

浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数  
证券投资基金（LOF）  
2017 年半年度报告

2017 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2017 年 8 月 28 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。本半年度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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2017 年 8 月 22 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 2017 年 4 月 27 日起至 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	错误! 未定义书签。
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
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.....	13
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>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表 .....	18
6.4 报表附注 .....	19
<b>§7 投资组合报告 .....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合 .....	42
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 .....	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
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 .....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	51
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	54
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 .....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	54
10.4 基金投资策略的改变 .....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55

<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>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	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)
基金简称	浦银安盛沪港深基本面 100LOF
场内简称	沪港深 F
基金主代码	166402
交易代码	166402
基金运作方式	上市契约型开放式 (LOF)
基金合同生效日	2017 年 4 月 27 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	134,452,193.96 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2017 年 6 月 9 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用被动式投资策略,紧密跟踪中证锐联沪港深基本面 100 指数。在正常市场情况下,力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.40%以内,年跟踪误差控制在 5%以内。
投资策略	本基金以紧密跟踪标的指数,获取指数长期增长的稳定收益为宗旨,在降低跟踪误差和控制流动性风险的前提下,构建指数化的投资组合。
业绩比较基准	中证锐联沪港深基本面 100 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率(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。本基金将投资港股通标的股票,需承担汇率风险以及境外市场的风险。

### 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	招商证券股份有限公司

		司	
信息披露负责人	姓名	顾佳	宫少林
	联系电话	021-23212888	0755-82943666
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95565
传真		021-23212985	0755-82960794
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
办公地址		上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 层至 45 层
邮政编码		200020	518026
法定代表人		谢伟	郭杰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金半年度报告备置地点	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(2017年4月27日 - 2017年6月30日)
本期已实现收益	2,011,334.08
本期利润	1,972,740.66
加权平均基金份额本期利润	0.0069
本期加权平均净值利润率	0.69%
本期基金份额净值增长率	1.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	1,386,848.08
期末可供分配基金份额利润	0.0103
期末基金资产净值	135,924,476.88
期末基金份额净值	1.0110
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	1.10%

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。

5、本基金《基金合同》生效日为2017年4月27日，至报告期末，合同成立未满1年。以上财务指标中“本期”指2017年4月27日至2017年6月30日。

#### 3.2 基金净值表现

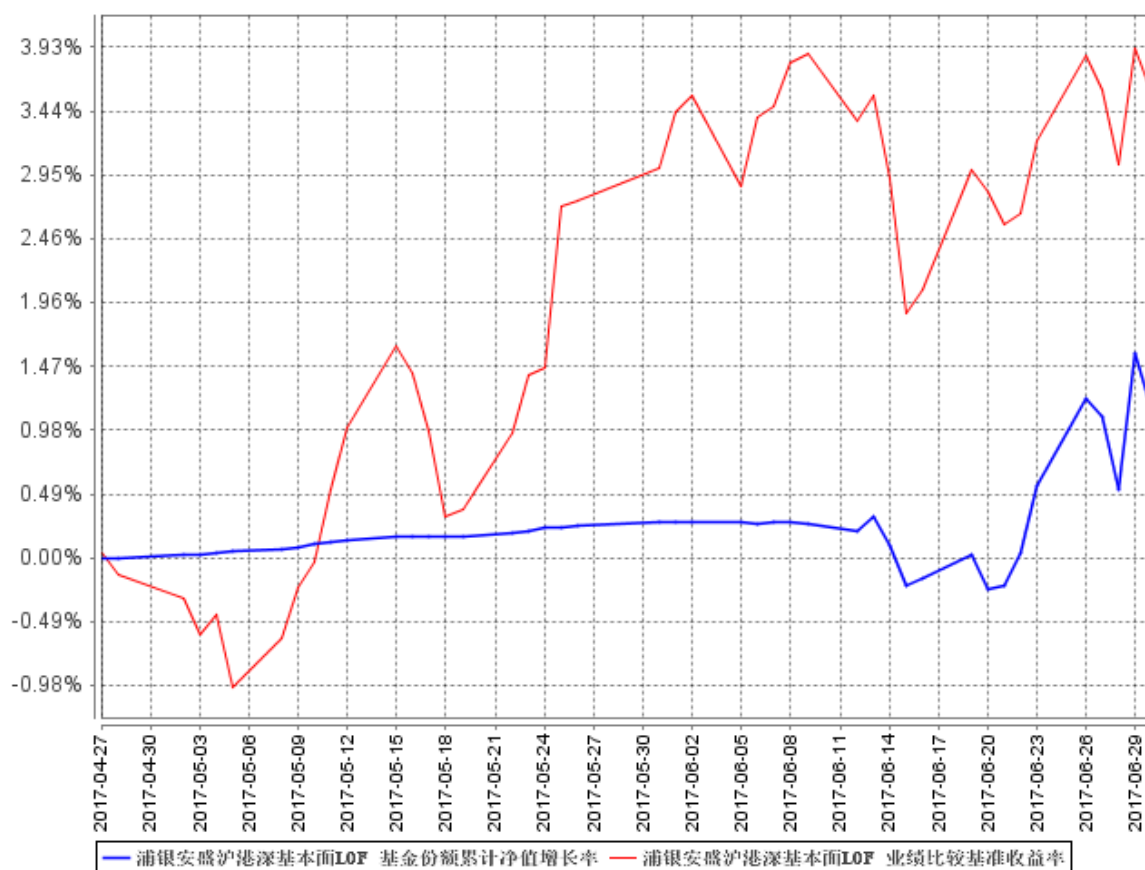
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.82%	0.35%	0.53%	0.52%	0.29%	-0.17%
自基金合同生效起至今	1.10%	0.25%	3.54%	0.48%	-2.44%	-0.23%



### 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

浦银安盛沪港深基本面LOF 基金份额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：1、本基金合同生效日为 2017 年 4 月 27 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未 1 年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2017 年 4 月 27 日至 2017 年 10 月 26 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

## § 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 2.8 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 2017 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 33 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、浦银安盛季季添利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、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、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、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、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、浦银安盛安和回报定期开放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、浦银安盛盛勤纯债债券型证券投资基金及浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)。

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子系统、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、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初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	本公司金融工程部总监，公司职工监事，公司旗下浦银安盛沪深 300 指数基金、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数基金 (LOF)	2017 年 4 月 27 日	-	16	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，任本公司金融工程部总监，并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 300 指数基金基金经理。2012 年 3 月兼任本公司职工监事。2012 年 5 月起，兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数基金基金经理。2017 年 4 月起，兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数基金 (LOF) 基金经理。

	基金经 理				
--	----------	--	--	--	--

注：1、述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

2017 年上半年, 中国经济平稳运行, GDP 增速达到 6.9%, 受益于供给侧改革和需求回升, 上游制造业企业的盈利显著改善, 工业增加值同比增长 7.6%。政府加强了金融监管的力度, 着力于降杠杆、防风险, 货币供应量 M2 增速下降到 9.4%, 市场资金利率提升, 证券市场波动加大。中国 A 股市场呈现明显的结构分化, 蓝筹价值股表现出色。港股市场录得优异的收益表现, 在全球经济增长回暖和港股通南下资金的涌入, 恒生指数大涨 17.11%。港股蓝筹股估值较低、财务稳健、股息回报高, 受到内地投资者的青睐。

本报告期内, 本基金于 2017 年 4 月 27 日成立, 并于 6 月底前完成建仓, 实现对标的指数的有效跟踪。本基金在开放申购赎回后, 遭遇大额赎回, 本基金合理配置资产, 降低了赎回对组合业绩的影响。由于建仓期内, 标的指数快速上涨, 而本基金股票组合投资比例逐步提升, 因此, 组合表现落后于同期业绩比较基准。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0110 元; 本报告期基金份额净值增长率为 1.10%, 业绩比较基准收益率为 3.54%。

## 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 2017 年下半年, 防范金融风险的监管政策还将持续, 证券市场还会面临新的风险与挑战。A 股市场的结构性行情还将进行下去, 有良好业绩支撑的蓝筹股仍可能有较好的表现。港股市场基本面稳健, 但是在全球利率上行的环境下, 估值会受到较大的压力, 港股的表现也会出现明显的分化。

## 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分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、风险管理部和监察稽核部负责人、基金运营部负责人组成。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签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

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》第十七部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。

收益分配方式分两种：登记在注册登记系统基金份额持有人开放式基金账户下的基金份额，可选择现金红利或将现金红利按除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。登记在证券登记结算系统基金份额持有人深圳证券账户下的基金份额，只能选择现金分红的方式，具体权益分配程序等有关事项遵循深圳证券交易所及中国证券登记结算有限责任公司的相关规定。

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

每一基金份额享有同等分配权。

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，招商证券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。

### 5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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：浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)

报告截止日：2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 6 月 30 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	11,755,287.44	-
结算备付金		1,195,559.50	-
存出保证金		20,765.39	-
交易性金融资产	6.4.7.2	128,301,544.25	-
其中：股票投资		128,301,544.25	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		3,746,521.41	-
应收利息	6.4.7.5	10,530.70	-
应收股利		655,555.00	-
应收申购款		649.22	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		145,686,412.91	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2016 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		-	-
应付证券清算款		3,806.20	-
应付赎回款		9,225,323.99	-
应付管理人报酬		191,105.23	-
应付托管费		42,043.14	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	136,574.79	-



应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	163,082.68	-
负债合计		9,761,936.03	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	134,452,193.96	-
未分配利润	6.4.7.10	1,472,282.92	-
所有者权益合计		135,924,476.88	-
负债和所有者权益总计		145,686,412.91	-

注：1. 本财务报表的实际编制期间自 2017 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2017 年 06 月 30 日。

2. 报告截止日 2017 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0110 元，基金份额总额 134,452,193.96 份。

3. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，至报告期末，合同成立未满一年。

4. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期：2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017 年 4 月 27 日 (基 金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		3,034,968.54	-
1.利息收入		1,683,922.26	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	897,917.50	-
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		786,004.76	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,125,440.60	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	160,507.91	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-

股利收益	6.4.7.16	964,932.69	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	-38,593.42	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	264,199.10	-
<b>减:二、费用</b>		1,062,227.88	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	512,544.65	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	112,759.79	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	243,609.49	-
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	6.4.7.20	193,313.95	-
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		1,972,740.66	-
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		1,972,740.66	-

注: 1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日, 至报告期末, 合同成立未满一年。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日, 无上年度可比期间。

### 6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体: 浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)

本报告期: 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	344,633,224.79	-	344,633,224.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,972,740.66	1,972,740.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-210,181,030.83	-500,457.74	-210,681,488.57
其中: 1.基金申购款	671,171.81	5,937.71	677,109.52

2. 基金赎回款	-210,852,202.64	-506,395.45	-211,358,598.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	134,452,193.96	1,472,282.92	135,924,476.88
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，至报告期末，合同成立未满一年。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

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>                    </u> 郁蓓华	<u>                    </u> 郁蓓华	<u>                    </u> 钱琨
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

浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）（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[2017]113 号《关于准予浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）注册的批复》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《浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）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人民币 344,561,770.19 元，业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(2017)第 421 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》于 2017 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 344,633,224.79 份基金份额，其中认购资金利息折合 71,454.60 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，基金托管人为招商证券股份有限公司（以下简称“招商证券”）。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2017]348 核准，本基金 117,730,508.00 份额于 2017 年 6 月 9 日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）基金合同》和《浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、衍生工具（股指期货、权证等）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）。本基金的投资组合比例为：股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证锐联沪港深基本面 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为：中证锐联沪港深基本面 100 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×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<年度报告和半年度报告>》、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》、《浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 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。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 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 2017 年 6 月 30 日的财务状况以及 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 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 重要会计政策和会计估计

本基金《基金合同》生效日为 2017 年 04 月 27 日, 无上年度可比期间。

### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 06 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

人民币

### 6.4.4.3 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。以公允价值计量且其公允价值变动计入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其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 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。

### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具

有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 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。

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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收



益法等估值技术进行估值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于 2016 年 5 月 1 日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自 2016 年 5 月 1 日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的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。

(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。

## 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 2017 年 6 月 30 日
活期存款	11,755,287.44
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	-
合计：	11,755,287.44

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	128,340,137.67	128,301,544.25	-38,593.42
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	128,340,137.67	128,301,544.25	-38,593.42

注：1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 04 月 27 日，无上年度可比期间。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 04 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 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。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 04 月 27 日，无上年度可比期间。

##### 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证券。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 04 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	6,816.88
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	484.20
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	3,229.62
合计	10,530.70

注：1、此处其他列示的是基金存于上交所与深交所的结算保证金的期末应收利息。

2、本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	136,574.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	136,574.79

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	34,768.73
预提费用	78,313.95
应付指数使用费	50,000.00
合计	163,082.68

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

**6.4.7.9 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	344,633,224.79	344,633,224.79
本期申购	671,171.81	671,171.81
本期赎回(以“-”号填列)	-210,852,202.64	-210,852,202.64
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	134,452,193.96	134,452,193.96

**6.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	2,011,334.08	-38,593.42	1,972,740.66
本期基金份额交易产生的变动数	-624,486.00	124,028.26	-500,457.74
其中：基金申购款	4,732.62	1,205.09	5,937.71
基金赎回款	-629,218.62	122,823.17	-506,395.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,386,848.08	85,434.84	1,472,282.92

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	282,458.37
定期存款利息收入	605,540.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	9,182.97
其他	736.16
合计	897,917.50

注：1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

2. 此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	5,901,326.58
减：卖出股票成本总额	5,740,818.67
买卖股票差价收入	160,507.91

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：1. 本基金本报告期内无债券投资收益。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：1. 本基金本报告期内无债券投资收益。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：1. 本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### **6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

- 注：1. 本基金本报告期内无债券投资收益--申购差价收入。  
2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### **6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

- 注：1. 本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。  
2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### **6.4.7.14 贵金属投资收益**

##### **6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

- 注：1. 本基金本报告期内无贵金属投资收益。  
2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

##### **6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

- 注：1. 本基金本报告期内无贵金属投资收益。  
2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

##### **6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

- 注：1. 本基金本报告期内无贵金属投资收益。  
2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

##### **6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

- 注：1. 本基金本报告期内无贵金属投资收益。  
2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### **6.4.7.15 衍生工具收益**

##### **6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

- 注：1. 本基金本报告期内无衍生工具投资收益。  
2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

##### **6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

- 注：1. 本基金本报告期内无衍生工具投资收益。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	964,932.69
基金投资产生的股利收益	-
合计	964,932.69

注：1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	994,263.93
——股票投资	994,263.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-1,032,857.35
合计	-38,593.42

注：1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	264,199.10
合计	264,199.10

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。

3. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	243,609.49
银行间市场交易费用	-
合计	243,609.49

注：1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017 年 4 月 27 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日
审计费用	15,662.40
信息披露费	62,651.55
指数使用费	50,000.00
上市费	65,000.00
合计	193,313.95

注：1. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

### 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

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

#### 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
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金代销机构
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构

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**

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。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

**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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年4月27日(基金合同生效日) 至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
招商证券	49,602,039.66	100.00%	-	-

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

**6.4.10.1.2 债券交易**

注：1. 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。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

**6.4.10.1.3 债券回购交易**

注：1. 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。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

**6.4.10.1.4 权证交易**

注：1. 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。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

**6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券	136,574.79	100.00%	136,574.79	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

注：本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

## 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 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	512,544.65	-
其中：支付销售机构的客户维护费	156,889.22	-

注：1、本基金成立于 2017 年 4 月 27 日，上年度可比期间无数据。

2、在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年4月27日(基金合同生效日)至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	112,759.79	-

注：1、本基金成立于 2017 年 4 月 27 日，上年度可比期间无数据。

2、本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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：1、本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行债券（含回购）交易。

2、本基金成立于 2017 年 4 月 27 日, 上年度可比期间无数据。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期内未持有本基金。 本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效日) 至 2017 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至 2016 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
招商证券	11,755,287.44	282,458.37	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，按银行同业利率计息。本基金成立于 2017 年 4 月 27 日, 上年度可比期间无数据。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期末未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。本基金合同生效日 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.7 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。本基金合同生效日 2017 年 4 月 27 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017 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：本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金在本报告期末未持有因认购新发/增发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

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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

截止本报告期末 2017 年 6 月 30 日止，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。

#### 6.4.13 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。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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，股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证锐联沪港深基本面 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本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，设立了多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。

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经营层面负责风险管理的最高权利机构，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与监察稽核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，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。

本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的托管方是招商证券股份有限公司，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，因此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。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注 于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (2016 年 12 月 31 日：0%)。

#### **6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资**

注 于 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (2016 年 12 月 31 日：0%)。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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对本基金的申购赎回情况进行严密监控，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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票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%。本基金所持大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债的合约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。

#### 6.4.13.4 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、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017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	11,755,287.44	-	-	-	11,755,287.44
结算备付金	1,195,559.50	-	-	-	1,195,559.50
存出保证金	20,765.39	-	-	-	20,765.39
交易性金融资产	-	-	-	128,301,544.25	128,301,544.25
应收证券清算款	-	-	-	3,746,521.41	3,746,521.41
应收利息	-	-	-	10,530.70	10,530.70
应收股利	-	-	-	655,555.00	655,555.00
应收申购款	-	-	-	649.22	649.22
资产总计	12,971,612.33	-	-	132,714,800.58	145,686,412.91
负债					
应付证券清算款	-	-	-	3,806.20	3,806.20
应付赎回款	-	-	-	9,225,323.99	9,225,323.99
应付管理人报酬	-	-	-	191,105.23	191,105.23
应付托管费	-	-	-	42,043.14	42,043.14
应付交易费用	-	-	-	136,574.79	136,574.79
其他负债	-	-	-	163,082.68	163,082.68
负债总计	-	-	-	9,761,936.03	9,761,936.03
利率敏感度缺口	12,971,612.33	-	-	-122,952,864.55	135,924,476.88

上年度末 2016 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
负债					

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 2017 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例不超过 20%，此基金成立于 2017 年 4 月 27 日。

#### 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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；同时采用“自下而上”的策略通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证锐联沪港深基本面 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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，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 2017 年 6 月 30 日		上年度末 2016 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	128,301,544.25	94.39	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	128,301,544.25	94.39	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本基金业绩比较标准外的其他市场变量保持不变		
分析	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 (2017 年 6 月 30 日)	上年度末 (2016 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准上升 5%	5,292,438.70	-
	业绩比较基准下降 5%	-5,292,438.70	-

## § 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	128,301,544.25	88.07
	其中：股票	128,301,544.25	88.07
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	12,950,846.94	8.89
7	其他各项资产	4,434,021.72	3.04
8	合计	145,686,412.91	100.00

注：1. 其中港股通股票投资（81,921,632.2 元）占总资产比例 56.23%。

### 7.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,354,948.00	1.73
C	制造业	8,371,368.00	6.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,696,604.00	1.25
E	建筑业	6,049,021.00	4.45
F	批发和零售业	354,375.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	995,715.00	0.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	24,293,159.05	17.87
K	房地产业	2,264,722.00	1.67

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	46,379,912.05	34.12

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	1,142,946.49	0.84
C 消费者常用品	848,061.99	0.62
D 能源	9,095,671.42	6.69
E 金融	47,207,067.09	34.73
F 医疗保健	-	-
G 工业	4,961,273.75	3.65
H 信息技术	1,963,339.19	1.44
I 电信服务	6,548,603.94	4.82
J 公用事业	2,824,385.26	2.08
K 房地产	7,330,283.07	5.39
合计	81,921,632.20	60.27

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

### 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	占基金资产净值比例 (%)
1	00005	汇丰控股	208,800	13,165,756.21	9.69
2	00939	建设银行	1,797,000	9,435,896.05	6.94
3	01398	工商银行	1,271,000	5,813,475.71	4.28
4	00941	中国移动	65,000	4,673,966.18	3.44
5	03988	中国银行	1,343,000	4,464,311.42	3.28
6	00386	中国石化	692,000	3,657,657.90	2.69

		工股份			
7	601318	中国平安	70,485	3,496,760.85	2.57
8	02888	渣打集团	47,050	3,209,680.99	2.36
9	600016	民生银行	337,300	2,772,606.00	2.04
10	601668	中国建筑	279,200	2,702,656.00	1.99
11	601328	交通银行	421,800	2,598,288.00	1.91
12	601166	兴业银行	145,200	2,448,072.00	1.80
13	00883	中国海洋石油	318,000	2,359,787.69	1.74
14	00857	中国石油股份	562,000	2,331,545.57	1.72
15	601288	农业银行	634,900	2,234,848.00	1.64
16	01299	友邦保险	43,800	2,168,749.82	1.60
17	00001	长和	23,500	1,998,819.76	1.47
18	600104	上汽集团	59,600	1,850,580.00	1.36
19	601398	工商银行	333,000	1,748,250.00	1.29
20	600028	中国石化	285,600	1,693,608.00	1.25
21	02318	中国平安	35,500	1,585,234.18	1.17
22	01288	农业银行	475,000	1,521,246.78	1.12
23	000651	格力电器	36,500	1,502,705.00	1.11
24	00016	新鸿基地产	15,000	1,493,256.36	1.10
25	000002	万科 A	56,200	1,403,314.00	1.03
26	601988	中国银行	377,000	1,394,900.00	1.03
27	601186	中国铁建	97,400	1,171,722.00	0.86
28	601390	中国中铁	132,300	1,147,041.00	0.84
29	601169	北京银行	124,400	1,140,748.00	0.84
30	00762	中国联通	112,000	1,127,601.66	0.83
31	000333	美的集团	25,500	1,097,520.00	0.81
32	00700	腾讯控股	4,500	1,090,454.69	0.80
33	01113	长实地产	20,500	1,088,002.81	0.80
34	601818	光大银行	262,900	1,064,745.00	0.78
35	00002	中电控股	14,500	1,039,507.78	0.76
36	02628	中国人寿	50,000	1,034,994.60	0.76
37	600030	中信证券	59,800	1,017,796.00	0.75
38	02388	中银香港	29,500	956,295.95	0.70
39	000001	平安银行	100,900	947,451.00	0.70
40	03328	交通银行	188,000	899,060.97	0.66
41	601601	中国太保	25,800	873,846.00	0.64
42	00992	联想集团	204,000	872,884.50	0.64

43	600048	保利地产	86,400	861,408.00	0.63
44	00019	太古股份公 司 A	13,000	860,325.70	0.63
45	600015	华夏银行	92,360	851,559.20	0.63
46	00006	电能实业	14,000	837,803.18	0.62
47	00017	新世界发展	96,000	825,704.37	0.61
48	00011	恒生银行	5,600	793,695.48	0.58
49	00688	中国海外发 展	40,000	793,278.88	0.58
50	00004	九龙仓集团	14,000	786,161.94	0.58
51	600019	宝钢股份	115,900	777,689.00	0.57
52	01988	民生银行	112,500	760,623.39	0.56
53	601006	大秦铁路	89,400	750,066.00	0.55
54	00728	中国电信	232,000	747,036.10	0.55
55	01088	中国神华	49,500	746,680.26	0.55
56	01658	邮储银行	188,000	734,260.32	0.54
57	01800	中国交通建 设	83,000	724,695.84	0.53
58	00267	中信股份	70,000	713,256.66	0.52
59	00998	中信银行	160,000	663,785.22	0.49
60	601857	中国石油	86,000	661,340.00	0.49
61	600519	贵州茅台	1,400	660,590.00	0.49
62	601939	建设银行	105,200	646,980.00	0.48
63	01928	金沙中国有 限公司	19,200	595,740.29	0.44
64	600900	长江电力	37,700	579,826.00	0.43
65	601766	中国中车	55,400	560,648.00	0.41
66	00494	利丰	222,000	547,206.20	0.40
67	02007	碧桂园	68,000	534,117.97	0.39
68	600741	华域汽车	21,700	526,008.00	0.39
69	600011	华能国际	71,600	525,544.00	0.39
70	01109	华润置地	26,000	513,374.68	0.38
71	00291	华润啤酒	30,000	512,940.72	0.38
72	000858	五粮液	9,200	512,072.00	0.38
73	601211	国泰君安	24,200	496,342.00	0.37
74	600585	海螺水泥	20,200	459,146.00	0.34
75	00066	港铁公司	12,000	457,741.01	0.34
76	03333	中国恒大	36,000	438,056.58	0.32
77	00836	华润电力	32,000	425,489.10	0.31

78	600690	青岛海尔	28,200	424,410.00	0.31
79	601669	中国电建	52,900	418,968.00	0.31
80	00003	香港中华煤气	32,000	407,714.10	0.30
81	00101	恒隆地产	24,000	406,186.56	0.30
82	00012	恒基地产	10,000	377,979.16	0.28
83	002024	苏宁云商	31,500	354,375.00	0.26
84	601618	中国中冶	68,200	341,682.00	0.25
85	00288	万洲国际	49,000	335,121.27	0.25
86	600027	华电国际	66,000	318,780.00	0.23
87	601628	中国人寿	10,800	291,384.00	0.21
88	00656	复星国际	26,500	280,598.54	0.21
89	600023	浙能电力	49,900	272,454.00	0.20
90	601998	中信银行	42,700	268,583.00	0.20
91	601800	中国交建	16,800	266,952.00	0.20
92	601111	中国国航	13,100	127,725.00	0.09
93	600018	上港集团	18,600	117,924.00	0.09
94	01038	长江基建集团	2,000	113,871.10	0.08

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00005	汇丰控股	13,686,070.59	10.07
2	00939	建设银行	10,143,893.00	7.46
3	01398	工商银行	6,189,627.92	4.55
4	00941	中国移动	5,017,387.80	3.69
5	03988	中国银行	4,768,104.03	3.51
6	00386	中国石油化工股份	3,906,622.31	2.87
7	601318	中国平安	3,615,280.62	2.66
8	02888	渣打集团	3,392,024.08	2.50
9	601668	中国建筑	2,892,924.00	2.13

10	600016	民生银行	2,869,850.00	2.11
11	601328	交通银行	2,674,018.00	1.97
12	00857	中国石油股份	2,583,101.91	1.90
13	601166	兴业银行	2,570,353.00	1.89
14	00883	中国海洋石油	2,511,775.60	1.85
15	601288	农业银行	2,325,315.00	1.71
16	01299	友邦保险	2,282,564.34	1.68
17	00001	长和	2,083,653.77	1.53
18	600104	上汽集团	1,937,682.00	1.43
19	601398	工商银行	1,813,200.00	1.33
20	600028	中国石化	1,726,818.00	1.27

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 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	00005	汇丰控股	1,238,978.46	0.91
2	01398	工商银行	422,229.88	0.31
3	000002	万科 A	302,324.00	0.09
4	02888	渣打集团	296,046.04	0.22
5	03988	中国银行	277,365.39	0.20
6	601166	兴业银行	236,739.00	0.17
7	00941	中国移动	218,304.51	0.16
8	601318	中国平安	201,433.00	0.15
9	02388	中银香港	171,886.44	0.13
10	000651	格力电器	168,378.00	0.12
11	600016	民生银行	140,904.00	0.10
12	601668	中国建筑	136,604.00	0.10
13	000333	美的集团	136,594.00	0.10
14	01299	友邦保险	120,721.87	0.09
15	601328	交通银行	112,608.00	0.08
16	01288	农业银行	109,169.71	0.08
17	00883	中国海洋石油	104,440.69	0.08
18	600104	上汽集团	103,603.00	0.08
19	601288	农业银行	96,744.00	0.07

20	601398	工商银行	95,557.00	0.07
----	--------	------	-----------	------

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	134,080,956.34
卖出股票收入（成交）总额	5,901,326.58

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。



## 7.10.2 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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货

### 7.11.3 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

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

### 7.12.2

本基金投资的前十名股票中不存在超出基金合同规定的备选股票库范围的情况。

### 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	20,765.39
2	应收证券清算款	3,746,521.41
3	应收股利	655,555.00
4	应收利息	10,530.70
5	应收申购款	649.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,434,021.72

#### **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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

## § 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
2,067	65,047.02	2,788,146.07	2.07%	131,664,047.89	97.93%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额 比例
1	王君杰	2,230,108.00	8.14%
2	李春生	1,000,019.00	3.65%
3	王宪春	890,135.00	3.25%
4	傅忠红	600,046.00	2.19%
5	陈富生	600,029.00	2.19%
6	金桃红	500,009.00	1.83%
7	李冬梅	497,048.00	1.82%
8	李亦宸	450,008.00	1.64%
9	张文英	400,027.00	1.46%
10	李建勇	400,019.00	1.46%

### 8.3 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	288,733.48	0.21%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10

本基金基金经理持有本开放式基金	0~10
-----------------	------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年4月27日）基金份额总额	344,633,224.79
本报告期期初基金份额总额	-
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	671,171.81
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	210,852,202.64
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	134,452,193.96

注：总申购份额含红利再投份额。

## § 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

报告期内基金管理人、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	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比 例		总量的比例	
招商证券	2	139,982,282.92	100.00%	136,574.71	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：

本基金本报告期间交易单元全部为新增。

### 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
招商证券	-	-	607,650,000.00	100.00%	-	-

### 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	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书	报刊及公司网站	2017 年 3 月 17 日
2	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金份额发售公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 17 日
3	关于浦银安盛中证锐联沪港深基	报刊及公司网站	2017 年 3 月 21 日

	本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告		
4	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在部分代销机构参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 21 日
5	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在陆金所资管参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 21 日
6	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 上网发售提示性公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 22 日
7	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	报刊及公司网站	2017 年 3 月 23 日
8	关于董事会换届的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 23 日
9	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 24 日
10	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 28 日
11	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在部分代销机构参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 28 日
12	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 28 日
13	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 31 日
14	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在部分代销机构参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 3 月 31 日
15	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告	报刊及公司网站	2017 年 4 月 10 日
16	关于浦银安盛中证锐联沪港深基	报刊及公司网站	2017 年 4 月 12 日



	本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告		
17	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在北京肯特瑞财富投资管理有限公司参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 4 月 12 日
18	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 新增代销机构的公告	报刊及公司网站	2017 年 4 月 14 日
19	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在方正证券股份有限公司和中国民族证券有限责任公司参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 4 月 14 日
20	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同生效公告	报刊及公司网站	2017 年 4 月 28 日
21	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	报刊及公司网站	2017 年 4 月 28 日
22	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 上市交易公告书	报刊及公司网站	2017 年 6 月 6 日
23	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 开通转托管业务公告	报刊及公司网站	2017 年 6 月 7 日
24	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	报刊及公司网站	2017 年 6 月 7 日
25	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在部分代销机构开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 6 月 8 日
26	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 上市交易提示性公告	报刊及公司网站	2017 年 6 月 9 日
27	关于浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 在代销机构开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司网站	2017 年 6 月 10 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

1、因浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“公司”）第三届董事会任期届满，根据《公司章程》的规定，经公司 2017 年第一次股东会会议审议通过，选举产生公司第四届董事会成员，共 11 名董事。详见本基金管理人于 2017 年 3 月 23 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会换届的公告》。

2、2017 年 4 月 26 日，谢伟先生担任浦银安盛基金管理有限公司董事长，详见本公司于 2017 年 4 月 28 日发布的《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》。

## § 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沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 设立的文件
- 2、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金合同
- 3、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 招募说明书
- 4、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 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指定报刊上披露的各项公告
- 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) 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

2017 年 8 月 28 日