

# 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 2019 年半年度报告摘要

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：交通银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 日

## §1 重要提示

### 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。

基金托管人交通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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 29 日起至 6 月 30 日止。

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	浦银安盛中证高股息 ETF
场内简称	高股息
基金主代码	512590
交易代码	512590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 1 月 29 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	34,503,444.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 3 月 8 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
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	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证高股息精选指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	陆志俊
	联系电话	021-23212888	95559

	电子邮箱	compliance@py-axa.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95559
传真		021-23212985	021-62701216

## 2.4 信息披露方式

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

## §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29日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	69,668.36
本期利润	-661,480.49
加权平均基金份额本期利润	-0.0052
本期基金份额净值增长率	1.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0129
期末基金资产净值	34,946,929.61
期末基金份额净值	1.0129

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 2019 年 1 月 29 日，以上财务指标中“本期”指 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止期间。

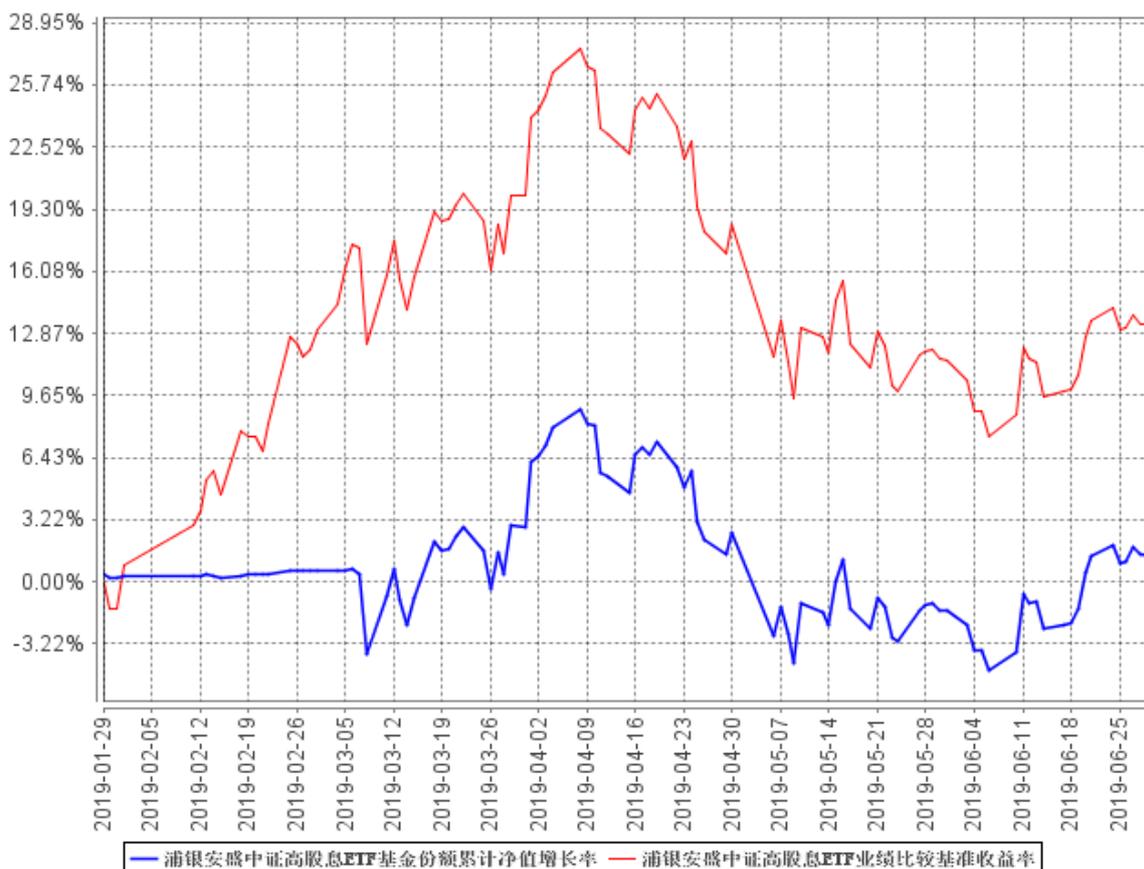
## 3.2 基金净值表现

### 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	2.78%	1.10%	1.70%	1.13%	1.08%	-0.03%
过去三个月	-1.53%	1.45%	-5.55%	1.55%	4.02%	-0.10%
自基金合同生效起至今	1.29%	1.37%	13.37%	1.61%	-12.08%	-0.24%

### 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

浦银安盛中证高股息ETF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2019年1月29日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满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 2019 年 1 月 29 日至 2019 年 7 月 28 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 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	2019 年 1 月 29 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

	安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金、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			程部研究员、研究部主管。2007 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 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。
高钢杰	公司旗下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	2019 年 3 月 19 日	-	8 高钢杰先生，中国科学院天体物理博士。2010 年 10 月至 2014 年 3 月在上海东证期货研究所、国泰君安期货研究所担任量化投资研究员。2014 年 3 月至 2018 年 10 月在中国工商银行总行贵金属业务部工作，历任产品研发经理、代客交易经理。2018 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司，参与 ETF 业务筹备工作。2019 年 3 月起担任浦银安盛中证高股息精选

					交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---------------------

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

2019 年上半年，A 股行情冲高回落并于 6 月企稳反弹，期间国内政策、经济基本面及中美贸易谈判进展成为市场主导因素。一季度，国内政策放松、经济企稳以及中美贸易谈判持续进行，投资者情绪回暖，推动风险资产价格上行；二季度，中美贸易摩擦再起，叠加经济下行风险加大、积极政策推进不及预期，国内资产市场呈现回调。在 G20 峰会上，中美两国领导人达成一致意见，决定重启贸易谈判且美方不再对中国产品加征新的关税，外部环境企稳推动资产价格震荡上行。

作为投资于中证高股息精选指数的被动型投资产品，本基金采取完全复制指数的投资策略，严格控制每日基金净值与业绩基准波动的偏差，使基金回报紧密跟踪目标指数的收益，降低跟踪偏离度。本基金以获取指数长期增长及分红收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的前提下，构建紧密跟踪标的指数的投资组合。

从基金上市至上半年末，本基金的累计跟踪偏离度为 4.311%，实现了正向的收益增厚；本基金日均绝对跟踪偏离度为 0.105%，日均跟踪误差为 0.138%，较好地控制了本基金的跟踪精度。

##### 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 1.0129 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.29%，业绩比较基准收益率为 13.37%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，市场关注的焦点在中美贸易谈判、国内经济状况及政策应对。美国经济下行压力较大，美联储降息确定性加强，为中美贸易谈判带来缓和期，也强化了央行货币宽松的预期。国内宏观经济仍处与下行探底阶段，虽下行速率放缓，但在稳增长、稳就业的压力下，不排除下半年逆周期积极政策重新加码。政策逻辑仍将是相机抉择，对冲经济下行风险。对于 A 股市场，我们的观点是在 6 月行情企稳的基础上，下半年资产价格震荡上行的概率较大，适合长期配置权益资产。

#### 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》约定，在符合有关基金分红条件的前提下，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式采取现金分红方式；

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

2019 半年度，基金托管人在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的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

2019 半年度，浦银安盛基金管理有限公司在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投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

### 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

2019 半年度，由浦银安盛基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关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的半年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金

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	856,964.39	-

结算备付金		97,194.68	-
存出保证金		185,358.95	-
交易性金融资产	6.4.7.2	34,521,343.14	-
其中：股票投资		34,521,343.14	-
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		9,290.36	-
应收利息	6.4.7.5	253.16	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		35,670,404.68	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年6月30日</b>	<b>上年度末 2018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		490,206.08	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,174.28	-
应付托管费		3,034.87	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	83,339.48	-
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	131,720.36	-
负债合计		723,475.07	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	34,503,444.00	-
未分配利润	6.4.7.10	443,485.61	-
所有者权益合计		34,946,929.61	-
负债和所有者权益总计		35,670,404.68	-

注：1. 报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0129 元，基金份额总额 34,503,444.00 份。

2. 本基金《基金合同》生效日为 2019 年 1 月 29 日，至报告期末，合同成立未满一年。
3. 本基金《基金合同》生效日为 2019 年 1 月 29 日，无上年度可比期间。
4. 本财务报表的实际编制期间自 2019 年 1 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日止。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 29 日 (基金合同生效日) 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
<b>一、收入</b>		673,234.05	-
1.利息收入		837,873.64	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	837,873.64	-
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		910,431.26	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-34,288.15	-
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	944,719.41	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-731,148.85	-
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	-343,922.00	-
<b>减：二、费用</b>		1,334,714.54	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	275,046.52	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	55,009.33	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	837,563.89	-

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	167,094.80	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-661,480.49	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-661,480.49	-

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)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）	349,503,444.00	-	349,503,444.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-661,480.49	-661,480.49
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）	-315,000,000.00	1,104,966.10	-313,895,033.90
其中：1. 基金申购款	74,000,000.00	2,236,798.15	76,236,798.15
2. 基金赎回款	-389,000,000.00	-1,131,832.05	-390,131,832.05
五、期末所有者权益（基金净值）	34,503,444.00	443,485.61	34,946,929.61
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

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

浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2294号《关于准予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注册的批复》及机构部函[2018]1627号《关于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延期募集备案的回函》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《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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349,502,545.00元(含所募集股票市值),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(2019)第0072号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于2019年1月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为349,503,444.00份基金份额,其中认购资金利息折合899.00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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《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合同》和《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招募说明书》的有关规定,经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]35号核准,本基金349,503,444.00份基金份额于2019年3月8日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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招募说明书》的有关规定,本基金的标的指数为中证高股息精选指数,投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股,该部分资产比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,

现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。为更好地实现投资目标，本基金可能会少量投资非标的指数成份股、债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具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规定)。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为中证高股息精选指数收益率。

#### 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》、《浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间的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 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止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

##### 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 2019 年 1 月 29 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日止期间。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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

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

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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。

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

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

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

#### 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，当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，本基金可以进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值。

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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 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[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 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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、基金代销机构
交通银行股份有限公司	基金托管人、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。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.8.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)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	275,046.52	-
其中：支付销售机构的客户维护费	1,455.38	-

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 0.50% 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 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月29日(基金合同生效日)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	55,009.33	-

注：支付基金托管人交通银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1% 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 × 0.1% / 当年天数。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

### 6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.8.4.1 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 2019 年 01 月 29 日，无上年度可比期间。

##### 6.4.8.4.2 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 2019 年 1 月 29 日，无上年度末可比期间。

##### 6.4.8.5 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 29 日(基金合同生效日) 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
交通银行	856,964.39	160,766.72	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

##### 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.9 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.9.1 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	-

#### 6.4.9.2 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。

#### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

## §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	34,521,343.14	96.78
	其中：股票	34,521,343.14	96.78
7	银行存款和结算备付金合计	954,159.07	2.67
8	其他各项资产	194,902.47	0.55
9	合计	35,670,404.68	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	517,186.00	1.48
B	采矿业	2,622,014.74	7.50

C	制造业	24,744,323.81	70.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	542,504.00	1.55
E	建筑业	160,982.40	0.46
F	批发和零售业	217,624.50	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,735,868.43	10.69
I	信息传输、软件和信息技术服务业	917,275.00	2.62
J	金融业	505,505.00	1.45
N	水利、环境和公共设施管理业	183,013.00	0.52
R	文化、体育和娱乐业	234,872.00	0.67
	合计	34,381,168.88	98.38

### 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（%）
B	采掘业	25,158.85	0.07
C	制造业	62,662.67	0.18
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,482.80	0.05
J	金融业	33,869.94	0.10
	合计	140,174.26	0.40

### 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前十名股票投资明细

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	601088	中国神华	101,373	2,065,981.74	5.91

2	002233	塔牌集团	97,700	1,141,136.00	3.27
3	000895	双汇发展	45,242	1,126,073.38	3.22
4	002601	龙蟠佰利	62,000	919,460.00	2.63
5	600377	宁沪高速	75,665	812,642.10	2.33
6	601006	大秦铁路	96,200	778,258.00	2.23
7	600873	梅花生物	162,300	777,417.00	2.22
8	603328	依顿电子	74,600	766,142.00	2.19
9	600507	方大特钢	73,493	718,761.54	2.06
10	000568	泸州老窖	8,800	711,304.00	2.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

### 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前五名股票投资明细

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	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.10
2	300782	卓胜微	247	26,903.24	0.08
3	600968	海油发展	7,087	25,158.85	0.07
4	603867	新化股份	801	20,673.81	0.06
5	601698	中国卫通	4,715	18,482.80	0.05
6	300594	朗进科技	342	15,085.62	0.04

## 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	000895	双汇发展	14,450,616.76	41.35
2	601088	中国神华	14,437,658.70	41.31
3	002601	龙蟠佰利	12,499,538.90	35.77
4	600507	方大特钢	11,307,003.03	32.35
5	600816	安信信托	9,743,625.60	27.88

6	000726	鲁泰 A	9,504,503.94	27.20
7	000429	粤高速 A	9,474,382.84	27.11
8	600873	梅花生物	9,418,743.70	26.95
9	603328	依顿电子	8,907,465.00	25.49
10	002233	塔牌集团	8,359,929.11	23.92
11	002003	伟星股份	8,295,771.72	23.74
12	600377	宁沪高速	8,061,314.79	23.07
13	002372	伟星新材	7,469,103.90	21.37
14	000568	泸州老窖	7,039,047.92	20.14
15	603766	隆鑫通用	6,841,703.97	19.58
16	002749	国光股份	6,708,509.42	19.20
17	600688	上海石化	6,379,628.25	18.26
18	002516	旷达科技	5,728,255.00	16.39
19	600887	伊利股份	5,689,318.00	16.28
20	600585	海螺水泥	5,542,036.00	15.86
21	002677	浙江美大	5,540,540.19	15.85
22	002128	露天煤业	5,485,688.59	15.70
23	600563	法拉电子	5,071,556.00	14.51
24	002756	永兴特钢	4,957,375.20	14.19
25	600598	北大荒	4,746,527.99	13.58
26	600004	白云机场	4,728,349.00	13.53
27	002597	金禾实业	4,630,657.28	13.25
28	603868	飞科电器	4,611,815.00	13.20
29	002690	美亚光电	4,530,762.00	12.96
30	002322	理工环科	4,509,894.28	12.90
31	603167	渤海轮渡	4,497,185.47	12.87
32	601216	君正集团	4,482,566.83	12.83
33	300146	汤臣倍健	4,399,981.00	12.59
34	601678	滨化股份	4,269,391.92	12.22
35	000786	北新建材	4,166,457.00	11.92
36	600566	济川药业	4,033,236.00	11.54
37	600527	江南高纤	3,958,789.02	11.33
38	002158	汉钟精机	3,905,428.00	11.18
39	002508	老板电器	3,825,342.60	10.95
40	600987	航民股份	3,636,237.00	10.41
41	601238	广汽集团	3,488,624.20	9.98

42	300298	三诺生物	3,409,455.05	9.76
43	002518	科士达	3,178,458.07	9.10
44	600479	千金药业	3,066,592.65	8.77
45	600567	山鹰纸业	3,041,608.97	8.70
46	002737	葵花药业	2,902,153.00	8.30
47	600438	通威股份	2,891,035.66	8.27
48	002479	富春环保	2,884,362.00	8.25
49	002572	索菲亚	2,833,408.00	8.11
50	002043	兔宝宝	2,805,819.00	8.03
51	300394	天孚通信	2,785,929.00	7.97
52	002108	沧州明珠	2,701,845.00	7.73
53	300018	中元股份	2,664,403.00	7.62
54	002626	金达威	2,537,693.00	7.26
55	600160	巨化股份	2,533,203.85	7.25
56	603609	禾丰牧业	2,485,549.34	7.11
57	000544	中原环保	2,484,856.00	7.11
58	002643	万润股份	2,472,202.00	7.07
59	300327	中颖电子	2,469,111.00	7.07
60	600009	上海机场	2,423,911.82	6.94
61	603866	桃李面包	2,313,339.50	6.62
62	600054	黄山旅游	2,310,293.25	6.61
63	002507	涪陵榨菜	2,259,441.00	6.47
64	002019	亿帆医药	2,238,573.86	6.41
65	603899	晨光文具	2,223,515.70	6.36
66	600373	中文传媒	2,218,536.00	6.35
67	600993	马应龙	2,205,610.14	6.31
68	600305	恒顺醋业	2,100,214.40	6.01
69	300088	长信科技	2,098,553.99	6.00
70	601233	桐昆股份	1,974,832.60	5.65
71	600298	安琪酵母	1,972,720.06	5.64
72	002484	江海股份	1,967,374.00	5.63
73	600668	尖峰集团	1,962,900.00	5.62
74	600477	杭萧钢构	1,938,741.00	5.55
75	603808	歌力思	1,910,906.30	5.47
76	002056	横店东磁	1,906,042.00	5.45
77	300497	富祥股份	1,862,230.00	5.33

78	600201	生物股份	1,858,156.20	5.32
79	002008	大族激光	1,792,660.00	5.13
80	002048	宁波华翔	1,701,983.37	4.87
81	300258	精锻科技	1,696,765.35	4.86
82	300113	顺网科技	1,612,010.00	4.61
83	300107	建新股份	1,611,118.00	4.61
84	600867	通化东宝	1,560,437.00	4.47
85	002425	凯撒文化	1,553,287.80	4.44
86	300230	永利股份	1,552,299.00	4.44
87	300343	联创股份	1,418,042.00	4.06
88	300396	迪瑞医疗	1,397,169.30	4.00
89	002057	中钢天源	1,357,108.00	3.88
90	603898	好莱客	1,354,570.00	3.88
91	300009	安科生物	1,349,372.80	3.86
92	002555	三七互娱	1,335,406.18	3.82
93	300304	云意电气	1,288,289.00	3.69
94	601020	华钰矿业	1,208,996.00	3.46
95	002222	福晶科技	1,141,329.00	3.27
96	600062	华润双鹤	976,948.00	2.80
97	002468	申通快递	961,705.80	2.75
98	600233	圆通速递	953,834.00	2.73
99	603027	千禾味业	924,696.00	2.65

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	601006	大秦铁路	22,723,677.00	65.02
2	000895	双汇发展	13,691,662.21	39.18
3	002601	龙麟佰利	11,777,344.00	33.70
4	000726	鲁泰 A	8,702,522.00	24.90
5	000429	粤高速 A	8,623,418.98	24.68
6	002003	伟星股份	7,450,619.25	21.32

7	002233	塔牌集团	7,189,868.00	20.57
8	002372	伟星新材	6,966,141.00	19.93
9	000568	泸州老窖	6,808,167.00	19.48
10	002749	国光股份	6,170,504.39	17.66
11	002516	旷达科技	5,207,630.00	14.90
12	002677	浙江美大	5,103,328.98	14.60
13	002128	露天煤业	4,997,367.00	14.30
14	002756	永兴特钢	4,564,975.00	13.06
15	002690	美亚光电	4,315,283.20	12.35
16	002597	金禾实业	4,307,567.00	12.33
17	002322	理工环科	4,268,096.00	12.21
18	300146	汤臣倍健	4,184,887.00	11.97
19	000786	北新建材	3,837,927.00	10.98
20	002158	汉钟精机	3,603,007.00	10.31
21	002508	老板电器	3,482,261.14	9.96
22	300298	三诺生物	3,090,409.76	8.84
23	002518	科士达	2,819,943.00	8.07
24	002737	葵花药业	2,698,737.00	7.72
25	002479	富春环保	2,616,511.00	7.49
26	002043	兔宝宝	2,578,817.50	7.38
27	300394	天孚通信	2,558,112.00	7.32
28	002572	索菲亚	2,544,429.00	7.28
29	300018	中元股份	2,520,118.00	7.21
30	002108	沧州明珠	2,497,951.00	7.15
31	002626	金达威	2,290,543.78	6.55
32	000544	中原环保	2,276,229.25	6.51
33	002643	万润股份	2,271,005.16	6.50
34	300327	中颖电子	2,264,559.70	6.48
35	002507	涪陵榨菜	2,162,507.51	6.19
36	002019	亿帆医药	2,136,448.13	6.11
37	300088	长信科技	1,965,037.00	5.62
38	002484	江海股份	1,852,497.30	5.30
39	002056	横店东磁	1,739,181.00	4.98
40	300497	富祥股份	1,706,907.00	4.88
41	002008	大族激光	1,674,499.00	4.79
42	300258	精锻科技	1,587,196.00	4.54
43	002425	凯撒文化	1,563,506.00	4.47
44	002048	宁波华翔	1,528,510.00	4.37

45	300113	顺网科技	1,487,658.00	4.26
46	300107	建新股份	1,486,822.00	4.25
47	300230	永利股份	1,412,423.60	4.04
48	300396	迪瑞医疗	1,315,213.00	3.76
49	002057	中钢天源	1,304,748.00	3.73
50	300343	联创股份	1,291,492.00	3.70
51	300009	安科生物	1,246,953.00	3.57
52	002555	三七互娱	1,216,826.00	3.48
53	300304	云意电气	1,159,191.00	3.32
54	002222	福晶科技	1,111,449.00	3.18
55	002468	申通快递	913,846.00	2.61

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	389,121,256.79
卖出股票收入（成交）总额	218,426,572.83

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 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。

#### 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 7.9 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 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

本基金投资的前十名证券的发行主体除龙蟒佰利以外不存在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

2018 年 11 月 23 日，龙蟒佰利集团股份有限公司控股子公司四川龙蟒钛业股份有限公司收到绵竹市环境保护局出具的《行政处罚决定书》（竹环罚决字【2018】53 号）。龙蟒佰利联集

团股份有限公司控股子公司四川龙蟒钛业股份有限公司收到绵竹市环境保护局（以下简称“绵竹市环保局”）出具的《行政处罚决定书》（竹环罚决字【2018】67号）。

### 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	185,358.95
2	应收证券清算款	9,290.36
4	应收利息	253.16
9	合计	194,902.47

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	0.10	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

**8.1.1 本基金的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
644	53,576.78	4,078,115.00	11.82%	30,425,329.00	88.18%

**8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构****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	何震	6,000,000.00	17.39%
2	刘伟	4,000,000.00	11.59%
3	华融证券—工行—华融稳健成长 1 号基金精选集合资产管理计划	1,153,100.00	3.34%
4	柴蕾	1,000,000.00	2.90%
5	中信证券股份有限公司	841,315.00	2.44%
6	骆世晔	783,500.00	2.27%
7	华泰证券股份有限公司	747,500.00	2.17%
8	申万宏源证券有限公司	606,100.00	1.76%
9	周孟宇	600,000.00	1.74%
10	王丽华	561,600.00	1.63%

**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	0.00	0.0000%

**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

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 1 月 29 日）基金份额总额	349,503,444.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	74,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	389,000,000.00
本报告期期末基金份额总额	34,503,444.00

## §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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
申万宏源	3	384,147,982.31	63.29%	357,760.00	63.29%	-
招商证券	2	222,835,853.65	36.71%	207,528.07	36.71%	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-

国盛证券	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
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

爱建证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

## §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 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999 。

浦银安盛基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日