

# 浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资 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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

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。

基金托管人中国邮政储蓄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	11
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	12
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	13
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	13
<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	15
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>43</b>
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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.....	55
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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	56
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.....	56
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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.....	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	58
10.8 其他重大事件.....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</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 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
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	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金
基金简称	浦银安盛基本面 400 指数
基金主代码	519117
前端交易代码	519117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 14 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,244,063.69 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采取指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理手段，追求对标的指数的有效跟踪。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%，且年化跟踪误差不超过 4%，以实现业绩比较基准的有效跟踪。
投资策略	本基金采取完全复制方法进行指数化投资，依据中证锐联基本面 400 指数成份股及其权重配比，合理设置个股投资权重，构建股票组合，使股票组合能有效跟踪中证锐联基本面 400 指数的表现，力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%，且年化跟踪误差不超过 4%。
业绩比较基准	中证锐联基本面 400 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种

### 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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛香	田东辉
	联系电话	021-23212888	010-68858113
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tia donghui@psbc.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95580
传真		021-23212985	010-68858120
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 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7	北京市西城区金融大街 3 号

	层	
办公地址	上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	200020	100808
法定代表人	谢伟	刘建军

## 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	771,426.21
本期利润	-1,846,542.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1388
本期加权平均净值利润率	-7.70%
本期基金份额净值增长率	-7.04%
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	8,222,189.80
期末可供分配基金份额利润	0.6208
期末基金资产净值	24,490,111.21
期末基金份额净值	1.849
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	84.90%

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。

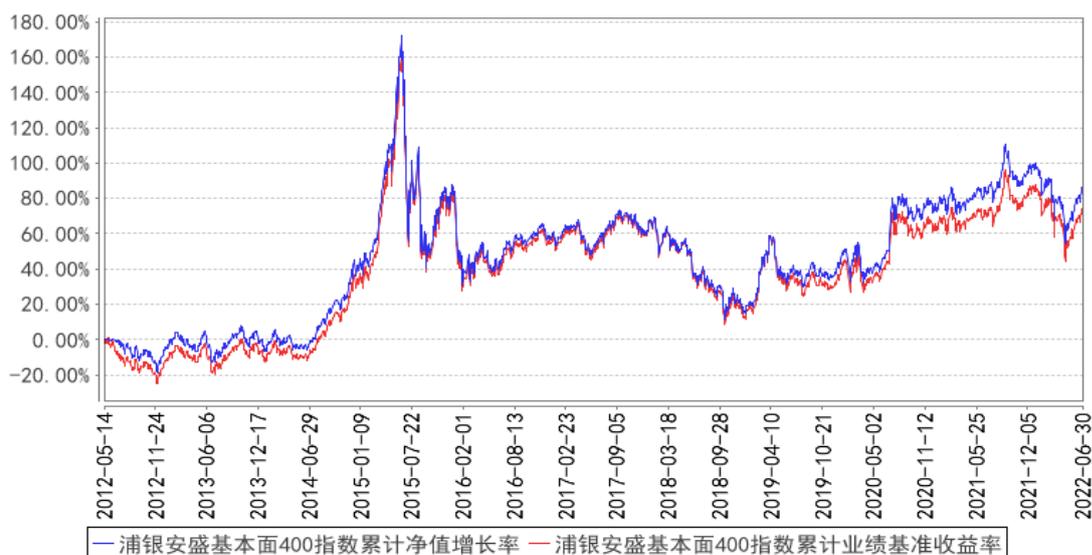
### 3.2 基金净值表现

#### 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	5.78%	0.93%	5.33%	0.95%	0.45%	-0.02%
过去三个月	3.01%	1.54%	2.00%	1.59%	1.01%	-0.05%
过去六个月	-7.04%	1.49%	-7.27%	1.53%	0.23%	-0.04%
过去一年	-0.38%	1.25%	0.08%	1.28%	-0.46%	-0.03%
过去三年	33.60%	1.23%	28.57%	1.26%	5.03%	-0.03%
自基金合同生效起至今	84.90%	1.51%	72.78%	1.54%	12.12%	-0.03%

#### 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

浦银安盛基本面400指数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



## § 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



金、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		
陈士俊	公司指数及量化投资部总监，公司职工监事，公司旗下部分基金基金经理。	2012年5月14日	-	21年	陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001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

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	---

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；另一方面是公司对于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。中证锐联基本面 400 指数成份股以中小盘优质成长股为主，上半年下跌 7.72%。

本报告期内，本基金采取完全复制指数方法，密切跟踪标的指数的表现，组合表现与业绩比较基准基本一致。

#### 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基本面 400 指数基金份额净值为 1.849 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.04%；同期业绩比较基准收益率为-7.27%。

### 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。在国内相对宽松的流动性环境下，估值合理、业绩稳健成长的中小盘优质上市公司股票具有良好的投资价值。

#### 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，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配收益的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，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、本报告期内超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万，本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

## § 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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（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：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

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	2,127,352.47	1,796,780.11
结算备付金		-	-
存出保证金		54.68	801.84
交易性金融资产	6.4.7.2	22,521,211.47	24,668,895.78
其中：股票投资		22,521,211.47	24,668,895.78
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		2,916.33	32,082.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	361.78
资产总计		24,651,534.95	26,498,922.32
<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		-	-
应付赎回款		26,340.25	30,814.78
应付管理人报酬		19,662.26	22,129.34
应付托管费		2,949.34	3,319.39
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	112,471.89	116,544.26
负债合计		161,423.74	172,807.77
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	13,244,063.69	13,238,673.75
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	11,246,047.52	13,087,440.80
净资产合计		24,490,111.21	26,326,114.55
负债和净资产总计		24,651,534.95	26,498,922.32

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.849 元，基金份额总额 13,244,063.69。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

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>		-1,634,557.67	1,690,917.58
1. 利息收入		6,964.49	7,558.20
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,964.49	7,558.20
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		975,808.47	2,792,666.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	642,910.16	2,531,460.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
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	332,898.31	261,206.08
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	-2,617,968.97	-1,110,566.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	638.34	1,259.75
<b>减：二、营业总支出</b>		211,985.09	281,401.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	118,894.77	132,625.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	17,834.23	19,893.96
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	75,256.09	128,881.14
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-1,846,542.76	1,409,516.52

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,846,542.76	1,409,516.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,846,542.76	1,409,516.52

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

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)	13,238,673.75	-	13,087,440.80	26,326,114.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	13,238,673.75	-	13,087,440.80	26,326,114.55
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,389.94	-	-1,841,393.28	-1,836,003.34
(一)、综合收益总额	-	-	-1,846,542.76	-1,846,542.76
(二)、本期基金份额交易产生的基	5,389.94	-	5,149.48	10,539.42

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	617,368.10	-	493,434.83	1,110,802.93
2. 基金赎回款	-611,978.16	-	-488,285.35	-1,100,263.51
(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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	13,244,063.69	-	11,246,047.52	24,490,111.21
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)	17,265,170.27	-	13,178,550.36	30,443,720.63
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)	17,265,170.27	-	13,178,550.36	30,443,720.63
三、本 期 增 减 变 动 额 ( 减 少 以 “-” 号 填 列)	-3,399,379.25	-	-1,306,319.52	-4,705,698.77
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	1,409,516.52	1,409,516.52
(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)	-3,399,379.25	-	-2,715,836.04	-6,115,215.29
其中: 1. 基 金 申 购 款	407,062.98	-	321,711.79	728,774.77
2. 基 金 赎 回 款	-3,806,442.23	-	-3,037,547.83	-6,843,990.06
(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)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	13,865,791.02	-	11,872,230.84	25,738,021.86

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：

<u>郁蓓华</u>	<u>郁蓓华</u>	<u>钱琨</u>
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

浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(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]2033 号文《关于核准浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金募集的批复》的核准,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《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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 413,196,469.55 元,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2012)验字第 60951783\_B01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 413,537,496.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 341,026.61 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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同》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(含存托凭证)占基金资产的比例不低于 90%-95%,投资于中证锐联基本面 400 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 90%,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%,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。本基金力争

控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%，且年化跟踪误差不超过 4%，以实现对业绩比较基准的有效跟踪。本基金业绩比较基准为中证锐联基本面 400 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 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》、《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2022 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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。

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、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 1,796,780.11 元、801.84 元、361.78 元和 32,082.81 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、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 1,797,141.49 元、802.24 元、0.00 元和 32,082.81 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 24,668,895.78 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 24,668,895.78 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 30,814.78 元、22,129.34 元、3,319.39 元、63.16 元和 6,481.10 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 30,814.78 元、22,129.34 元、3,319.39 元、63.16 元和 6,481.10 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 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	2,127,352.47
等于：本金	2,126,971.47
加：应计利息	381.00
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	2,127,352.47

#### 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	21,177,961.10	-	22,521,211.47	1,343,250.37
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	21,177,961.10	-	22,521,211.47	1,343,250.37

#### 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：本基金在本报告期末未持有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：本基金本报告期末不存在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：本基金本报告期期末不存在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：本基金本报告期不存在其他权益工具投资情况。

##### 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：本基金本报告期内未持有其他资产。

#### 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	0.96
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	10,745.70
其中：交易所市场	10,745.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,835.79
应付指数使用费	11,889.44
合计	112,471.89

#### 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	13,238,673.75	13,238,673.75
本期申购	617,368.10	617,368.10
本期赎回（以“-”号填列）	-611,978.16	-611,978.16
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	13,244,063.69	13,244,063.69

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末不存在其他综合收益。

#### 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	7,453,392.60	5,634,048.20	13,087,440.80
本期利润	771,426.21	-2,617,968.97	-1,846,542.76
本期基金份额交易产生的变动数	-2,629.01	7,778.49	5,149.48
其中：基金申购款	348,660.27	144,774.56	493,434.83
基金赎回款	-351,289.28	-136,996.07	-488,285.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,222,189.80	3,023,857.72	11,246,047.52

#### 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	6,961.08
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	-
其他	3.41
合计	6,964.49

#### 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	642,910.16
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	642,910.16

#### 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	5,902,967.23
减：卖出股票成本总额	5,242,438.33
减：交易费用	17,618.74
买卖股票差价收入	642,910.16

#### 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：本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——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：本基金本报告期内无贵金属投资收益——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：本基金本报告期内无贵金属投资收益——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	332,898.31
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	332,898.31

**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	-2,617,968.97
股票投资	-2,617,968.97
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	-2,617,968.97

#### 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	638.10
基金转换费收入	0.24
合计	638.34

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	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	55,420.30
合计	75,256.09

#### 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

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要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

中国邮政储蓄银行股份有限公司(“中国邮储银行”)	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

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	118,894.77	132,625.96
其中：支付销售机构的客户维护费	48,033.14	52,943.48

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

###### 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	17,834.23	19,893.96

注：支付基金托管人中国邮储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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
中国邮储银行	2,127,352.47	6,961.08	2,220,317.92	7,527.21

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮储银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期末进行利润分配。

#### 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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末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

注：本基金本期末未持有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：本基金本报告期末无从事银行间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

本基金本报告期末无从事交易所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

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，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，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

本基金的投资对象是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(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券、货币市场工具、权证、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)。

其中，股票资产(含存托凭证，下同)占基金资产的比例为 90%-95%，投资于中证锐联基本面 400 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证及其它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，设立了三层次的风险控制体系：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邮储银行，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，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，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及存出保证金等。

##### 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	2,127,352.47	-	-	-	2,127,352.47
存出保证金	54.68	-	-	-	54.68
交易性金融资产	-	-	-	22,521,211.47	22,521,211.47
应收申购款	-	-	-	2,916.33	2,916.33
资产总计	2,127,407.15	-	-	22,524,127.80	24,651,534.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	26,340.25	26,340.25
应付管理人报酬	-	-	-	19,662.26	19,662.26
应付托管费	-	-	-	2,949.34	2,949.34

其他负债	-	-	-	112,471.89	112,471.89
负债总计	-	-	-	161,423.74	161,423.74
利率敏感度缺口	2,127,407.15	-	-	22,362,704.06	24,490,111.21
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	1,796,780.11	-	-	-	1,796,780.11
存出保证金	801.84	-	-	-	801.84
交易性金融资产	-	-	-	24,668,895.78	24,668,895.78
应收利息	-	-	-	361.78	361.78
应收申购款	-	-	-	32,082.81	32,082.81
资产总计	1,797,581.95	-	-	24,701,340.37	26,498,922.32
负债					
应付赎回款	-	-	-	30,814.78	30,814.78
应付管理人报酬	-	-	-	22,129.34	22,129.34
应付托管费	-	-	-	3,319.39	3,319.39
应付交易费用	-	-	-	63.16	63.16
其他负债	-	-	-	116,481.10	116,481.10
负债总计	-	-	-	172,807.77	172,807.77
利率敏感度缺口	1,797,581.95	-	-	24,528,532.60	26,326,114.55

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投资（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依法发行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。

本基金以紧密采取完全复制方法进行指数化投资，依据中证锐联基本面 400 指数成份股及其权重配比，合理设置个股投资权重，构建股票组合，使股票组合能有效跟踪标中证锐联基本面 400 指数的指数，获取指数长期增长的稳定收益表现。为宗旨，在降低有效地控制基金的跟踪误差和

控制流动性，本基金采用公司自有的风险的条件下，构建指数化的投资组合。

本基金预算模型，根据基金投资组合相对业绩比较基准的资产配置暴露度、行业配置暴露度和个股投资比例暴露度，计算跟踪误差的预估值，对基金的跟踪误差进行估计和控制，预先防范基金收益表现偏离业绩比较基准过大的风险。同时，本基金还将密切跟踪基金的实际跟踪误差，及时分析跟踪误差的来源，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于中证锐联基本面 400 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证及其它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，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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	22,521,211.47	91.96	24,668,895.78	93.71
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	22,521,211.47	91.96	24,668,895.78	93.71

#### 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	1,182,541.74	1,191,973.04

	500 基点		
	业绩比较基准下降 500 基点	-1,182,541.74	-1,191,973.04

#### 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	22,521,211.47	24,666,912.18
第二层次	-	1,983.60
第三层次	-	-
合计	22,521,211.47	24,668,895.78

###### 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

无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 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	22,521,211.47	91.36
	其中：股票	22,521,211.47	91.36
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	2,127,352.47	8.63
8	其他各项资产	2,971.01	0.01
9	合计	24,651,534.95	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	154,868.12	0.63
B	采矿业	1,265,074.96	5.17
C	制造业	12,379,737.20	50.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,010,937.34	4.13
E	建筑业	865,897.57	3.54
F	批发和零售业	1,675,432.20	6.84
G	交通运输、仓储和邮政业	849,147.70	3.47
H	住宿和餐饮业	56,610.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术服务业	530,997.60	2.17

J	金融业	2,219,807.68	9.06
K	房地产业	723,963.68	2.96
L	租赁和商务服务业	271,344.90	1.11
M	科学研究和技术服务业	120,212.44	0.49
N	水利、环境和公共设施管理业	90,100.38	0.37
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,002.00	0.09
Q	卫生和社会工作	56,634.05	0.23
R	文化、体育和娱乐业	228,443.65	0.93
S	综合	-	-
	合计	22,521,211.47	91.96

### 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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：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	601377	兴业证券	24,600	173,430.00	0.71
2	002202	金风科技	11,700	173,160.00	0.71
3	600352	浙江龙盛	14,800	150,664.00	0.62
4	600839	四川长虹	51,000	146,880.00	0.60
5	600522	中天科技	6,268	144,790.80	0.59
6	600157	永泰能源	89,400	142,146.00	0.58
7	600820	隧道股份	23,200	141,984.00	0.58
8	600418	江淮汽车	7,900	135,564.00	0.55
9	000039	中集集团	9,640	133,514.00	0.55
10	002271	东方雨虹	2,475	127,388.25	0.52
11	300059	东方财富	4,977	126,415.80	0.52
12	603259	药明康德	1,156	120,212.44	0.49
13	600196	复星医药	2,700	119,043.00	0.49
14	002129	TCL 中环	2,000	117,780.00	0.48
15	000878	云南铜业	10,100	115,039.00	0.47
16	600873	梅花生物	10,176	114,785.28	0.47

17	601128	常熟银行	14,900	113,836.00	0.46
18	000778	新兴铸管	23,500	113,270.00	0.46
19	000034	神州数码	7,400	112,628.00	0.46
20	002001	新和成	4,932	112,498.92	0.46
21	601788	光大证券	7,000	110,320.00	0.45
22	600487	亨通光电	7,500	109,050.00	0.45
23	600348	华阳股份	7,000	108,220.00	0.44
24	600096	云天化	3,400	107,032.00	0.44
25	300226	上海钢联	4,688	106,183.20	0.43
26	002241	歌尔股份	3,148	105,772.80	0.43
27	600703	三安光电	4,300	105,694.00	0.43
28	600332	白云山	3,300	104,247.00	0.43
29	600143	金发科技	10,900	103,768.00	0.42
30	000906	浙商中拓	11,400	103,512.00	0.42
31	600584	长电科技	3,800	102,600.00	0.42
32	600745	闻泰科技	1,200	102,132.00	0.42
33	601555	东吴证券	14,671	101,670.03	0.42
34	000938	紫光股份	5,225	101,365.00	0.41
35	002958	青农商行	30,300	100,596.00	0.41
36	600176	中国巨石	5,746	100,037.86	0.41
37	600637	东方明珠	13,900	99,385.00	0.41
38	600426	华鲁恒升	3,385	98,842.00	0.40
39	000783	长江证券	16,600	98,438.00	0.40
40	600699	均胜电子	6,260	98,344.60	0.40
41	600390	五矿资本	20,000	97,800.00	0.40
42	002416	爱施德	10,500	97,650.00	0.40
43	600009	上海机场	1,700	96,390.00	0.39
44	600801	华新水泥	4,887	95,345.37	0.39
45	000786	北新建材	2,734	94,651.08	0.39
46	600500	中化国际	14,200	94,430.00	0.39
47	600489	中金黄金	12,700	93,853.00	0.38
48	002236	大华股份	5,550	91,131.00	0.37
49	600502	安徽建工	12,600	90,720.00	0.37
50	600256	广汇能源	8,578	90,412.12	0.37
51	600516	方大炭素	11,892	90,379.20	0.37
52	000977	浪潮信息	3,400	90,032.00	0.37
53	002384	东山精密	3,900	89,427.00	0.37
54	000963	华东医药	1,952	88,152.32	0.36
55	603799	华友钴业	910	87,014.20	0.36
56	000983	山西焦煤	6,470	86,633.30	0.35
57	002221	东华能源	9,300	86,583.00	0.35
58	002311	海大集团	1,429	85,754.29	0.35

59	000830	鲁西化工	4,923	85,118.67	0.35
60	002299	圣农发展	4,400	84,392.00	0.34
61	688981	中芯国际	1,862	84,106.54	0.34
62	601636	旗滨集团	6,500	82,875.00	0.34
63	002385	大北农	10,600	82,786.00	0.34
64	002078	太阳纸业	6,665	82,046.15	0.34
65	600893	航发动力	1,800	81,918.00	0.33
66	600547	山东黄金	4,400	81,664.00	0.33
67	601168	西部矿业	6,800	80,444.00	0.33
68	000027	深圳能源	12,500	80,125.00	0.33
69	600271	航天信息	7,300	79,862.00	0.33
70	002233	塔牌集团	9,021	79,835.85	0.33
71	600546	山煤国际	4,100	79,786.00	0.33
72	300058	蓝色光标	12,200	79,666.00	0.33
73	603858	步长制药	4,000	78,840.00	0.32
74	000050	深天马 A	7,900	78,763.00	0.32
75	601108	财通证券	10,000	78,700.00	0.32
76	600567	山鹰国际	28,387	78,631.99	0.32
77	000060	中金岭南	17,480	77,960.80	0.32
78	002183	怡亚通	10,790	77,795.90	0.32
79	601615	明阳智能	2,300	77,740.00	0.32
80	300122	智飞生物	700	77,707.00	0.32
81	600507	方大特钢	11,100	77,589.00	0.32
82	600674	川投能源	6,500	77,480.00	0.32
83	000488	晨鸣纸业	13,700	77,268.00	0.32
84	000581	威孚高科	3,991	76,826.75	0.31
85	600039	四川路桥	7,292	76,784.76	0.31
86	600008	首创环保	26,388	76,525.20	0.31
87	600739	辽宁成大	5,233	76,297.14	0.31
88	002244	滨江集团	8,700	75,255.00	0.31
89	600060	海信视像	6,000	75,000.00	0.31
90	000728	国元证券	12,045	74,919.90	0.31
91	002340	格林美	8,200	74,620.00	0.30
92	300677	英科医疗	2,940	74,558.40	0.30
93	600208	新潮中宝	26,800	73,968.00	0.30
94	000829	天音控股	6,200	73,842.00	0.30
95	000951	中国重汽	5,660	73,523.40	0.30
96	600141	兴发集团	1,670	73,463.30	0.30
97	000960	锡业股份	4,318	72,412.86	0.30
98	600266	城建发展	17,496	71,383.68	0.29
99	002422	科伦药业	3,814	71,321.80	0.29
100	000701	厦门信达	11,400	71,250.00	0.29

101	000090	天健集团	10,300	70,967.00	0.29
102	600497	驰宏锌锗	13,626	70,718.94	0.29
103	002456	欧菲光	10,500	70,455.00	0.29
104	600409	三友化工	8,570	70,188.30	0.29
105	000661	长春高新	300	70,026.00	0.29
106	600061	国投资本	10,996	69,934.56	0.29
107	600859	王府井	2,689	69,860.22	0.29
108	600711	盛屯矿业	9,000	69,840.00	0.29
109	000690	宝新能源	15,904	69,659.52	0.28
110	002120	韵达股份	4,080	69,604.80	0.28
111	002203	海亮股份	6,000	69,300.00	0.28
112	300124	汇川技术	1,048	69,031.76	0.28
113	600398	海澜之家	14,500	68,875.00	0.28
114	600021	上海电力	6,700	68,675.00	0.28
115	000059	华锦股份	11,600	68,672.00	0.28
116	002050	三花智控	2,498	68,645.04	0.28
117	002091	江苏国泰	6,300	67,725.00	0.28
118	603156	养元饮品	2,980	67,705.60	0.28
119	600528	中铁工业	8,400	67,620.00	0.28
120	002061	浙江交科	9,700	67,512.00	0.28
121	600827	百联股份	5,100	67,371.00	0.28
122	000623	吉林敖东	4,538	66,980.88	0.27
123	002004	华邦健康	11,900	66,402.00	0.27
124	002555	三七互娱	3,100	65,813.00	0.27
125	002008	大族激光	1,980	65,597.40	0.27
126	002966	苏州银行	10,740	65,514.00	0.27
127	600233	圆通速递	3,200	65,248.00	0.27
128	600535	天士力	6,167	64,815.17	0.26
129	600056	中国医药	4,355	64,541.10	0.26
130	600482	中国动力	4,100	64,411.00	0.26
131	601677	明泰铝业	2,700	64,260.00	0.26
132	000016	深康佳 A	10,500	63,525.00	0.26
133	600511	国药股份	2,370	63,468.60	0.26
134	601000	唐山港	24,574	63,400.92	0.26
135	002408	齐翔腾达	7,785	63,136.35	0.26
136	002048	宁波华翔	3,938	63,086.76	0.26
137	600970	中材国际	6,500	62,985.00	0.26
138	002602	世纪华通	12,940	62,370.80	0.25
139	600166	福田汽车	22,000	62,260.00	0.25
140	600183	生益科技	3,634	61,741.66	0.25
141	600863	内蒙华电	16,800	61,320.00	0.25
142	603225	新凤鸣	5,300	61,162.00	0.25

143	000921	海信家电	4,300	60,974.00	0.25
144	000768	中航西飞	2,010	60,882.90	0.25
145	600380	健康元	4,914	60,687.90	0.25
146	600596	新安股份	2,800	60,620.00	0.25
147	600600	青岛啤酒	580	60,273.60	0.25
148	601058	赛轮轮胎	5,345	60,238.15	0.25
149	000933	神火股份	4,600	60,168.00	0.25
150	002128	电投能源	4,200	60,144.00	0.25
151	300207	欣旺达	1,900	60,040.00	0.25
152	601333	广深铁路	27,400	59,732.00	0.24
153	002460	赣锋锂业	400	59,480.00	0.24
154	600875	东方电气	3,600	59,220.00	0.24
155	600908	无锡银行	10,500	59,115.00	0.24
156	600307	酒钢宏兴	30,400	58,976.00	0.24
157	300274	阳光电源	600	58,950.00	0.24
158	603816	顾家家居	1,040	58,895.20	0.24
159	002589	瑞康医药	15,100	58,739.00	0.24
160	603589	口子窖	1,000	58,610.00	0.24
161	000723	美锦能源	4,800	58,560.00	0.24
162	300146	汤臣倍健	2,700	58,455.00	0.24
163	601666	平煤股份	4,300	58,437.00	0.24
164	002572	索菲亚	2,100	57,750.00	0.24
165	300070	碧水源	11,078	57,716.38	0.24
166	002230	科大讯飞	1,400	57,708.00	0.24
167	002938	鹏鼎控股	1,900	57,399.00	0.23
168	000883	湖北能源	11,200	57,232.00	0.23
169	600150	中国船舶	3,000	56,940.00	0.23
170	300015	爱尔眼科	1,265	56,634.05	0.23
171	600754	锦江酒店	900	56,610.00	0.23
172	600004	白云机场	3,785	56,434.35	0.23
173	601717	郑煤机	3,915	56,415.15	0.23
174	600064	南京高科	5,105	56,155.00	0.23
175	000591	太阳能	6,700	55,945.00	0.23
176	300003	乐普医疗	3,000	55,710.00	0.23
177	000683	远兴能源	5,300	55,703.00	0.23
178	000717	韶钢松山	15,900	55,650.00	0.23
179	600973	宝胜股份	9,600	55,584.00	0.23
180	600809	山西汾酒	171	55,540.80	0.23
181	601360	三六零	6,500	55,380.00	0.23
182	600667	太极实业	7,500	55,350.00	0.23
183	688599	天合光能	848	55,332.00	0.23
184	600498	烽火通信	3,815	55,241.20	0.23

185	002508	老板电器	1,530	55,125.90	0.23
186	601901	方正证券	8,200	55,022.00	0.22
187	002075	沙钢股份	11,400	54,834.00	0.22
188	000789	万年青	5,048	54,720.32	0.22
189	601212	白银有色	19,800	54,648.00	0.22
190	000513	丽珠集团	1,507	54,568.47	0.22
191	600273	嘉化能源	5,000	54,300.00	0.22
192	002085	万丰奥威	10,100	54,237.00	0.22
193	600085	同仁堂	1,024	54,149.12	0.22
194	601860	紫金银行	18,700	53,669.00	0.22
195	600729	重庆百货	2,478	53,450.46	0.22
196	600100	同方股份	12,000	53,400.00	0.22
197	002081	金螳螂	10,467	53,172.36	0.22
198	600126	杭钢股份	10,300	52,736.00	0.22
199	600109	国金证券	5,856	52,704.00	0.22
200	601872	招商轮船	9,140	52,646.40	0.21
201	600339	中油工程	18,200	52,598.00	0.21
202	000423	东阿阿胶	1,400	51,730.00	0.21
203	600623	华谊集团	6,200	51,460.00	0.21
204	600742	一汽富维	5,524	51,262.72	0.21
205	601098	中南传媒	5,428	51,240.32	0.21
206	002673	西部证券	7,800	51,012.00	0.21
207	002745	木林森	5,200	50,804.00	0.21
208	600663	陆家嘴	4,900	50,764.00	0.21
209	601198	东兴证券	5,700	50,730.00	0.21
210	600373	中文传媒	5,047	50,419.53	0.21
211	601611	中国核建	6,000	50,340.00	0.21
212	601878	浙商证券	4,400	50,072.00	0.20
213	601001	晋控煤业	2,800	49,700.00	0.20
214	000078	海王生物	13,600	49,504.00	0.20
215	600160	巨化股份	3,763	49,483.45	0.20
216	600959	江苏有线	15,160	49,421.60	0.20
217	600111	北方稀土	1,400	49,224.00	0.20
218	601588	北辰实业	21,000	49,140.00	0.20
219	600549	厦门钨业	2,269	49,055.78	0.20
220	600918	中泰证券	6,400	48,960.00	0.20
221	601866	中远海发	16,300	48,900.00	0.20
222	000750	国海证券	13,428	48,743.64	0.20
223	600884	杉杉股份	1,640	48,740.80	0.20
224	000028	国药一致	1,634	48,676.86	0.20
225	002080	中材科技	1,768	48,620.00	0.20
226	600720	祁连山	3,900	48,360.00	0.20

227	002007	华兰生物	2,116	48,244.80	0.20
228	601966	玲珑轮胎	1,900	48,203.00	0.20
229	002926	华西证券	6,100	47,824.00	0.20
230	601718	际华集团	15,300	47,430.00	0.19
231	600308	华泰股份	8,300	47,393.00	0.19
232	601231	环旭电子	3,282	47,129.52	0.19
233	002185	华天科技	5,000	46,900.00	0.19
234	600079	XD 人福医	2,900	46,400.00	0.19
235	600058	五矿发展	4,500	46,080.00	0.19
236	600583	海油工程	11,100	46,065.00	0.19
237	600717	天津港	11,400	45,714.00	0.19
238	002600	领益智造	9,100	45,682.00	0.19
239	000807	云铝股份	4,622	45,665.36	0.19
240	000031	大悦城	11,372	45,488.00	0.19
241	600578	京能电力	14,500	45,385.00	0.19
242	300408	三环集团	1,500	45,150.00	0.18
243	600369	西南证券	11,366	45,123.02	0.18
244	600335	国机汽车	4,500	45,045.00	0.18
245	600491	龙元建设	6,600	45,012.00	0.18
246	000999	华润三九	998	44,910.00	0.18
247	600248	陕西建工	8,200	44,526.00	0.18
248	000887	中鼎股份	2,433	44,377.92	0.18
249	600597	光明乳业	3,504	44,255.52	0.18
250	000528	柳 工	6,790	44,202.90	0.18
251	600657	信达地产	6,400	44,096.00	0.18
252	600565	迪马股份	19,000	44,080.00	0.18
253	600298	安琪酵母	900	43,875.00	0.18
254	002010	传化智联	6,800	43,724.00	0.18
255	600483	福能股份	3,100	43,617.00	0.18
256	000686	东北证券	6,236	43,589.64	0.18
257	600708	光明地产	17,600	43,472.00	0.18
258	000501	武商集团	3,900	43,290.00	0.18
259	600909	华安证券	9,500	43,225.00	0.18
260	600569	安阳钢铁	16,400	42,968.00	0.18
261	002468	申通快递	3,600	42,912.00	0.18
262	600415	小商品城	7,700	42,889.00	0.18
263	002648	卫星化学	1,659	42,885.15	0.18
264	600123	兰花科创	2,600	42,770.00	0.17
265	600787	中储股份	7,487	42,601.03	0.17
266	000937	冀中能源	5,700	42,522.00	0.17
267	600277	亿利洁能	8,500	42,500.00	0.17
268	601567	三星医疗	3,200	42,496.00	0.17

269	002157	正邦科技	7,002	42,432.12	0.17
270	002948	青岛银行	11,700	42,354.00	0.17
271	002294	信立泰	1,500	42,150.00	0.17
272	600997	开滦股份	5,500	41,910.00	0.17
273	600612	老凤祥	1,000	41,780.00	0.17
274	600582	天地科技	8,738	41,767.64	0.17
275	600713	南京医药	8,500	41,395.00	0.17
276	601609	金田股份	5,500	41,305.00	0.17
277	002440	闰土股份	5,119	41,259.14	0.17
278	601021	春秋航空	700	40,845.00	0.17
279	603369	今世缘	800	40,800.00	0.17
280	600566	济川药业	1,500	40,740.00	0.17
281	000672	上峰水泥	2,580	40,712.40	0.17
282	002180	纳思达	800	40,496.00	0.17
283	000718	苏宁环球	11,000	40,480.00	0.17
284	000598	兴蓉环境	7,817	39,944.87	0.16
285	000685	中山公用	5,200	39,936.00	0.16
286	601963	重庆银行	5,000	39,700.00	0.16
287	000498	山东路桥	4,100	39,606.00	0.16
288	000987	越秀金控	5,629	39,571.87	0.16
289	600038	中直股份	864	39,052.80	0.16
290	002500	山西证券	6,803	39,049.22	0.16
291	300014	亿纬锂能	400	39,000.00	0.16
292	000301	东方盛虹	2,300	38,893.00	0.16
293	000156	华数传媒	4,800	38,256.00	0.16
294	000950	重药控股	7,600	38,000.00	0.16
295	002841	视源股份	500	37,660.00	0.15
296	000975	银泰黄金	3,840	37,401.60	0.15
297	002563	森马服饰	6,300	37,296.00	0.15
298	002372	伟星新材	1,544	37,117.76	0.15
299	600649	城投控股	8,600	36,808.00	0.15
300	600835	上海机电	2,656	36,466.88	0.15
301	002603	以岭药业	1,500	36,450.00	0.15
302	600971	恒源煤电	4,600	36,340.00	0.15
303	600026	中远海能	3,500	36,155.00	0.15
304	600901	江苏租赁	7,000	35,910.00	0.15
305	002013	中航机电	2,903	35,852.05	0.15
306	601918	新集能源	7,000	35,700.00	0.15
307	600436	片仔癀	100	35,673.00	0.15
308	000543	皖能电力	8,925	35,610.75	0.15
309	601995	中金公司	800	35,592.00	0.15
310	002237	恒邦股份	3,612	35,397.60	0.14

311	603260	合盛硅业	300	35,388.00	0.14
312	000550	江铃汽车	2,200	35,376.00	0.14
313	601886	江河集团	4,181	35,329.45	0.14
314	600737	中粮糖业	4,631	34,825.12	0.14
315	600588	用友网络	1,600	34,736.00	0.14
316	603501	韦尔股份	200	34,606.00	0.14
317	600675	中华企业	11,300	34,578.00	0.14
318	600682	南京新百	3,400	34,068.00	0.14
319	600916	中国黄金	2,900	33,930.00	0.14
320	603766	隆鑫通用	7,235	33,353.35	0.14
321	002042	华孚时尚	8,800	33,264.00	0.14
322	601179	中国西电	7,100	33,228.00	0.14
323	603833	欧派家居	220	33,149.60	0.14
324	002459	晶澳科技	420	33,138.00	0.14
325	601928	凤凰传媒	4,612	32,975.80	0.13
326	002242	九阳股份	1,772	32,533.92	0.13
327	600180	瑞茂通	4,200	32,424.00	0.13
328	000967	盈峰环境	6,400	32,384.00	0.13
329	600977	中国电影	2,800	32,200.00	0.13
330	600295	鄂尔多斯	1,780	32,129.00	0.13
331	002064	华峰化学	3,800	32,072.00	0.13
332	000990	诚志股份	2,900	31,755.00	0.13
333	002179	中航光电	500	31,660.00	0.13
334	600939	重庆建工	7,300	31,609.00	0.13
335	000559	万向钱潮	5,281	31,369.14	0.13
336	002152	广电运通	3,377	31,304.79	0.13
337	000537	广宇发展	2,400	31,176.00	0.13
338	601100	恒立液压	500	30,860.00	0.13
339	000600	建投能源	7,300	30,806.00	0.13
340	600760	中航沈飞	500	30,225.00	0.12
341	002831	裕同科技	1,000	29,550.00	0.12
342	601187	厦门银行	4,900	29,204.00	0.12
343	300033	同花顺	300	28,845.00	0.12
344	002532	天山铝业	4,400	28,732.00	0.12
345	603866	桃李面包	1,720	28,466.00	0.12
346	600167	联美控股	3,800	28,462.00	0.12
347	603885	吉祥航空	1,580	28,424.20	0.12
348	002032	苏泊尔	500	28,170.00	0.12
349	002419	天虹股份	3,950	28,163.50	0.11
350	600598	北大荒	1,900	28,044.00	0.11
351	002302	西部建设	3,600	27,936.00	0.11
352	600707	彩虹股份	5,900	27,612.00	0.11

353	000761	本钢板材	7,600	27,360.00	0.11
354	601828	美凯龙	4,500	27,270.00	0.11
355	600848	上海临港	2,000	27,120.00	0.11
356	601880	辽港股份	15,800	26,860.00	0.11
357	603198	迎驾贡酒	400	26,056.00	0.11
358	601958	金钼股份	2,900	25,636.00	0.10
359	002939	长城证券	2,500	25,400.00	0.10
360	000596	古井贡酒	100	24,966.00	0.10
361	600968	海油发展	9,600	24,768.00	0.10
362	600231	凌钢股份	9,300	24,552.00	0.10
363	600871	石化油服	12,600	23,814.00	0.10
364	601808	中海油服	1,700	23,715.00	0.10
365	600395	盘江股份	2,700	23,679.00	0.10
366	601298	青岛港	4,300	23,521.00	0.10
367	300413	芒果超媒	700	23,352.00	0.10
368	603056	德邦股份	1,700	22,831.00	0.09
369	603806	福斯特	344	22,538.88	0.09
370	300741	华宝股份	800	22,256.00	0.09
371	002607	中公教育	3,800	22,002.00	0.09
372	600548	深高速	2,200	20,988.00	0.09
373	601139	深圳燃气	2,800	19,432.00	0.08
374	601158	重庆水务	3,600	19,260.00	0.08
375	002916	深南电路	200	18,742.00	0.08
376	688036	传音控股	200	17,846.00	0.07
377	601236	红塔证券	1,700	15,521.00	0.06
378	600299	安迪苏	1,600	15,328.00	0.06
379	603195	公牛集团	100	15,291.00	0.06
380	600098	广州发展	2,400	15,024.00	0.06
381	688819	天能股份	399	13,797.42	0.06
382	601665	齐鲁银行	2,400	11,712.00	0.05
383	000958	电投产融	2,100	9,534.00	0.04
384	600927	永安期货	300	6,051.00	0.02
385	601156	东航物流	300	5,940.00	0.02
386	001289	龙源电力	200	4,352.00	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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	600352	浙江龙盛	160,577.00	0.61
2	002202	金风科技	155,286.00	0.59
3	600157	永泰能源	154,676.00	0.59
4	600839	四川长虹	151,908.00	0.58
5	600820	隧道股份	146,508.00	0.56
6	000778	新兴铸管	121,647.00	0.46
7	600196	复星医药	114,144.00	0.43
8	601788	光大证券	104,979.00	0.40
9	000906	浙商中拓	102,841.00	0.39
10	688981	中芯国际	85,326.15	0.32
11	600009	上海机场	81,384.00	0.31
12	600547	山东黄金	80,637.72	0.31
13	600674	川投能源	77,919.00	0.30
14	600398	海澜之家	75,529.00	0.29
15	000701	厦门信达	74,639.00	0.28
16	603225	新凤鸣	63,279.00	0.24
17	601677	明泰铝业	61,858.00	0.23
18	600596	新安股份	61,371.00	0.23
19	600143	金发科技	59,565.00	0.23
20	600339	中油工程	56,977.00	0.22

注：“本期累计买入金额”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	600325	华发股份	179,076.00	0.68
2	601699	潞安环能	156,906.00	0.60
3	600522	中天科技	148,261.00	0.56
4	601233	桐昆股份	131,273.15	0.50
5	000983	山西焦煤	120,549.00	0.46
6	000401	冀东水泥	108,280.00	0.41
7	600256	广汇能源	106,339.00	0.40
8	600348	华阳股份	105,320.00	0.40
9	600710	苏美达	93,841.00	0.36
10	601666	平煤股份	90,965.00	0.35
11	600141	兴发集团	90,076.00	0.34
12	600123	兰花科创	78,450.00	0.30
13	600502	安徽建工	77,488.00	0.29
14	600062	华润双鹤	65,540.80	0.25
15	601216	君正集团	64,927.84	0.25
16	000902	新洋丰	64,657.00	0.25
17	600233	圆通速递	61,641.00	0.23

18	600694	大商股份	61,624.00	0.23
19	000036	华联控股	61,470.00	0.23
20	600691	阳煤化工	60,113.00	0.23

注：“本期累计卖出金额”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	5,712,722.99
卖出股票收入（成交）总额	5,902,967.23

注：“买入股票的成本”和“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

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

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

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	54.68
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,916.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,971.01

**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未存在流通受限情况。

**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**

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

**§ 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 (%)
3,500	3,784.02	397,228.89	3.000	12,846,834.80	97.00

**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	139,215.26	1.05

**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	10~50

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（2012 年 5 月 14 日） 基金份额总额	413,537,496.16
本报告期期初基金份额总额	13,238,673.75
本报告期基金总申购份额	617,368.10
减：本报告期基金总赎回份额	611,978.16
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,244,063.69

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 (%)	
海通证券	3	11,597,883.05	100.00	10,801.73	100.00	-

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：

本基金本报告期无新增交易单元。

### 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 (%)
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金本报告期内未租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

### 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	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	规定网站	2022 年 1 月 24 日
2	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2021 年年度报告	规定网站	2022 年 3 月 31 日
3	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	规定网站	2022 年 4 月 22 日
4	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2022 年 6 月 24 日
5	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金招募说明书（更新）2022 年第 1 号	规定网站	2022 年 6 月 24 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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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中证锐联基本面 400 指数证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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