40
15	600048	保利发展	3,176,989.00	0.36
16	600010	包钢股份	3,065,069.00	0.34
17	601398	工商银行	3,025,335.00	0.34
18	600958	东方证券	2,817,151.68	0.32
19	600905	三峡能源	2,625,819.00	0.29
20	300059	东方财富	2,525,664.60	0.28

注：“买入金额”按成交金额（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	000002	万科 A	11,199,288.26	1.26
2	300750	宁德时代	8,546,172.00	0.96
3	002202	金风科技	6,330,195.00	0.71
4	000725	京东方 A	6,128,384.00	0.69
5	601012	隆基绿能	5,997,703.04	0.67
6	601318	中国平安	5,726,044.00	0.64
7	601166	兴业银行	4,752,283.00	0.53
8	600036	招商银行	4,454,216.00	0.50
9	300122	智飞生物	3,953,876.00	0.44
10	002129	TCL 中环	3,875,394.04	0.43
11	000333	美的集团	3,690,899.00	0.41
12	300274	阳光电源	3,653,583.00	0.41
13	000100	TCL 科技	3,591,112.00	0.40
14	300014	亿纬锂能	3,576,444.00	0.40
15	002049	紫光国微	3,396,593.00	0.38
16	600406	国电南瑞	3,368,632.53	0.38

17	300059	东方财富	3,263,648.20	0.37
18	002142	宁波银行	3,153,510.40	0.35
19	601799	星宇股份	3,008,274.00	0.34
20	600795	国电电力	2,966,427.00	0.33

注：“卖出金额”按成交金额（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	178,269,154.03
卖出股票收入（成交）总额	244,574,163.04

注：“买入股票的成本”“卖出股票的收入”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：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末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：本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 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：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受

到中国人民银行、中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

### 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	128,491.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	175,337.99
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	303,829.31

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末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。

#### 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	688175	高凌信息	91,887.73	0.01	新股锁定
2	301236	软通动力	29,999.28	0.00	新股锁定
3	301201	诚达药业	25,253.62	0.00	新股锁定
4	301216	万凯新材	23,245.36	0.00	新股锁定

## § 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 (%)
52,003	10,299.92	386,874,864.25	72.23	148,751,761.11	27.77

## 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	1,504,359.10	0.28

## 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	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	50~100

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2010 年 12 月 10 日) 基金份额总额	815,083,164.39
本报告期期初基金份额总额	581,888,465.24
本报告期基金总申购份额	93,125,294.41
减：本报告期基金总赎回份额	139,387,134.29
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	535,626,625.36

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 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

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2022 年 2 月 19 日，本基金管理人发布了《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》，经本基金管理人董事会审议通过，聘任陈阳先生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未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

### 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，管理人、托管人及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

### 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 (%)	
东吴证券	1	183,313,288.10	44.48	170,719.73	44.48	-
太平洋证券	1	112,870,405.56	27.39	105,116.20	27.39	-
国泰君安	1	84,734,958.37	20.56	78,913.37	20.56	-
申万宏源	2	31,187,489.92	7.57	29,044.60	7.57	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-



国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

### 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 (%)
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

海通证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

## 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	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定网站	2022 年 1 月 24 日
2	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2021 年年度报告	规定网站	2022 年 3 月 31 日
3	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年度分红公告	报刊及规定网站	2022 年 4 月 13 日
4	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 4 月 13 日
5	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定网站	2022 年 4 月 22 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	20220101-20220630	126,504,606.97	6,190,455.24	0.00	132,695,062.21	24.77
产品特有风险							
<p>基金管理人提示投资者注意：当特定的机构投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。</p>							

### 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、中国证监会批准浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日