

浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 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.....	7
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
§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.....	14
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.....	15
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.....	42
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	51
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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	52
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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的情况.....	54
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
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.....	60

§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	浦银安盛沪深 300 指数增强
基金主代码	519116
交易代码	519116
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 10 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	127,172,477.70 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，主要通过数量化模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。 本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金以沪深 300 指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在跟踪目标指数的同时，力争获得超越业绩比较基准的收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+1% (1%指年收益率，评价时按期间累计天数折算)。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	中国建设银行股份有限公司

	司		
信息披露负责人	姓名	顾佳	田青
	联系电话	021-23212888	010-67595096
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	010-67595096	
传真	021-23212985	010-66275853	
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	北京市西城区金融大街 25 号	
办公地址	上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼	
邮政编码	200020	100033	
法定代表人	谢伟	田国立	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	4,608,764.28
本期利润	33,025,043.19
加权平均基金份额本期利润	0.2985
本期加权平均净值利润率	20.68%
本期基金份额净值增长率	28.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	68,108,608.22
期末可供分配基金份额利润	0.5356
期末基金资产净值	195,281,085.92
期末基金份额净值	1.536
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	53.60%

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	5.71%	1.05%	5.21%	1.10%	0.50%	-0.05%
过去三个月	0.79%	1.38%	-0.87%	1.45%	1.66%	-0.07%
过去六个月	28.00%	1.40%	26.27%	1.47%	1.73%	-0.07%
过去一年	11.95%	1.41%	9.73%	1.45%	2.22%	-0.04%
过去三年	42.88%	1.02%	24.05%	1.05%	18.83%	-0.03%

自基金合同生效起至今	53.60%	1.38%	33.51%	1.39%	20.09%	-0.01%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

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

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

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

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

期间 T 日收益率（benchmark）按下列公式计算：

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

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛沪深300指数增强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



§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 2019 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 46 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、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、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 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、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。

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	公司指数及量化投资部总监，公司职工监事，公司旗下浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银安盛中证	2010 年 12 月 10 日	-	18	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

	锐联基本面 400 指数证券投资基金、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金以及浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理				公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 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 指数证券投资基金基金经理。2017 年 4 月起，兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。2018 年 9 月起，兼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，兼任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2019 年上半年，实体经济延续了去年下半年的增速下滑态势，今年一、二季度的 GDP 分别是 6.4% 和 6.2%。制造业 PMI 数据回落到荣枯线之下，固定资产投资和消费增速也明显放缓。政府自去年开始及时出台了大力度的减税降负政策，号召加大对中小企业金融支持力度，年初社会融资总额有大幅提升。但自进入 4 月以来，金融监管政策有边际收紧的迹象，此后社融环比增速开始走弱。年初在金融条件显著改善的背景下，A 股迎来了一波快速的大幅上涨，股市交易明显活跃。但进入 4 月份后，金融监管政策的变化抑制了投资者乐观情绪的继续上升，加上贸易冲突升级和包商银行被接管的事件性冲击，投资者的避险情绪上升，股市出现了较大幅度的回调。由于年初市场行情主要由超跌股票的大幅反弹所引发，一些长期有效的量化因子短期表现较弱。进入市场调整期后，质量因子的表现较好。

本报告期内，本基金严格执行量化增强的投资策略，根据因子表现和市场风格变化，对组合进行适度调整。

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 1.536 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.00%，业绩比较基准收益率为 26.27%。

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 2019 年的下半年，美联储降息的概率在提升，部分经济体已经率先开始迈出降息的步伐，国内政策也处于稳中求进的基调。同时，随着 MSCI 指数和富时指数的 A 股纳入比例提升，海外资金对 A 股的配置需求显著增加，国内养老保险等长期资金也会增加股票配置。当前 A 股的基本面还处于阶段性寻底的进程之中，业绩会成为优质上市公司的验金石。我们看好 A 股市场中基本面稳健、股息率高、具有持续成长性的优秀企业的投资机会。

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副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、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》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配比例不低于每次收益分配基准日可供分配利润的 10%；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

报告期内，本基金未实施利润分配。

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：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	16,020,493.77	7,455,775.56
结算备付金		462,412.86	231,556.46
存出保证金		24,591.52	10,398.30
交易性金融资产	6.4.7.2	178,709,097.99	103,211,395.43
其中：股票投资		178,709,097.99	103,211,395.43
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		-	253,474.68
应收利息	6.4.7.5	2,890.38	1,537.31
应收股利		-	-
应收申购款		5,310,908.39	281,722.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		200,530,394.91	111,445,860.63
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 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		4,199,146.02	-
应付赎回款		652,459.36	278,387.89
应付管理人报酬		148,326.15	96,640.11
应付托管费		22,248.94	14,496.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	127,765.12	53,261.16

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	99,363.40	249,460.07
负债合计		5,249,308.99	692,245.24
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	127,172,477.70	92,297,796.19
未分配利润	6.4.7.10	68,108,608.22	18,455,819.20
所有者权益合计		195,281,085.92	110,753,615.39
负债和所有者权益总计		200,530,394.91	111,445,860.63

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.536 元，基金份额总额 127,172,477.70 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		34,501,439.65	-10,037,969.55
1.利息收入		47,656.15	40,386.97
其中：存款利息收入	6.4.7.11	47,597.99	40,386.97
债券利息收入		58.16	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,969,141.56	5,835,384.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,934,948.79	4,719,007.45
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	25,164.37	-
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	2,009,028.40	1,116,376.72
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,416,278.91	-15,963,838.09
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	68,363.03	50,097.40
减：二、费用		1,476,396.46	1,268,487.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	788,223.85	690,380.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	118,233.58	103,557.07
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	329,506.58	255,008.97
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.15	-
7. 其他费用	6.4.7.20	240,432.30	219,540.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,025,043.19	-11,306,456.82
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,025,043.19	-11,306,456.82

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 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）	92,297,796.19	18,455,819.20	110,753,615.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	33,025,043.19	33,025,043.19
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）	34,874,681.51	16,627,745.83	51,502,427.34
其中：1.基金申购款	71,090,176.09	33,779,320.03	104,869,496.12
2.基金赎回款	-36,215,494.58	-17,151,574.20	-53,367,068.78
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）	127,172,477.70	68,108,608.22	195,281,085.92
项目	上年度可比期间 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）	97,327,898.23	47,757,680.68	145,085,578.91
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,306,456.82	-11,306,456.82
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）	-11,360,568.01	-4,447,132.00	-15,807,700.01
其中：1.基金申购款	21,521,365.93	11,094,764.33	32,616,130.26
2.基金赎回款	-32,881,933.94	-15,541,896.33	-48,423,830.27
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）	85,967,330.22	32,004,091.86	117,971,422.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 郁蓓华	_____ 郁蓓华	_____ 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

浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2010]961 号文批准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》

负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集 814,650,876.35 元，经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2010)第 393 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2010 年 12 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 815,083,164.39 份基金份额，其中认购资金利息折合 432,288.04 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》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、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%-10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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。本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率 \times 95%+1%(指 年收益率，评价时按期间累计天数折算)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本 准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券 投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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》、《浦银安盛沪深 300 指数 增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 年 1 月 1 日至 2019 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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

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费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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	16,020,493.77
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：	16,020,493.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	159,463,393.14	178,709,097.99	19,245,704.85
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	159,463,393.14	178,709,097.99	19,245,704.85

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债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	2,693.10
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	187.29
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	9.99
合计	2,890.38

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 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	127,765.12
银行间市场应付交易费用	-
合计	127,765.12

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	873.01
预提费用	91,293.64
指数使用费用	7,196.75
-	-
合计	99,363.40

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	92,297,796.19	92,297,796.19
本期申购	71,090,176.09	71,090,176.09
本期赎回(以“-”号填列)	-36,215,494.58	-36,215,494.58
- 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	127,172,477.70	127,172,477.70

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	51,369,340.88	-32,913,521.68	18,455,819.20
本期利润	4,608,764.28	28,416,278.91	33,025,043.19
本期基金份额交易产生的变动数	19,381,755.21	-2,754,009.38	16,627,745.83
其中：基金申购款	39,637,013.92	-5,857,693.89	33,779,320.03
基金赎回款	-20,255,258.71	3,103,684.51	-17,151,574.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	75,359,860.37	-7,251,252.15	68,108,608.22

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	42,462.46
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	1,702.09
其他	3,433.44
合计	47,597.99

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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	94,509,052.52
减：卖出股票成本总额	90,574,103.73
买卖股票差价收入	3,934,948.79

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**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	25,164.37
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	25,164.37

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	253,623.89
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	228,400.00
减：应收利息总额	59.52
买卖债券差价收入	25,164.37

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——赎回差价收入。

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——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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——买卖贵金属差价收入。

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——赎回差价收入。

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——申购差价收入。

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——买卖权证差价收入。

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——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,009,028.40
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,009,028.40

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	28,416,278.91
——股票投资	28,416,278.91
——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	28,416,278.91

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	43,078.16
转换费收入	25,284.87
合计	68,363.03

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	329,506.58
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中： 申购费	-
赎回费	-
合计	329,506.58

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	61,540.86
银行费用	1,261.85
指数使用费	147,876.81
债券帐户维护费	-

其他	-
合计	240,432.30

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
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（中国建设银行）	基金托管人、基金代销机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金管理人的控股股东、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

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 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	788,223.85	690,380.26
其中：支付销售机构的客户维护费	261,420.85	246,167.26

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	118,233.58	103,557.07

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	16,020,493.77	42,462.46	11,357,784.07	39,410.56

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行股份有限公司保管，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无其他关联交易事项。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

注：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（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股流通受限	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

300788	中信出版	2019 年 6 月 27 日	2019 年 7 月 5 日	新股流 通受限	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-
--------	------	-----------------------	-------------------------	------------	-------	-------	-------	-----------	-----------	---

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%—10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层级的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部的风险管理；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，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中国建设银行，因而与该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 2019 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% (2018 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：于 2019 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% (2018 年 12 月 31 日：0%)。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：截止 2019 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 2019 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% (2018 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 2019 年 6 月 30 日，本基金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 2019 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》(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 2019 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	16,020,493.77	-	-	-	16,020,493.77
结算备付金	462,412.86	-	-	-	462,412.86
存出保证金	24,591.52	-	-	-	24,591.52
交易性金融资产	-	-	-	178,709,097.99	178,709,097.99
应收利息	-	-	-	2,890.38	2,890.38
应收申购款	-	-	-	5,310,908.39	5,310,908.39
资产总计	16,507,498.15	-	-	184,022,896.76	200,530,394.91
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,199,146.02	4,199,146.02
应付赎回款	-	-	-	652,459.36	652,459.36
应付管理人报酬	-	-	-	148,326.15	148,326.15
应付托管费	-	-	-	22,248.94	22,248.94
应付交易费用	-	-	-	127,765.12	127,765.12
其他负债	-	-	-	99,363.40	99,363.40
负债总计	-	-	-	5,249,308.99	5,249,308.99
利率敏感度缺口	16,507,498.15	-	-	-178,773,587.77	195,281,085.92
上年度末 2018 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	7,455,775.56	-	-	-	7,455,775.56
结算备付金	231,556.46	-	-	-	231,556.46
存出保证金	10,398.30	-	-	-	10,398.30
交易性金融资产	-	-	-	103,211,395.43	103,211,395.43
应收证券清算款	-	-	-	253,474.68	253,474.68
应收利息	-	-	-	1,537.31	1,537.31
应收申购款	-	-	-	281,722.89	281,722.89
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,697,730.32	-	-	103,748,130.31	111,445,860.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	278,387.89	278,387.89
应付管理人报酬	-	-	-	96,640.11	96,640.11
应付托管费	-	-	-	14,496.01	14,496.01
应付交易费用	-	-	-	53,261.16	53,261.16
其他负债	-	-	-	249,460.07	249,460.07

负债总计	-	-	-	692,245.24	692,245.24
利率敏感度缺口	7,697,730.32	-	-	-103,055,885.07	110,753,615.39

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 2019 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% (2018 年 12 月 31 日：0.00%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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均以人民币计价，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；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。

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%—10%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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	上年度末
----	-----	------

	2019 年 6 月 30 日		2018 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	178,709,097.99	91.51	103,211,395.43	93.19
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	178,709,097.99	91.51	103,211,395.43	93.19

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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
		业绩比较基准上升 500 基点	8,385,808.26
业绩比较基准下降 500 基点	-8,385,808.26	-5,084,093.74	

§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	178,709,097.99	89.12
	其中：股票	178,709,097.99	89.12
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	16,482,906.63	8.22
8	其他各项资产	5,338,390.29	2.66
9	合计	200,530,394.91	100.00

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	484,110.00	0.25
B	采矿业	8,803,237.06	4.51
C	制造业	72,659,885.93	37.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,861,464.90	2.49
E	建筑业	6,368,872.36	3.26
F	批发和零售业	4,485,691.00	2.30
G	交通运输、仓储和邮政业	8,439,086.33	4.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,092,783.32	3.12

J	金融业	51,982,742.40	26.62
K	房地产业	8,579,898.31	4.39
L	租赁和商务服务业	2,730,823.80	1.40
M	科学研究和技术服务业	485,408.00	0.25
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	776,634.69	0.40
R	文化、体育和娱乐业	1,572,486.00	0.81
S	综合	-	-
	合计	178,323,124.10	91.32

7.2.2 期末积极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	116,017.55	0.06
C	制造业	173,376.04	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.02
K	房地产业	-	-
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	385,973.89	0.20

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	142,048	12,586,873.28	6.45
2	600519	贵州茅台	6,149	6,050,616.00	3.10
3	600036	招商银行	134,123	4,825,745.54	2.47
4	000858	五粮液	27,569	3,251,763.55	1.67
5	601166	兴业银行	174,190	3,185,935.10	1.63
6	000651	格力电器	53,300	2,931,500.00	1.50
7	601398	工商银行	431,719	2,542,824.91	1.30
8	600887	伊利股份	73,316	2,449,487.56	1.25
9	601328	交通银行	384,014	2,350,165.68	1.20
10	000333	美的集团	42,455	2,201,716.30	1.13
11	600585	海螺水泥	49,958	2,073,257.00	1.06
12	601668	中国建筑	330,977	1,903,117.75	0.97
13	600016	民生银行	288,030	1,828,990.50	0.94
14	600030	中信证券	74,024	1,762,511.44	0.90
15	601888	中国国旅	19,672	1,743,922.80	0.89
16	600031	三一重工	130,100	1,701,708.00	0.87
17	601288	农业银行	459,904	1,655,654.40	0.85
18	600276	恒瑞医药	24,537	1,619,442.00	0.83
19	601601	中国太保	43,073	1,572,595.23	0.81
20	600900	长江电力	82,751	1,481,242.90	0.76
21	600028	中国石化	260,800	1,426,576.00	0.73
22	000568	泸州老窖	17,500	1,414,525.00	0.72
23	601899	紫金矿业	362,800	1,367,756.00	0.70
24	601818	光大银行	349,173	1,330,349.13	0.68
25	000002	万科 A	47,311	1,315,718.91	0.67

26	600570	恒生电子	18,940	1,290,761.00	0.66
27	600009	上海机场	15,002	1,256,867.56	0.64
28	601088	中国神华	61,037	1,243,934.06	0.64
29	601006	大秦铁路	152,573	1,234,315.57	0.63
30	000001	平安银行	89,422	1,232,235.16	0.63
31	600104	上汽集团	48,261	1,230,655.50	0.63
32	000157	中联重科	203,100	1,220,631.00	0.63
33	600048	保利地产	95,030	1,212,582.80	0.62
34	601211	国泰君安	66,000	1,211,100.00	0.62
35	600809	山西汾酒	17,500	1,208,375.00	0.62
36	601169	北京银行	195,946	1,158,040.86	0.59
37	600566	济川药业	38,400	1,156,224.00	0.59
38	002007	华兰生物	37,800	1,152,522.00	0.59
39	601988	中国银行	300,400	1,123,496.00	0.58
40	601766	中国中车	134,610	1,088,994.90	0.56
41	600436	片仔癀	9,400	1,082,880.00	0.55
42	600837	海通证券	76,006	1,078,525.14	0.55
43	600438	通威股份	76,600	1,076,996.00	0.55
44	600660	福耀玻璃	46,579	1,058,740.67	0.54
45	002142	宁波银行	43,510	1,054,682.40	0.54
46	600362	江西铜业	66,300	1,043,562.00	0.53
47	600089	特变电工	143,700	1,041,825.00	0.53
48	002032	苏泊尔	13,700	1,038,871.00	0.53
49	002304	洋河股份	8,480	1,030,828.80	0.53
50	002468	申通快递	40,500	1,010,070.00	0.52
51	600271	航天信息	43,700	1,007,285.00	0.52
52	002475	立讯精密	40,630	1,007,217.70	0.52
53	600309	万华化学	23,421	1,002,184.59	0.51
54	000338	潍柴动力	81,200	997,948.00	0.51
55	600522	中天科技	107,300	983,941.00	0.50
56	600690	海尔智家	56,324	973,841.96	0.50
57	000895	双汇发展	39,090	972,950.10	0.50
58	002311	海大集团	31,300	967,170.00	0.50
59	601229	上海银行	80,600	955,110.00	0.49
60	600023	浙能电力	213,700	944,554.00	0.48
61	600153	建发股份	104,700	929,736.00	0.48
62	600219	南山铝业	408,450	923,097.00	0.47
63	002146	荣盛发展	97,300	913,647.00	0.47
64	002120	韵达股份	29,610	912,580.20	0.47

65	000963	华东医药	35,100	911,196.00	0.47
66	601857	中国石油	131,400	904,032.00	0.46
67	601117	中国化学	149,200	898,184.00	0.46
68	600926	杭州银行	107,700	897,141.00	0.46
69	002601	龙蟠佰利	60,200	892,766.00	0.46
70	600999	招商证券	52,156	891,346.04	0.46
71	601018	宁波港	201,600	885,024.00	0.45
72	002555	三七互娱	64,000	867,200.00	0.44
73	601898	中煤能源	176,600	847,680.00	0.43
74	000538	云南白药	10,100	842,542.00	0.43
75	600547	山东黄金	20,400	839,868.00	0.43
76	600015	华夏银行	108,578	836,050.60	0.43
77	600233	圆通速递	67,400	831,042.00	0.43
78	600919	江苏银行	113,500	824,010.00	0.42
79	601009	南京银行	98,464	813,312.64	0.42
80	601390	中国中铁	124,400	811,088.00	0.42
81	002602	世纪华通	73,120	798,470.40	0.41
82	000776	广发证券	57,611	791,575.14	0.41
83	002024	苏宁易购	68,100	781,788.00	0.40
84	300015	爱尔眼科	25,077	776,634.69	0.40
85	000063	中兴通讯	23,700	770,961.00	0.39
86	601688	华泰证券	33,000	736,560.00	0.38
87	000100	TCL 集团	217,400	723,942.00	0.37
88	002271	东方雨虹	31,900	722,854.00	0.37
89	600741	华域汽车	33,064	714,182.40	0.37
90	600886	国投电力	90,700	704,739.00	0.36
91	601669	中国电建	132,789	702,453.81	0.36
92	002236	大华股份	47,900	695,508.00	0.36
93	601155	新城控股	17,400	692,694.00	0.35
94	600383	金地集团	57,020	680,248.60	0.35
95	600489	中金黄金	65,900	676,793.00	0.35
96	300122	智飞生物	15,700	676,670.00	0.35
97	600352	浙江龙盛	42,800	674,956.00	0.35
98	000069	华侨城 A	96,000	667,200.00	0.34
99	002938	鹏鼎控股	22,500	660,600.00	0.34
100	300033	同花顺	6,700	659,012.00	0.34
101	002422	科伦药业	22,100	657,033.00	0.34
102	002410	广联达	19,800	651,222.00	0.33
103	002352	顺丰控股	19,100	648,636.00	0.33

104	601607	上海医药	35,600	646,140.00	0.33
105	600795	国电电力	253,300	643,382.00	0.33
106	300059	东方财富	47,316	641,131.80	0.33
107	601985	中国核电	115,300	641,068.00	0.33
108	002179	中航光电	19,090	638,751.40	0.33
109	600637	东方明珠	59,700	629,238.00	0.32
110	600606	绿地控股	91,300	623,579.00	0.32
111	300003	乐普医疗	26,900	619,238.00	0.32
112	601877	正泰电器	26,600	614,194.00	0.31
113	000703	恒逸石化	44,900	613,334.00	0.31
114	600061	国投资本	43,300	606,633.00	0.31
115	000596	古井贡酒	5,100	604,401.00	0.31
116	601618	中国中冶	197,500	600,400.00	0.31
117	600398	海澜之家	65,600	594,992.00	0.30
118	601012	隆基股份	25,736	594,758.96	0.30
119	000425	徐工机械	132,700	591,842.00	0.30
120	600050	中国联通	96,000	591,360.00	0.30
121	000630	铜陵有色	239,900	590,154.00	0.30
122	600893	航发动力	25,700	583,647.00	0.30
123	600663	陆家嘴	37,000	573,500.00	0.29
124	601998	中信银行	95,800	571,926.00	0.29
125	600332	白云山	13,900	569,483.00	0.29
126	601298	青岛港	67,500	566,325.00	0.29
127	601919	中远海控	111,300	558,726.00	0.29
128	600038	中直股份	13,500	553,770.00	0.28
129	601319	中国人保	58,200	552,318.00	0.28
130	600188	兖州煤业	50,800	552,196.00	0.28
131	601577	长沙银行	57,600	549,504.00	0.28
132	600085	同仁堂	18,900	548,100.00	0.28
133	600170	上海建工	145,600	547,456.00	0.28
134	002739	万达电影	29,500	543,980.00	0.28
135	600299	安迪苏	52,400	543,388.00	0.28
136	000629	攀钢钒钛	159,200	539,688.00	0.28
137	601992	金隅集团	143,200	538,432.00	0.28
138	600068	葛洲坝	86,360	538,022.80	0.28
139	600340	华夏幸福	16,500	537,405.00	0.28
140	002010	传化智联	71,200	536,136.00	0.27
141	601021	春秋航空	11,900	535,500.00	0.27
142	300413	芒果超媒	13,000	533,650.00	0.27

143	002508	老板电器	19,600	531,944.00	0.27
144	600688	上海石化	102,600	529,416.00	0.27
145	600704	物产中大	97,400	527,908.00	0.27
146	603833	欧派家居	4,900	527,338.00	0.27
147	603799	华友钴业	24,550	523,160.50	0.27
148	601727	上海电气	97,100	522,398.00	0.27
149	600346	恒力石化	41,720	507,315.20	0.26
150	600733	北汽蓝谷	61,400	507,164.00	0.26
151	000709	河钢股份	168,000	502,320.00	0.26
152	601997	贵阳银行	57,580	498,067.00	0.26
153	000402	金融街	63,300	496,272.00	0.25
154	600977	中国电影	31,600	494,856.00	0.25
155	601216	君正集团	147,800	486,262.00	0.25
156	603259	药明康德	5,600	485,408.00	0.25
157	000671	阳光城	74,900	485,352.00	0.25
158	300498	温氏股份	13,500	484,110.00	0.25
159	600339	中油工程	113,800	480,236.00	0.25
160	000786	北新建材	26,200	475,006.00	0.24
161	601238	广汽集团	43,100	471,083.00	0.24
162	601989	中国重工	84,482	469,719.92	0.24
163	601808	中海油服	48,200	464,166.00	0.24
164	601628	中国人寿	16,200	458,784.00	0.23
165	601336	新华保险	8,207	451,631.21	0.23
166	601828	美凯龙	37,100	450,765.00	0.23
167	002230	科大讯飞	13,473	447,842.52	0.23
168	600025	华能水电	109,700	446,479.00	0.23
169	002773	康弘药业	13,430	442,115.60	0.23
170	601838	成都银行	47,100	415,893.00	0.21
171	600998	九州通	31,700	391,812.00	0.20
172	000656	金科股份	63,300	381,699.00	0.20
173	002594	比亚迪	7,361	373,349.92	0.19
174	000661	长春高新	1,100	371,800.00	0.19
175	601186	中国铁建	37,000	368,150.00	0.19
176	600958	东方证券	30,200	322,536.00	0.17
177	600406	国电南瑞	16,900	315,016.00	0.16
178	000166	申万宏源	62,000	310,620.00	0.16
179	601933	永辉超市	29,100	297,111.00	0.15
180	000876	新希望	16,700	290,079.00	0.15

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600968	海油发展	32,681	116,017.55	0.06
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
4	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.02
5	603863	松炆资源	1,459	33,673.72	0.02
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.02
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	0.01

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	601318	中国平安	5,891,809.00	5.32
2	600519	贵州茅台	2,144,221.00	1.94
3	601166	兴业银行	1,900,404.00	1.72
4	600036	招商银行	1,840,794.16	1.66
5	601398	工商银行	1,700,278.00	1.54
6	601328	交通银行	1,685,802.00	1.52
7	000651	格力电器	1,577,945.00	1.42
8	600566	济川药业	1,253,098.00	1.13
9	600028	中国石化	1,193,863.00	1.08
10	601668	中国建筑	1,190,847.00	1.08
11	600023	浙能电力	1,169,833.00	1.06
12	601899	紫金矿业	1,120,622.69	1.01
13	600606	绿地控股	1,118,775.00	1.01

14	000157	中联重科	1,101,999.00	1.00
15	601818	光大银行	1,091,102.00	0.99
16	600016	民生银行	1,089,140.00	0.98
17	600887	伊利股份	1,079,252.00	0.97
18	000963	华东医药	1,075,907.00	0.97
19	600362	江西铜业	1,074,591.00	0.97
20	600585	海螺水泥	1,052,388.00	0.95

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	601318	中国平安	2,455,521.00	2.22
2	603288	海天味业	1,682,239.00	1.52
3	000651	格力电器	1,469,747.00	1.33
4	600352	浙江龙盛	1,383,838.00	1.25
5	002001	新和成	1,361,487.00	1.23
6	002415	海康威视	1,284,138.75	1.16
7	002572	索菲亚	1,234,467.00	1.11
8	601138	工业富联	1,232,371.08	1.11
9	600019	宝钢股份	1,183,945.00	1.07
10	000898	鞍钢股份	1,168,814.00	1.06
11	600018	上港集团	1,167,971.00	1.05
12	601166	兴业银行	1,149,965.00	1.04
13	601225	陕西煤业	1,079,672.00	0.97
14	600516	方大炭素	1,019,151.00	0.92
15	600016	民生银行	999,361.00	0.90
16	600011	华能国际	981,514.00	0.89
17	603156	养元饮品	961,887.00	0.87
18	002493	荣盛石化	947,948.00	0.86
19	601991	大唐发电	926,034.62	0.84
20	603260	合盛硅业	885,552.00	0.80

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	137,655,527.38
卖出股票收入（成交）总额	94,509,052.52

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

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

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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	24,591.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,890.38
5	应收申购款	5,310,908.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	5,338,390.29
---	----	--------------

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：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.02	新股锁定

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
5,335	23,837.39	37,690,211.92	29.64%	89,482,265.78	70.36%

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	682,380.40	0.54%

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2010 年 12 月 10 日）基金份额总额	815,083,164.39
本报告期期初基金份额总额	92,297,796.19
本报告期期间基金总申购份额	71,090,176.09
减:本报告期期间基金总赎回份额	36,215,494.58
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	127,172,477.70

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

报告期内基金管理人未发生重大人事变动。托管人中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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	
中金	1	148,845,364.62	64.61%	138,620.13	64.61%	-
中山证券	1	48,383,589.45	21.00%	45,059.41	21.00%	-
长江证券	1	33,150,443.34	14.39%	30,873.13	14.39%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

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

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中金	67,300.50	26.54%	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	186,323.39	73.46%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京百度百盈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	2019 年 1 月 5 日
2	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	报刊及公司官网	2019 年 1 月 21 日
3	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书摘要（更新）2018 年第 2 号	报刊及公司官网	2019 年 1 月 24 日
4	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书正文（更新）2018 年第 2 号	公司官网	2019 年 1 月 24 日
5	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告摘要	报刊及公司官网	2019 年 3 月 27 日

6	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2018 年年度报告	公司官网	2019 年 3 月 27 日
7	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行手机银行基金申购及基金定投业务费率优惠活动、部分基金开通基金定投的公告	报刊及公司官网	2019 年 3 月 29 日
8	浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	报刊及公司官网	2019 年 4 月 19 日
9	浦银安盛基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司基金定投业务定投起点的公告	报刊及公司官网	2019 年 5 月 15 日
10	关于新增民生银行为浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金代销机构的公告	报刊及公司官网	2019 年 6 月 11 日
11	关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券有限公司为代销机构及参加其费率优惠活动的公告	报刊及公司官网	2019 年 6 月 27 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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金设立的文件
- 2、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、本报告期内在中国证监会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

2019 年 8 月 23 日