

浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数
证券投资基金（LOF）
2018 年半年度报告

2018 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：2018 年 8 月 27 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 2018 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 2018 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
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
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
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.....	9
§4 管理人报告	10
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.....	14
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.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	43
7.2 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.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
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.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	50
§8 基金份额持有人信息.....	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	55
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	55
10.4 基金投资策略的改变.....	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56

§11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式.....	60

§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 LOF
场内简称	沪港深 F
基金主代码	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	41,447,037.65 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 \times 95% + 银行人民币活期存款利率（税后） \times 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	郭杰
	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	霍达

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(2018年1月1日 - 2018年6月30日)
本期已实现收益	1,415,441.42
本期利润	-2,117,111.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0455
本期加权平均净值利润率	-4.17%
本期基金份额净值增长率	-4.42%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配利润	1,575,607.78
期末可供分配基金份额利润	0.0380
期末基金资产净值	43,022,645.43
期末基金份额净值	1.0380
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年6月30日)
基金份额累计净值增长率	3.80%

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

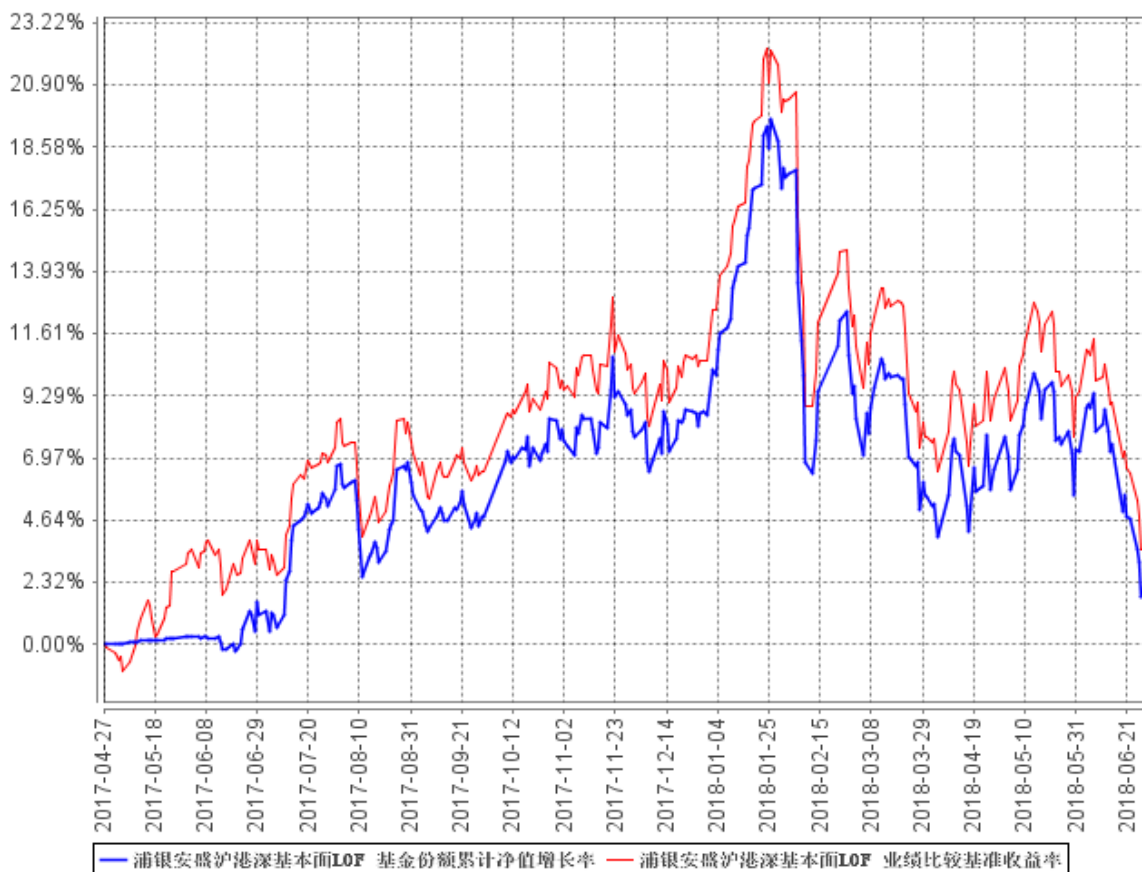
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-3.22%	0.95%	-3.74%	0.83%	0.52%	0.12%
过去三个月	-1.64%	0.95%	-2.42%	0.90%	0.78%	0.05%
过去六个月	-4.42%	1.01%	-4.94%	1.02%	0.52%	-0.01%
过去一年	2.67%	0.82%	1.57%	0.84%	1.10%	-0.02%
自基金合同	3.80%	0.76%	5.16%	0.79%	-1.36%	-0.03%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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：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。建仓期结束后符合相关规定。

§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 2018 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 36 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、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、浦银安盛幸福聚益 18 个月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、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。

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 指数基金经理、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数基金	2017 年 4 月 27 日	-	17	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

	(LOF) 基金经理				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。
--	---------------	--	--	--	---

注: 1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

2018 年上半年,中国经济增长放缓,GDP 增速降至 6.7%。今年以来,中美贸易冲突不断升级,对未来经济前景产生负面影响,固定资产投资增速下行,工业增加值同比增长 6%,低于去年同期水平。在防范金融风险的政策背景下,资金市场呈现宽货币、紧信用的特点,货币供应量 M2 增速降至 8%,信用风险事件频发。受此影响,2018 年上半年,中国 A 股市场各主要板块均出现较大幅度调整,上证 50 指数下跌 13.3%;港股市场一季度表现良好,与国际股票市场同步上涨,但二季度后受到美元汇率上升和棚改政策变动等影响,也出现了一定程度的调整,恒生指数下跌 3.22%。代表中国经济整体实力的中证锐联沪港深基本面 100 指数下跌 5.24%。目前,港股和 A 股市场的估值水平都处于历史较低水平,上市公司基本面良好,股息回报率高,具备长期投资价值。

本报告期内,本基金采取完全复制方法密切跟踪标的指数的表现,组合表现基本与同期业绩比较基准保持一致。

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 1.0380 元;本报告期基金份额净值增长率为-4.42%,业绩比较基准收益率为-4.94%。

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 2018 年下半年,金融监管政策可能出现结构性适度调整,以支持中小企业的合理资金需求,积极财政政策也会助力经济结构转型和发展。从对上市公司财务数据跟踪分析看,内地和香港地区的上市公司整体盈利状况良好,这为股票长期投资提供了坚实的基础。所以,我们对当前的股票市场并不悲观,我们持续看好覆盖沪港深三地股票市场的股息回报高、基本面稳健的大蓝筹股的表现。

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、风险管理部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。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、本报告期内超过连续二十个工作日基金资产净值低于五千万，未超过连续六十个工作日。

§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：2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,888,629.43	3,668,325.59
结算备付金		-	-
存出保证金		11,174.14	50,640.61
交易性金融资产	6.4.7.2	39,942,487.28	48,681,173.99
其中：股票投资		39,942,487.28	48,681,173.99
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		1,586,425.10	430,992.53
应收利息	6.4.7.5	1,300.80	1,821.61
应收股利		125,638.26	6,470.77
应收申购款		21,494.22	9,069.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		44,577,149.23	52,848,494.68
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
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		278,563.54	-
应付赎回款		1,010,709.02	691,913.03
应付管理人报酬		37,387.22	41,664.73
应付托管费		8,225.20	9,166.25
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	42,115.85	37,570.99

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	177,502.97	351,736.15
负债合计		1,554,503.80	1,132,051.15
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	41,447,037.65	47,620,997.58
未分配利润	6.4.7.10	1,575,607.78	4,095,445.95
所有者权益合计		43,022,645.43	51,716,443.53
负债和所有者权益总计		44,577,149.23	52,848,494.68

注：报告截止日 2018 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0380 元，基金份额总额 41,447,037.65 份。

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：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 4 月 27 日(基金 合同生效日)至 2017 年 6 月 30 日
一、收入		-1,485,191.01	3,034,968.54
1.利息收入		37,099.80	1,683,922.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	37,099.80	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）		1,975,260.17	1,125,440.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,333,550.79	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	641,709.38	964,932.69
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-3,532,553.15	-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	35,002.17	264,199.10
减: 二、费用		631,920.72	1,062,227.88
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	251,896.84	512,544.65
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,417.30	112,759.79
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	100,234.25	243,609.49
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	224,372.33	193,313.95
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-2,117,111.73	1,972,740.66
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-2,117,111.73	1,972,740.66

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: 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	47,620,997.58	4,095,445.95	51,716,443.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-2,117,111.73	-2,117,111.73
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)	-6,173,959.93	-402,726.44	-6,576,686.37
其中: 1. 基金申购款	25,428,750.66	2,544,618.93	27,973,369.59
2. 基金赎回款	-31,602,710.59	-2,947,345.37	-34,550,055.96
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)	41,447,037.65	1,575,607.78	43,022,645.43
项目	上年度可比期间 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

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基金，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。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2017]348 号核准，本基金 117,730,508.00 份份额于 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》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 \times 95%+银行人民币活期存款利率(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 2018 年 1 月 1 日至 2018 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 2018 年 6 月 30 日的财务状况以及 2018 年 1 月 1 日至 2018 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

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。

6.4.5 会计差错更正的说明

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[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行税额抵扣等增值税政策的通知》、《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》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。

(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) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2018 年 6 月 30 日
活期存款	2,888,629.43
定期存款	-
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	-
合计：	2,888,629.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,638,305.67	39,942,487.28	-695,818.39
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	40,638,305.67	39,942,487.28	-695,818.39

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。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的证券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	1,293.72
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	2.58
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
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	4.50
合计	1,300.80

注：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。

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。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
交易所市场应付交易费用	42,115.85
银行间市场应付交易费用	-
合计	42,115.85

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,530.64
预提费用	123,972.33
应付指数使用费	50,000.00
合计	177,502.97

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	47,620,997.58	47,620,997.58
本期申购	25,428,750.66	25,428,750.66
本期赎回(以“-”号填列)	-31,602,710.59	-31,602,710.59
- 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	41,447,037.65	41,447,037.65
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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
上年度末	2,888,064.54	1,207,381.41	4,095,445.95
本期利润	1,415,441.42	-3,532,553.15	-2,117,111.73
本期基金份额交易产生的变动数	-452,146.00	49,419.56	-402,726.44
其中：基金申购款	1,945,083.61	599,535.32	2,544,618.93
基金赎回款	-2,397,229.61	-550,115.76	-2,947,345.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,851,359.96	-2,275,752.18	1,575,607.78

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日
活期存款利息收入	35,121.19
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	1,855.64
其他	122.97
合计	37,099.80

注：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 2018年1月1日至2018年6月30日
卖出股票成交总额	28,888,057.86
减：卖出股票成本总额	27,554,507.07
买卖股票差价收入	1,333,550.79

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：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资基金收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资基金收益。

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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

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：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	641,709.38
基金投资产生的股利收益	-
合计	641,709.38

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-3,532,553.15
——股票投资	-3,532,553.15
——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	-
减： 应税金融商品公允价值变动产生的预估 增值税	-
合计	-3,532,553.15

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	35,002.17
合计	35,002.17

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	100,234.25
银行间市场交易费用	-
合计	100,234.25

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	64,466.77
银行费用	400.00
指数使用费	100,000.00
上市费	29,752.78
合计	224,372.33

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
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构

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

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至 2017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	51,236,431.35	100.00%	139,982,282.92	100.00%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018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	49,977.11	100.00%	42,115.85	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 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%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效 日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	251,896.84	512,544.65
其中：支付销售机构的客户维护费	102,474.65	156,889.22

注：支付基金管理人浦银安盛的基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.0% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 1.0\% / \text{当年天数}$$

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2017 年 4 月 27 日(基金合同生效 日)至 2017 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	55,417.30	112,759.79

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.22% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.22\% / \text{当年天数}$$

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：本基金在本报告期内未通过关联方交易单元进行债券（含回购）交易。

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自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。

6.4.10.4.2 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及上年度末均未持有本基金。

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 2018年1月1日至2018年6月30日		上年度可比期间 2017年4月27日(基金合同生效日)至 2017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	2,888,629.43	35,121.19	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。

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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2018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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601390	中国中铁	2018年5月7日	临时停牌	7.47	-	-	35,200	297,424.31	262,944.00	-

注：本基金截至 2018 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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 2018 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 2018 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，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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，均具备有符合法律法规、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。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商证券和其他资质较好的银行，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，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 2018 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% (2017 年 12 月 31 日：0%)。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截止 2018 年 6 月 30 日，无资产支持证券持仓。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：截止 2018 年 6 月 30 日，无同业存单持仓。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：于 2018 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% (2017 年 12 月 31 日：0%)。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：截止 2018 年 6 月 30 日，无资产支持证券持仓。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：截止 2018 年 6 月 30 日，无同业存单持仓。

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。本基金封闭期内的流动性风险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，封闭期满转为上市交易开放式基金后流动性风险还将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。

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。本基金所持大部分证券可在证券交易所上市，其余亦在银行间同业市场交易，除在 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。

针对转为上市交易开放式基金后面临的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。

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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%, 且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%, 本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票, 不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施, 本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

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 2018 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	2,888,629.43	-	-	-	2,888,629.43
存出保证金	11,174.14	-	-	-	11,174.14
交易性金融资产	-	-	-	39,942,487.28	39,942,487.28
应收证券清算款	-	-	-	1,586,425.10	1,586,425.10
应收利息	-	-	-	1,300.80	1,300.80
应收股利	-	-	-	125,638.26	125,638.26
应收申购款	-	-	-	21,494.22	21,494.22
资产总计	2,899,803.57	-	-	41,677,345.66	44,577,149.23
负债					
应付证券清算款	-	-	-	278,563.54	278,563.54
应付赎回款	-	-	-	1,010,709.02	1,010,709.02
应付管理人报酬	-	-	-	37,387.22	37,387.22
应付托管费	-	-	-	8,225.20	8,225.20

应付交易费用	-	-	-	42,115.85	42,115.85
其他负债	-	-	-	177,502.97	177,502.97
负债总计	-	-	-	1,554,503.80	1,554,503.80
利率敏感度缺口	2,899,803.57	-	-	-40,122,841.86	43,022,645.43
上年度末 2017 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	3,668,325.59	-	-	-	3,668,325.59
存出保证金	50,640.61	-	-	-	50,640.61
交易性金融资产	-	-	-	-48,681,173.99	48,681,173.99
应收证券清算款	-	-	-	430,992.53	430,992.53
应收利息	-	-	-	1,821.61	1,821.61
应收股利	-	-	-	6,470.77	6,470.77
应收申购款	-	-	-	9,069.58	9,069.58
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,718,966.20	-	-	-49,129,528.48	52,848,494.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	691,913.03	691,913.03
应付管理人报酬	-	-	-	41,664.73	41,664.73
应付托管费	-	-	-	9,166.25	9,166.25
应付交易费用	-	-	-	37,570.99	37,570.99
其他负债	-	-	-	351,736.15	351,736.15
负债总计	-	-	-	1,132,051.15	1,132,051.15
利率敏感度缺口	3,718,966.20	-	-	-47,997,477.33	51,716,443.53

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 2018 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 0.00%（2017 年 12 月 31 日为 0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无影响。

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，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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

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 2018 年 6 月 30 日		上年度末 2017 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	39,942,487.28	92.84	48,681,173.99	94.13
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	39,942,487.28	92.84	48,681,173.99	94.13

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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（2018 年 6 月 30 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）

	业绩比较基准上升 500 基点	1,962,410.15	2,235,984.25
	业绩比较基准下降 500 基点	-1,962,410.15	-2,235,984.25

§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	39,942,487.28	89.60
	其中：股票	39,942,487.28	89.60
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	2,888,629.43	6.48
8	其他各项资产	1,746,032.52	3.92
9	合计	44,577,149.23	100.00

注：其中港股通股票投资（24,874,637.78 元）占总资产比例 55.80%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	1,025,554.00	2.38
C	制造业	2,889,308.00	6.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	675,266.00	1.57
E	建筑业	1,609,802.40	3.74
F	批发和零售业	111,232.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	259,510.00	0.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	277,980.00	0.65

J	金融业	7,494,107.10	17.40
K	房地产业	725,090.00	1.69
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	15,067,849.50	35.02

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期内无积极投资股票

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	198,061.05	0.46
C 消费者常用品	480,149.67	1.12
D 能源	2,964,634.68	6.89
E 金融	14,187,658.13	32.98
F 医疗保健	-	-
G 工业	558,789.82	1.30
H 信息技术	531,220.45	1.23
I 电信服务	1,472,727.08	3.42
J 公用事业	762,689.34	1.77
K 房地产	3,718,707.56	8.64
合计	24,874,637.78	57.82

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	60,000	3,723,129.60	8.65
2	00939	建设银行	518,000	3,166,262.05	7.36
3	01398	工商银行	387,000	1,915,261.84	4.45
4	03988	中国银行	439,000	1,439,770.30	3.35
5	601318	中国平安	22,085	1,293,739.30	3.01
6	00941	中国移动	20,000	1,175,281.40	2.73
7	00386	中国石油化工股份	184,000	1,087,464.10	2.53
8	00883	中国海洋石油	76,000	867,583.62	2.02
9	01299	友邦保险	15,000	867,549.90	2.02
10	600016	民生银行	119,100	833,700.00	1.94
11	601328	交通银行	130,900	751,366.00	1.75
12	00857	中国石油股份	146,000	734,862.82	1.71
13	02318	中国平安	12,000	730,461.84	1.70
14	601166	兴业银行	48,800	702,720.00	1.63
15	601288	农业银行	202,300	695,912.00	1.62
16	601668	中国建筑	124,740	681,080.40	1.58
17	000651	格力电器	12,300	579,945.00	1.35
18	601398	工商银行	108,400	576,688.00	1.34
19	600104	上汽集团	16,300	570,337.00	1.33
20	600028	中国石化	87,200	565,928.00	1.32
21	00001	长和	8,000	561,167.36	1.30
22	00700	腾讯控股	1,600	531,220.45	1.23
23	00016	新鸿基地产五百	5,000	499,115.20	1.16
24	01288	农业银行	160,000	495,068.32	1.15
25	601988	中国银行	115,300	416,233.00	0.97
26	01113	长实集团	7,500	393,938.48	0.92
27	00002	中电控股	5,500	391,830.73	0.91
28	000333	美的集团	7,400	386,428.00	0.90
29	601186	中国铁建	44,100	380,142.00	0.88
30	000002	万科 A	14,400	354,240.00	0.82
31	600048	保利地产	28,300	345,260.00	0.80
32	02628	中国人寿	20,000	341,455.50	0.79
33	601169	北京银行	56,560	341,056.80	0.79
34	02388	中银香港	10,500	327,101.72	0.76
35	00291	华润啤酒	10,000	321,221.10	0.75
36	00019	太古股份公司 A	4,500	315,277.25	0.73
37	00688	中国海外发展	14,000	305,117.89	0.71
38	00762	中国联通	36,000	297,445.68	0.69

39	601601	中国太保	9,200	293,020.00	0.68
40	600519	贵州茅台	400	292,584.00	0.68
41	03328	交通银行	57,000	288,820.77	0.67
42	600030	中信证券	17,400	288,318.00	0.67
43	000001	平安银行	31,700	288,153.00	0.67
44	601818	光大银行	78,200	286,212.00	0.67
45	00011	恒生银行	1,700	281,207.57	0.65
46	600050	中国联通	56,500	277,980.00	0.65
47	01088	中国神华	17,500	274,724.14	0.64
48	600015	华夏银行	36,160	269,392.00	0.63
49	600019	宝钢股份	34,400	267,976.00	0.62
50	601390	中国中铁	35,200	262,944.00	0.61
51	00017	新世界发展	28,000	260,619.07	0.61
52	00006	电能实业	5,500	254,342.19	0.59
53	00267	中信股份	27,000	251,766.52	0.59
54	601857	中国石油	32,200	248,262.00	0.58
55	601006	大秦铁路	26,600	218,386.00	0.51
56	600900	长江电力	13,500	217,890.00	0.51
57	601088	中国神华	10,600	211,364.00	0.49
58	600795	国电电力	80,100	209,862.00	0.49
59	02007	碧桂园	18,000	209,426.04	0.49
60	601939	建设银行	31,800	208,290.00	0.48
61	00998	中信银行	49,000	202,841.43	0.47
62	03333	中国恒大	12,000	202,344.00	0.47
63	00066	港铁公司	5,500	201,247.97	0.47
64	01928	金沙中国有限公司	5,600	198,061.05	0.46
65	00004	九龙仓集团	9,000	191,215.08	0.44
66	02799	中国华融	99,000	189,469.86	0.44
67	000858	五粮液	2,400	182,400.00	0.42
68	01658	邮储银行	42,000	180,946.12	0.42
69	01109	华润置地	8,000	178,399.96	0.41
70	600011	华能国际	28,000	178,080.00	0.41
71	600585	海螺水泥	5,300	177,444.00	0.41
72	00288	万洲国际	29,500	158,928.57	0.37
73	600741	华域汽车	6,700	158,924.00	0.37
74	600690	青岛海尔	7,500	144,450.00	0.34
75	601669	中国电建	25,800	138,288.00	0.32
76	00020	会德丰	3,000	138,226.25	0.32

77	00836	华润电力	10,000	116,516.42	0.27
78	00012	恒基地产	3,300	115,462.55	0.27
79	002024	苏宁易购	7,900	111,232.00	0.26
80	00656	复星国际	8,500	105,775.33	0.25
81	00813	世茂房地产	6,000	104,207.16	0.24
82	601766	中国中车	13,300	102,410.00	0.24
83	00101	恒隆地产	7,000	95,489.51	0.22
84	601211	国泰君安	6,300	92,862.00	0.22
85	00960	龙湖地产	4,500	80,242.04	0.19
86	601628	中国人寿	3,500	78,820.00	0.18
87	601998	中信银行	12,500	77,625.00	0.18
88	601618	中国中冶	22,700	75,591.00	0.18
89	601800	中国交建	6,300	71,757.00	0.17
90	600023	浙能电力	14,900	69,434.00	0.16
91	01972	太古地产	2,800	68,459.72	0.16
92	600018	上港集团	6,900	41,124.00	0.10
93	01988	民生银行	8,100	38,311.31	0.09
94	000895	双汇发展	1,000	26,410.00	0.06
95	001979	招商蛇口	1,000	19,050.00	0.04
96	600606	绿地控股	1,000	6,540.00	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	00005	汇丰控股	2,030,273.25	3.93
2	00939	建设银行	1,857,915.87	3.59
3	02888	渣打集团	1,241,921.32	2.40
4	01398	工商银行	1,075,656.84	2.08
5	601318	中国平安	903,715.00	1.75
6	03988	中国银行	679,156.73	1.31
7	00386	中国石油化工股份	657,551.31	1.27

8	00941	中国移动	527,665.27	1.02
9	600016	民生银行	519,251.00	1.00
10	00883	中国海洋石油	512,397.18	0.99
11	01299	友邦保险	501,357.10	0.97
12	00857	中国石油股份	409,481.29	0.79
13	601328	交通银行	378,834.00	0.73
14	601668	中国建筑	371,371.00	0.72
15	600028	中国石化	366,005.00	0.71
16	02318	中国平安	341,540.00	0.66
17	600104	上汽集团	335,725.00	0.65
18	000651	格力电器	304,959.00	0.59
19	601166	兴业银行	297,943.00	0.58
20	601288	农业银行	289,316.00	0.56

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	00005	汇丰控股	2,741,487.16	5.30
2	02888	渣打集团	2,260,676.29	4.37
3	00939	建设银行	2,100,650.74	4.06
4	01398	工商银行	1,238,765.04	2.40
5	601318	中国平安	980,832.00	1.90
6	01997	九龙仓置业	947,521.91	1.83
7	00386	中国石油化工股份	914,416.03	1.77
8	00883	中国海洋石油	877,741.07	1.70
9	03988	中国银行	702,147.15	1.36
10	00857	中国石油股份	584,410.29	1.13
11	00941	中国移动	579,927.88	1.12
12	600016	民生银行	489,024.00	0.95
13	601328	交通银行	438,734.00	0.85
14	01299	友邦保险	422,699.35	0.82
15	600104	上汽集团	415,851.00	0.80
16	600028	中国石化	407,987.00	0.79

17	601668	中国建筑	392,681.00	0.76
18	000002	万科 A	363,422.00	0.70
19	000651	格力电器	330,427.00	0.64
20	02318	中国平安	323,766.66	0.63

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	22,348,373.51
卖出股票收入（成交）总额	28,888,057.86

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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，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	11,174.14
2	应收证券清算款	1,586,425.10
3	应收股利	125,638.26
4	应收利息	1,300.80
5	应收申购款	21,494.22
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,746,032.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票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
1,205	34,395.88	1,989,161.57	4.80%	39,457,876.08	95.20%

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	邓富学	905,154.00	18.10%

2	方志坚	816,271.00	16.32%
3	陈虹	277,075.00	5.54%
4	王达志	233,730.00	4.67%
5	刘桂兰	180,657.00	3.61%
6	陈炎臻	125,855.00	2.52%
7	姜圣阳	110,012.00	2.20%
8	薛志容	100,005.00	2.00%
9	盛裕恩	100,004.00	2.00%
10	程伟	100,004.00	2.00%

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	893,622.63	2.16%

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	47,620,997.58
本报告期基金总申购份额	25,428,750.66
减:本报告期基金总赎回份额	31,602,710.59
本报告期基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	41,447,037.65

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

1、2018 年 5 月 30 日，汪献华先生开始担任浦银安盛基金管理有限公司副总经理，详见本公司于 2018 年 6 月 1 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》。

2、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
招商证券	251,236,431.35	100.00%	49,977.11	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：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券 成交总额的比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额 的比例	成交金额	占当期权证 成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-

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) 2017 年第 4 季度报告	报刊及公司官网	2018 年 1 月 22 日
2	关于旗下部分基金参加中泰证券网上交易系统基金申购及基金定	报刊及公司官网	2018 年 1 月 30 日

	投业务费率优惠活动的公告		
3	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为代销机构并开通定投和转换业务及参加费率优惠的公告	报刊及公司官网	2018 年 2 月 6 日
4	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）暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	报刊及公司官网	2018 年 2 月 10 日
5	浦银安盛关于旗下部分基金新增上海有鱼基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司官网	2018 年 2 月 13 日
6	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）暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	报刊及公司官网	2018 年 3 月 28 日
7	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 年年度报告	公司官网	2018 年 3 月 29 日
8	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 年年度报告摘要	报刊及公司官网	2018 年 3 月 29 日
9	关于根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》修改基金合同的公告	报刊及公司官网	2018 年 3 月 30 日
10	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	公司官网	2018 年 3 月 30 日
11	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	公司官网	2018 年 3 月 30 日
12	浦银安盛关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司官网	2018 年 4 月 19 日
13	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）2018 年第 1 季度报告	报刊及公司官网	2018 年 4 月 21 日
14	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）暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	报刊及公司官网	2018 年 4 月 24 日

15	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京恒天明泽基金销售有限公司为代销机构及开通定投业务并参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司官网	2018 年 5 月 7 日
16	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）暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	报刊及公司官网	2018 年 5 月 18 日
17	关于旗下部分基金参加光大证券网上交易系统、手机端基金申购业务费率优惠活动的公告	报刊及公司官网	2018 年 6 月 4 日
18	浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）招募说明书摘要（更新）	报刊及公司官网	2018 年 6 月 9 日
19	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（更新）	公司官网	2018 年 6 月 9 日
20	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）暂停申购、赎回和定期定额投资业务的公告	报刊及公司官网	2018 年 6 月 30 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

经公司董事会决议通过，浦银安盛基金管理有限公司在上海设立分公司。相关工商登记注册手续已办理完毕，并取得营业执照。详见基金管理人于 2018 年 6 月 6 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告》。

§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

2018 年 8 月 27 日