

浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资 基金 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2020 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 3 月 27 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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	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.....	14
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	22
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.....	22
§5 托管人报告	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	23
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.....	23
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	23
§6 审计报告	24
6.1 审计报告基本信息.....	24
6.2 审计报告的基本内容.....	24
§7 年度财务报表	27
7.1 资产负债表.....	27
7.2 利润表.....	28
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	29
7.4 报表附注.....	30
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况.....	58
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	58
8.3 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.....	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 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.....	69
8.7 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.....	69
8.8 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.....	69

8.9 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.....	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	70
8.12 投资组合报告附注.....	70
§9 基金份额持有人信息.....	72
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	72
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	72
9.3 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.....	72
§10 开放式基金份额变动.....	73
§11 重大事件揭示.....	74
11.1 基金份额持有人大会决议.....	74
11.2 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.....	74
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
11.4 基金投资策略的改变.....	74
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	74
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	74
11.8 其他重大事件.....	75
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
12.1 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.....	78
12.2 备查文件目录.....	79
12.3 存放地点.....	79
12.4 查阅方式.....	79

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金
基金简称	浦银安盛基本面 400 指数
基金主代码	519117
交易代码	519117
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 14 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	28,617,368.80 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		浦银安盛基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	田东辉
	联系电话	021-23212888	010-68858113

	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95580
传真		021-23212985	010-68858120
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址		上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码		200020	100808
法定代表人		谢伟	张金良

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2019 年	2018 年	2017 年
本期已实现收益	-1,297,596.79	-5,185,158.78	-1,903,760.67
本期利润	11,551,654.03	-15,913,937.86	1,963,218.68
加权平均基金份额本期利润	0.3479	-0.4611	0.0549
本期加权平均净值利润率	25.33%	-32.93%	3.39%
本期基金份额净值增长率	25.73%	-28.23%	2.99%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
期末可供分配利润	8,368,277.45	5,952,631.21	15,483,216.31
期末可供分配基金份额利润	0.2924	0.1616	0.4779
期末基金资产净值	41,809,036.10	42,795,146.23	52,441,968.34
期末基金份额净值	1.461	1.162	1.619
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末	2017 年末
基金份额累计净值增长率	46.10%	16.20%	61.90%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

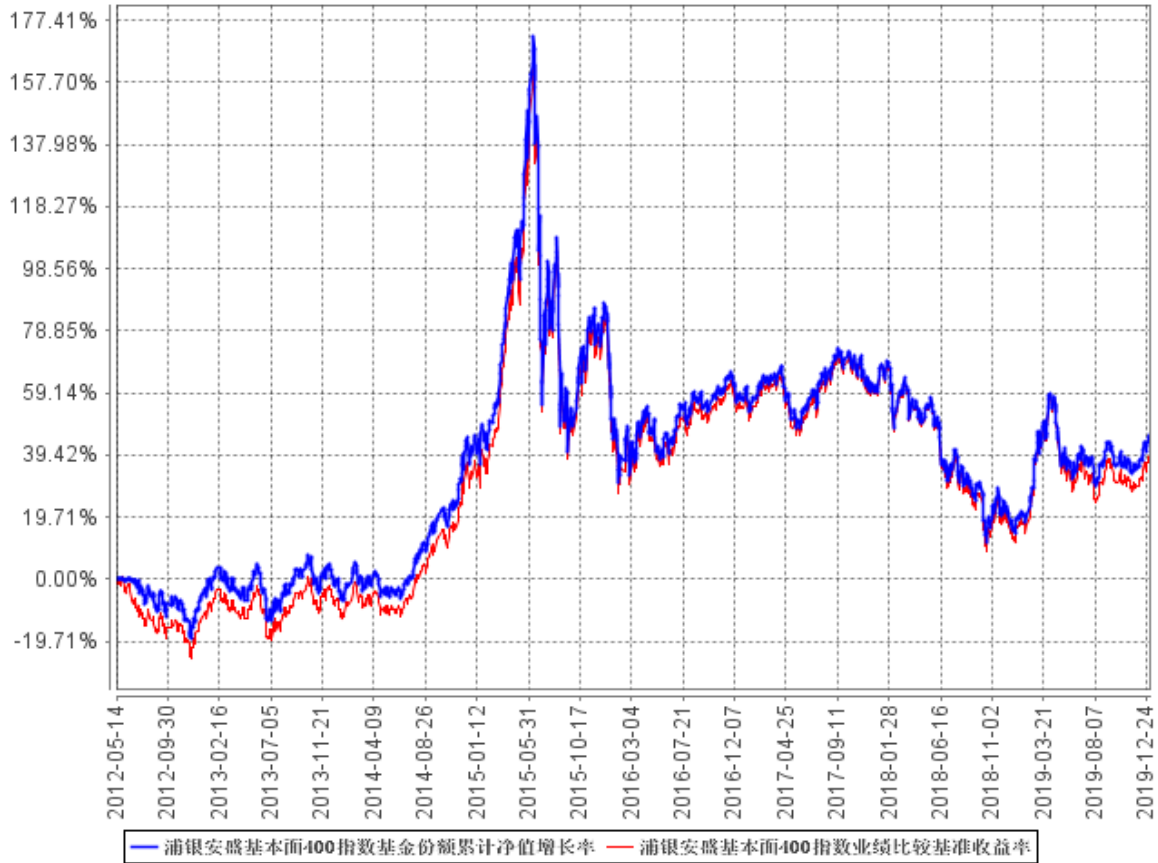
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	7.43%	0.78%	6.77%	0.82%	0.66%	-0.04%
过去六个月	5.56%	0.90%	3.75%	0.95%	1.81%	-0.05%
过去一年	25.73%	1.29%	23.13%	1.35%	2.60%	-0.06%
过去三年	-7.06%	1.20%	-9.73%	1.24%	2.67%	-0.04%
过去五年	3.47%	1.73%	4.49%	1.75%	-1.02%	-0.02%
自基金合同生效起至今	46.10%	1.57%	39.42%	1.60%	6.68%	-0.03%

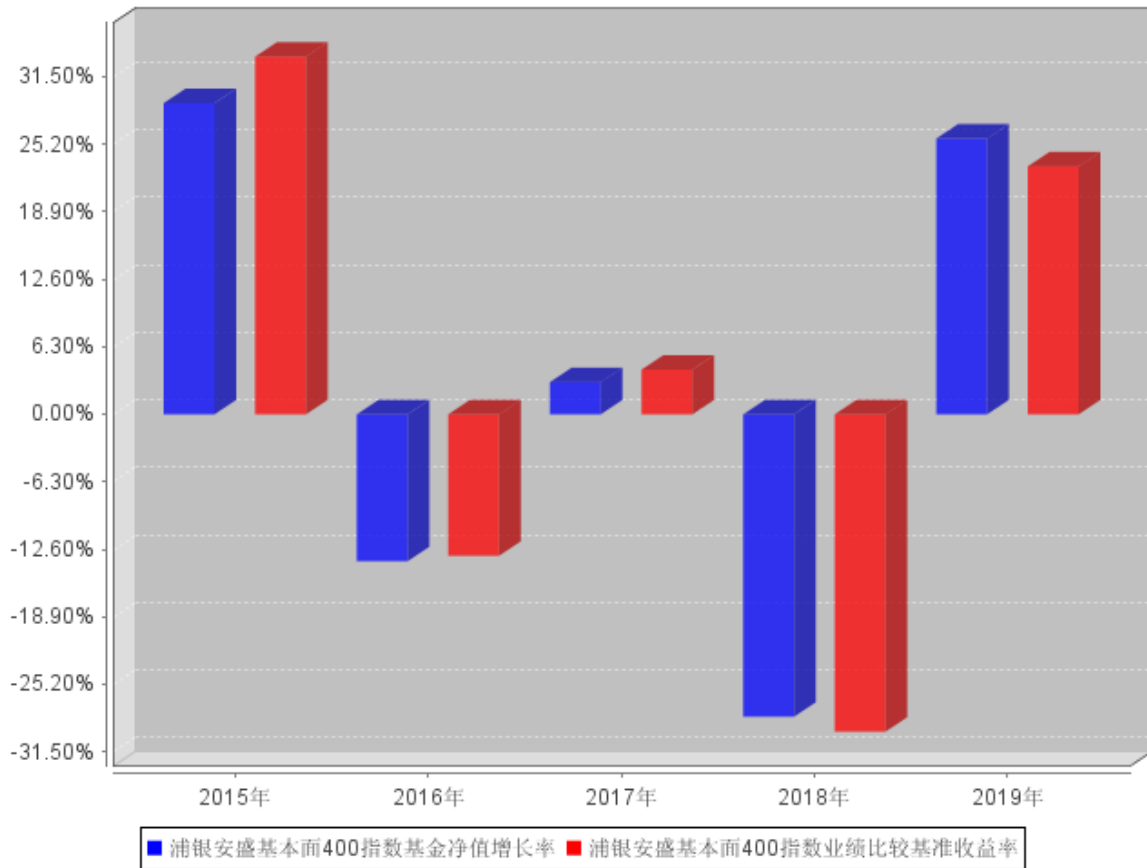
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛基本面400指数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



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛基本面400指数过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行过利润分配。

§ 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 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 52 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、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金、浦银

安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金和浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）。

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，公司旗下部分基金的基金经理。	2012年5月14日	-	19	陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年至2003年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员2年；2003年至2007年10月在银河基金管理有限公司工作4年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于2010年12月起兼任浦

					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 公平交易制度和控制方法

管理人于 2009 年颁布了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》（以下简称公平交易管理规定），并分别于 2011 年及 2012 年进行了两次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节，预防和发现可能违反公平交易的异常情况，并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括：

-公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易

等重大非公开投资信息相互隔离；

- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台；
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系；
- 证券投资基金经理及其助理和特定客户资产投资组合经理及其助理相互隔离，不得相互兼任、互为备份；
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；
- 执行投资交易系统中的公平交易程序；
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行，并对该分配过程进行监控；
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估；
- 对不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。分析如发现有涉嫌不公平的交易，投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明，并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。
- 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

4.3.2 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。

4.3.3 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，中国经济增速下行压力加大，中美贸易谈判曲折反复，增添了投资的不确定性，A 股市场也随之起伏波动。政府出台了减税降费等多项支持实体经济发展的稳增长政策措施，中美贸易谈判在年底前取得第一阶段协议成果，中国经济出现企稳态势，全年 GDP 增速为 6.1%，各项主要经济指标均有改善。2019 年是中国股票市场对外开放的重要一年，MSCI 指数提升 A 股纳入比例至 20%，标普道琼斯和罗素富时等国外知名股票指数也纷纷开启了 A 股扩容进程，海外投资者逐渐成为 A 股市场新的投资力量。2019 年，A 股各主要市场指数均大幅上涨，特别是科创板的成功推出，提升了投资者对科技、生物医药等创新成长股票的投资热情，成长股估值水平大幅上升。消费行业的龙头企业仍是机构投资者的长期重点投资品种，也有不错的表现。2019 年，中证锐联基本面 400 指数上涨 24.31%。

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基本一致。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.461 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.73%，业绩比较基准收益率为 23.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，年初的新型冠状病毒爆发对短期经济活动产生重大影响，但在疫情过后经济将出现较快地恢复，我们对中国经济保持可持续增长充满信心。在经历了去年的牛市行情后，投资者风险偏好明显提升，股票资产的配置比例也将继续提高。我们认为，2020 年行业主题风格趋于均衡，估值合理且业绩稳健成长的优质上市公司股票具有良好的投资价值。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，强化风险及合规管理，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金份额持有人的合法权益。在公司董事会的指导、管理层的支持和各部门的密切配合下，合规风控审计工作紧紧围绕公司的经营目标和计划，以及公司的特点和现状，扎扎实实地开展。2019 年，合规风控工作内容涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、反洗钱、风险监控、绩效评估、内部审计等工作。

法律合规方面，新规落实、法律审核、合规审核、信息披露、合规检查、反洗钱等各项工作均有序开展，公司各项合规记录良好，为公司各项业务的开展打下了坚实基础。

风险管理方面，对信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险均建立了完善的二层风险监控机制，进一步开发并优化量化风险评估模型，利用数字化、专业化管理提升风险评估、监测及预警效能，并提升风险化解及处置能力。

审计方面，在完成法规要求的常规审计项目和根据风险导向开展的自主开展的专项审计项目外，还配合总行审计、会计师事务所等开展了重要的外部审计工作。今后将继续秉持以风险为导向的重点专项审计，同时尽力兼顾对公司所有业务循环的审计覆盖面。

（一）进一步健全内控管理团队，提高团队的专业素养

2019 年，随着公司管理投资组合的数量与规模大幅提升、业务类型的不断拓展，各内控团队不断加强自身专业素质的提升，全面提高专业素质，鼓励和支持合规风控审计人员参与相关的专业考试和学习。目前各内控团队内部及互相之间形成了良好的学习和业务研讨的氛围，团队成员各自发挥自身优势，相互取长补短，专业素质得到均衡提升，在内部形成了互帮互学、互相协同、勤奋上进的良好局面。

内部管理上，各内控团队进一步健全合规风控工作的各项规章制度和 workflows，进一步明确各岗位人员的工作职责，强化自觉、客观的工作态度和高度的工作责任感，培养团队协作精神。

对外沟通上，持续与监管机构、交易所、自律协会、外部律师、外部会计师及双方股东对口部门保持密切良好的沟通，同时与公司其他部门保持良好协作，配合和支持部门间需求接洽。

（二）完善公司内控制度体系的建设

2019 年监管机关发布了《证券期货经营机构管理人中管理人（MOM）产品指引（试行）》、《监管部门关于基金参与科创板投资的相关监管要求》、《公开募集证券投资基金参与转融通证券出借业务指引（试行）》等法规或文件。我司也根据相关法规的要求，对我司的制度进行了修订和完善。同时，公司新增和修订了《压力测试管理办法》、《投资授权管理规定》、《股票库管理规定》、《投资组合关联交易管理规定》、《2019 年风险偏好示例》、《质押券管理规定》、《固定收益券库管理规定》、《异常交易管理规定》、《投资顾问管理规定》、《固定收益投资管理制度》、《基金转融通证券出借业务投资管理规定》、《基金库管理规定》等规章制度和业务流程，满足未来业务开展的需要，并进一步提高我司业务开展的规范性。

（三）法律合规工作

1、合规性审核

依据法律法规和公司制度对以下材料进行了审核：

1) 对基金宣传推介材料、公司宣传品、网站资料、客户服务资料、渠道用信息、以公司名义对外发布的新闻等进行了合规性审核，力求公司对外材料的合法合规性；

2) 2019 年, 与公司专业法律顾问一起, 对公司发行的公募基金和专户产品法律文件的合法性合规性进行了全面审核;

3) 对一级市场数百个证券的申购, 从关联交易角度进行合法合规性审核;

4) 相关三会程序及法律文件审核, 互联网营销等创新业务合规论证。

2、法律事务

对公司签署的上千份协议、合同等进行了法律审核, 在合理范围内最大限度地防范由合同产生的违约风险及侵权风险, 同时, 参与起草、审阅并修改董事会、股东会会议通知、决议等会议材料。此外, 合规法务团队还负责与公司法律和基金产品律师联系和沟通, 配合公司的业务开展。

全年的法务工作基本做到了有序而高效, 积极协助了公司业务的正常开展, 公司未发生重大诉讼现象, 较好地控制了法律风险。

3、合规和法律培训

根据工作安排, 法律合规部负责公司的合规培训工作, 合规培训采取现场和非现场方式, 内容包括新员工入司培训、重大新法规培训、反洗钱培训、违法违规案例通报等。现场培训前, 法律合规部会商量每次培训的议题和内容, 并准备书面培训材料; 培训中, 采取讲实例的互动培训方式; 培训后, 积极听取员工的建议, 以期不断改进培训效果。

1) 合规法务团队每日登陆各监管官网及报备平台, 搜集新法律法规、监管动态及行业违规案例形成月度法律监管资讯汇编, 并向董事、监事及股东方传达, 同时通过在月度风控会上介绍新法规及监管政策内容, 向管理层持续传达合规信息、进行合规培训。

2) 公司 2019 年对新入职员工进行了入职合规现场培训, 内容包括道德规范、业务运作、公司利益冲突管理、市场营销、投资及交易行为、反洗钱等相关合规要求。

3) 2019 全年为业务人员提供了 9 次现场合规培训, 内容包括公司《合规及风险绩效考核管理规定》培训、专兼合规人员岗位培训、廉洁从业培训、反洗钱培训等。同时在公司培训系统中以各类案例形式, 进行了 70 余次的线上合规培训。

4) 2019 年, 公司积极对协会下发的《公募基金行业合规管理手册》进行学习及宣导, 并继续对《浦银安盛基金管理有限公司合规手册》、《浦银安盛基金管理有限公司宣传销售工作合规指南》进行修订, 作为员工合规培训教育的一个有效方式, 进一步丰富和完善公司合规培训教育体系, 全方位推进公司合规水平的进一步提高。

4、反洗钱工作

1) 健全组织机构。2019 年, 公司及时根据内设部门调整和人事变动对反洗钱工作领导小组进行了更新调整。召开反洗钱工作领导小组会议 1 次, 传递监管要求和思路, 针对各项监管新规

要求进行贯彻落实部署,明确反洗钱工作任务措施及分工。

2) 完善内控制度。2019 年,公司根据业务实际对《浦银安盛基金管理有限公司洗钱风险自评估管理规定》、《浦银安盛基金管理有限公司洗钱风险管理策略》等相关反洗钱制度进行了修订完善。对反洗钱可疑交易认定规则进行了评估、调整,并向反洗钱监测分析及中国人民银行上海分行进行了报备。

3) 贯彻落实各项监管要求。2019 年,公司积极学习中国人民银行、证监会等监管部门的各项通知精神,认真落实监管部门的各项通知要求,有序开展各项客户身份识别、可疑交易报送、洗钱风险管理等各项反洗钱工作,无洗钱风险事件或其他重大洗钱违规事项的发生。根据监管要求,进一步加强受益所有人识别,认真配合做好扫黑除恶专项斗争工作,完成非居民金融账户涉税信息尽职调查工作,积极履行反洗钱工作人员调整、年度报告等报备报告工作。

4) 积极推进内外部检查评估

一是根据中国人民银行上海分行关于反洗钱分类评级的有关通知要求,对公司 2018 年度反洗钱工作开展情况进行了自评估,形成报告和相关证明材料并向中国人民银行上海分行进行了报送。

二是根据浦发银行总行下发的《关于印发〈浦发银行 2019 年度反洗钱内控检查方案〉的通知》,协同市场部、互联网金融部、零售业务部等相关部门及分支机构积极开展相应自查,并已就检查发现的问题督促相关部门积极进行整改。

三是积极接受母公司反洗钱检查。公司积极接受浦发银行总行反洗钱现场检查,并协同其他反洗钱相关部门对检查事实确认书进行了事实确认和意见反馈。通过本次检查,浦发银行法律合规部对我司反洗钱工作给予肯定评价,从内控机制、人员配备到客户身份识别、风险等级划分、可疑交易审核等,均严格按照证券基金业相关法规建立控制,各业务部门执行情况良好,但也存在个别问题可参照银行反洗钱经验进行进一步优化和完善。

5) 多元化开展或参与反洗钱专题培训。公司总经理、督察长及反洗钱专职工作人员等参加了基金业协会组织的反洗钱工作系列培训班。公司法律合规部于培训结束后积极组织反洗钱工作领导小组会议和反洗钱工作小组成员再次对培训内容进行了学习。此外,公司通过内部培训系统开展了 18 场反洗钱合规培训(现场培训 3 次,非现场培训 15 次),丰富反洗钱培训内容和方式。

6) 主动开展行业反洗钱业务研究。公司法律合规部结合工作实践,主动对基金行业反洗钱业务面临的问题及应对对策进行研究分析,并根据人民银行有关要求,向人民银行上海分行供稿 1 篇。

5、落实监管政策和要求,配合和协助监管机关的现场调研

与监管机关的沟通和交流主要由督察长和法律合规部负责,总体来说,在落实监管机关的监

管政策和要求方面的工作包括：

- 1) 收发监管机关的所有文件，传达监管机关的政策，从收文和报送环节进行协调和督促；
- 2) 落实相关法规的检查工作，组织、协调和督导公司的专项自查，据此发现未及时控制的内控点，通过修订制度流程的方式完善内控机制；
- 3) 代表公司参与上海基金业同业公会的相关会议。

6、信息披露和文件报送

由于公司信息披露的负责人设在法律合规部，因此法律合规部指定专人负责并协调公司的信息披露工作，督察长对信息披露工作进行指导、督促、监督、检查。信息披露工作包括拟定披露的文件格式、收集相关部门填写的内容并进行统稿和审核、对定稿的信息披露文件排版等。

信息披露工作是一项繁杂的事务性工作，需要信息披露负责人耐心、细致、认真的工作态度和较强的协调能力，不仅涉及到披露的格式，还涉及披露的内容，以及整理、审阅和报送等。该项工作虽然占据了合规法务团队很多时间，但由于团队成员的工作认真、仔细，所有的披露均做到了及时、准确，基本未出现重大迟披、漏披、延披、错披的情形。

2019 年，按时按质完成基金及其他定期报告（月报、季报、半年报、年报、监察稽核报告）和招募说明书更新的提示及合规审核工作，并协助业务部门对重大事件临时报告、临时公告进行编制，及时进行合规审核，并安排公告的披露及文件报备事宜。2019 年全年共审核并安排指定报刊和指定网站披露数百份公告，并通过电子邮件、证监会信息系统报送平台、证监会 XBRL 报送平台、上海证监局数据报送平台等向中国证监会及上海证监局报送数百份报告。未出现重大迟、漏等现象。

7、员工行为管理工作

报告期内，公司要求员工严格执行《从业人员投资限制及申报管理规定》、《通讯管制办法》，以频繁组织合规培训、定期签署案防责任书、严格申报管理、定期检查提示、纳入绩效考核等方式对员工行为进行多维度、全方位的要求和管控。员工整体道德风险防范意识和制度遵循程度有所提升，但仍存在个别员工制度遵循性有待加强。

8、督导处理投资人的投诉

公司已经建立了投资人投诉的处理机制，法律合规部负责指导、督促客服中心妥善处理投资人的重大投诉，包括商量投诉处理的反馈内容、形式和解决方法等，避免了因投资人投诉致使公司品牌和声誉受损的情形发生。

9、向董事会报告公司经营的合法合规情况

根据《公司章程》的要求，定期或不定期向董事会报告公司经营的合法合规情况。报告的形

式包括：（1）书面报告：通过季度和年度监察稽核报告的形式；（2）当面报告：通过在董事会会议以及合规与审计委员会会议汇报的形式；（3）电邮或电话：当董事想了解公司的合规经营情况或提出一些问题时，通过电子邮件或电话的形式进行沟通和汇报。

（四）风险管理工作

1、对投资组合进行定期风险评估

风险管理部进一步完善了在市场风险、信用风险、流动性风险和创新产品/业务风险等方面的风险评估及提示机制。

在市场风险方面，从市场趋势和宏观政策方面，对我司产品的股票仓位、板块配置、行业配置、债券组合久期、杠杆、波动率等进行提示。2019 年面对股票市场的整体上涨，公司也把握住机会，大幅提升权益类产品整体收益水平；对公司战略性布局的各类主题型产品，投资仍坚持遵守产品的主题风格，差异化投资。

在信用风险方面，公司已经打造一只人员充沛的资深的信评团队，以支持公司体量占比较大的固定收益类品种的投资，已构建了用于信用评分体系的系统工程，通过固化信用评分模型保证研究质量，提高工作效率；风险管理部专注于公司各组合信用风险的二层管控，为了更好的管理信用类固定收益产品，把控整体信用风险，风险管理部在每年年初根据市场环境，结合公司风险偏好，制定全年固收类投向政策指引，宏观上设定总体风险框架，其中明确了对所投资行业的要求，对高风险行业限制投资，通过名单制进行管理。定期或不定期对持仓情况进行信用风险排查，建立了信用风险日常提示与反馈机制、债券的灰名单机制及持仓债券风险排查机制，每日针对市场上发生的负面事件进行监控，对于在库主体和持仓主体及时向投研团队提示风险，并商定处理措施。此外，不定期的针对市场上发生的负面事件开展持仓和在库主体的专项风险排查，对于移出灰名单或者加入白名单的企业，风险管理部仍会持续跟踪企业信用资质变动情况，若后续公司资质出现恶化或者出现重大不利的负面舆情，仍将对企业进行负面预警，并重新加入灰名单或者移出“白名单”。

在流动性风险管控方面，公司 2019 年在明确的流动性风险管理的组织架构和职责划分下，在特殊市场时点或产品开放时点，要求市场销售团队时刻与机构客户保持密切沟通，做到提前预估以应对赎回；投资经理以流动性风险防控为组合管理重要任务之一，不断调整组合结构，优化指标以加强流动性应对能力；交易部紧盯市场，每日提前做好交易安排，协助投资经理确保及时平头寸；风险管理部根据最新情况完善压力测试模型，加大货币基金及持有人集中度较高产品的压力测试频度，关注各项合规指标，实时监控，及时提醒。各环节协作，保证流动性风险的管控到位及汇报路线顺畅，流动性风险缓释机制有效。

2、建立健全业绩归因分析及评估模型，助力绩效考核及业绩持续改善

风险管理部至少每月会对公司旗下管理全部公募及专户产品的业绩表现、相对市场其他类似产品的表现、主要收益来源及风险暴露情况进行分析，帮助基金经理明明白白赚钱，同时为绩效考核委员会提供了量化绩效考核的数据支持。不断完善业绩归因模型，直观体现业绩和风险来源及风险调整后收益，帮助投研部门回顾投资成功经验及有待改善之处。

3、对投资组合的公平交易及异常交易进行事前控制和事后分析

风险管理部继续着力于对公平交易、异常交易相关工作的提高，对公平交易及异常交易事后分析进行了进一步的完善。目前，风险管理部异常交易分析的频率为每月一次，并根据《关于规范债券市场参与者债券交易业务的通知》的要求及时报送异常交易行为，进一步确保投资组合的投资过程中的合法合规。

4、对公司新产品提供高效、有力的支持

2019 年，公司新发行了 6 只专户产品，9 只公募基金及开发中的产品 40 余只。风险管理部与投资团队、产品团队、运营团队合作，就各产品的投资合规风险、流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险等方面进行分析，制定相应的风险控制措施和投资控制指标。

在创新产品/业务风险管控方面，公司 2019 年继续完善创新产品/业务风险评估流程，使创新业务的发起部门和配合部门均能在创新业务开展前较早的参与该业务的风险识别，并提出相应的控制措施建议，对于识别出的无法控制的风险，尽早向公司提出资源支持或通过部门间的交叉控制措施来化解相应风险。同时，在创新产品上线前，风险管理部会统筹各部门再次评估创新产品/业务风险评估报告中曾识别的风险的控制措施是否有效落实。

5、股东风险管理部现场检查

2019 年，公司控股股东浦发银行风险管理部对公司进行现场检查，内容包括风险管理体系建设、风险管理机制和运行情况等，并出具了检查意见书。检查认为公司治理架构完整，经营发展平稳良好，各部门风险管理职能总体明确，基础管理制度完备；公司主动管理类资产质量良好，重视第一道防线的风险管理机制，具有积极主动的风控意识；也在进一步落实监管新规要求、优化风险管理系统、加大与委托方沟通力度等方面提出了整改建议。公司将根据该检查意见书的内容，对发现问题进行针对性整改，提高公司整体风险管理水平。

（五）审计工作

根据相关法规要求、公司的实际运作情况及审计计划，审计团队有重点、分步骤、有针对性地对公司业务和合规运作，以及执行法规和制度的情况进行审计，并在审计后督促整改和跟踪检查，作为公司风险管控的第三道防线方面发挥了积极的作用。

2019 年审计部开展的内部专项审计包括投资交易研究专项审计、反洗钱审计、投资者适当性专项审计、两次子公司审计、信息技术采购及信息技术资产管理、投研人员员工行为专项审计、5 次投资管理人员离任审查工作；此外，审计部配合股东方浦发银行完成常规审计后续审计工作，配合会计师事务所完成反洗钱分类评级工作、年度内控评价工作等。审计工作的结果主要体现在月度审计报告、专项审计报告及季度监察稽核报告中。对于审计检查中发现的问题与业务部门及时沟通，督促各部门及时完善和改进工作。

此外，审计团队还负责协助接受外部检查、对股东审计团队的定期报告工作与负责公司内控评价、信息技术专项审计、反洗钱分类评级的会计师事务所联系和沟通，配合公司的业务开展。

2020 年，公司审计部将进一步加强审计人员专业能力的培训和提升，不断深化审计工作的深度和提高审计建议的高度和前瞻性。

（六）进一步完善子公司内部控制体系

2019 年，子公司内部控制体系得到进一步完善：

业务部门的一线风险控制。子公司设金融机构部、另类投资部、投资管理部、财富管理部（筹）及运营管理部等业务部门，对其管理负责的业务进行检查、监督和控制，保证业务的开展符合国家法律、法规、监管规定及子公司的规章制度，并对部门的内部控制和风险管理负直接责任。

子公司对公司的风险管理条线进行了调整和优化，风险管理部更名为风控合规部，并下设风险管理团队、质量控制团队、法律合规团队三个团队，从而更加充分、合理地进行风险管控、检查和评价，更为有效地风险管理工作。

管理层的控制。子公司在总经理领导下设立执行委员会，并在管理层下设项目评审及决策委员会以及风险控制委员会，同时根据业务特征，设立资产证券化业务内核委员会，采取集体决策制，管理和监督各个部门和各项业务进行，并不断对各个委员会适用的议事规则进行优化，以确保子公司运作在有效的控制下。管理层对内部控制制度的有效执行承担责任。

执行董事及监事的监控和指导。所有员工应自觉接受并配合执行董事及监事对各项业务和工作行为的检查监督，合理的风险分析和管理建议应予采纳。执行董事对内部控制负最终责任。

（七）协助人力资源部完善了合规风控考核体系

2019 年，公司进一步加大对各部门、各岗位的风险事件考核力度。公司于年底建立完善了《合规及风险绩效考核管理规定》，依照问题或风险事件的不同等级和影响程度，同时结合是否自动及时上报、是否受外界因素影响等因素进行考核，责任明确、落实到人，通过下发合规风控函并进行合规考核扣分的形式有力地督促了相关人员对公司制度的执行；同时对于中级以上的合规及风险事件，将交由执委会审议并最终处理，从薪酬、职级甚至劳动关系等层面，合法合规的对员工

进行相应奖惩，有效地推动了公司全体员工合规意识的提高。

回顾过去的 2019 年，从股东、董事会、管理层到员工，对合规风控审计工作都比以前有了更多的重视和理解、支持，合规风控审计团队与公司各部门的联系日益紧密和协调，这为公司合规风控审计工作的开展进一步奠定了良好基石。

4.7 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》。

4.7.1 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每次基金收益分配比例不低于可供分配收益的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万，本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 22134 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(以下简称“浦银安盛基本面 400 指数基金”)的财务报表,包括 2019 年 12 月 31 日的资产负债表,2019 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了浦银安盛基本面 400 指数基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于浦银安盛基本面 400 指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	浦银安盛基本面 400 指数基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大

	<p>错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估浦银安盛基本面 400 指数基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算浦银安盛基本面 400 指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛基本面 400 指数基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p>

	<p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能对导致对浦银安盛基本面 400 指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致浦银安盛基本面 400 指数基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 罗佳
会计师事务所的地址	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2020 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,906,226.25	3,668,838.52
结算备付金		14,224.85	-
存出保证金		10,751.48	13,917.03
交易性金融资产	7.4.7.2	39,539,377.99	39,351,640.18
其中：股票投资		39,539,377.99	39,351,640.18
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		541,166.10	59,095.59
应收利息	7.4.7.5	587.68	731.83
应收股利		-	-
应收申购款		11,011.95	7,097.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	49,000.00
资产总计		43,023,346.30	43,150,321.11
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		973,448.60	13,271.22
应付管理人报酬		36,891.01	37,521.71
应付托管费		5,533.65	5,628.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	6,298.19	5,440.59
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	192,138.75	293,313.12
负债合计		1,214,310.20	355,174.88
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	28,617,368.80	36,842,515.02
未分配利润	7.4.7.10	13,191,667.30	5,952,631.21
所有者权益合计		41,809,036.10	42,795,146.23
负债和所有者权益总计		43,023,346.30	43,150,321.11

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.461 元，基金份额总额 28,617,368.80 份。

7.2 利润表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
一、收入		12,512,200.89	-14,914,291.99
1.利息收入		25,556.63	30,194.28
其中：存款利息收入	7.4.7.11	25,556.63	30,194.28
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-462,420.73	-4,232,749.77
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,262,640.61	-4,972,041.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	800,219.88	739,291.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	12,849,250.82	-10,728,779.08
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	99,814.17	17,042.58
减：二、费用		960,546.86	999,645.87
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	454,925.76	484,170.08

2. 托管费	7.4.10.2.2	68,238.84	72,625.42
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	89,758.38	83,508.32
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	7.4.7.20	347,623.88	359,342.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		11,551,654.03	-15,913,937.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		11,551,654.03	-15,913,937.86

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 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）	36,842,515.02	5,952,631.21	42,795,146.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	11,551,654.03	11,551,654.03
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）	-8,225,146.22	-4,312,617.94	-12,537,764.16
其中：1. 基金申购款	19,914,221.54	6,932,775.34	26,846,996.88
2. 基金赎回款	-28,139,367.76	-11,245,393.28	-39,384,761.04
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）	28,617,368.80	13,191,667.30	41,809,036.10
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 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)	32,401,546.80	20,040,421.54	52,441,968.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-15,913,937.86	-15,913,937.86
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)	4,440,968.22	1,826,147.53	6,267,115.75
其中：1. 基金申购款	17,539,245.85	7,011,958.06	24,551,203.91
2. 基金赎回款	-13,098,277.63	-5,185,810.53	-18,284,088.16
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)	36,842,515.02	5,952,631.21	42,795,146.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金(以下简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]2033 号文《关于核准浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金募集的批复》核准,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 413,196,469.55 元,经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2012)验字第 60951783_B01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 14 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 413,537,496.16 份基金份额,其中认购资金利息折合 341,026.61 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金招募说明书》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%-95%，投资于中证锐联基本面 400 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准收益率之间的日平均跟踪误差的绝对值不超过 0.35%，且年化跟踪误差不超过 4%，以实现对业绩比较基准的有效跟踪。本基金业绩比较基准为中证锐联基本面 400 指数收益率 $\times 95\%$ +银行活期存款利率(税后) $\times 5\%$ 。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2020 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)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。

(3)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、可交换债券和私募债券除外)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、可交换债券和私募债券除外)，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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税

试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	2,906,226.25	3,668,838.52
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：	2,906,226.25	3,668,838.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	40,793,712.44	39,539,377.99	-1,254,334.45
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	40,793,712.44	39,539,377.99	-1,254,334.45
项目	上年度末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	53,455,225.45	39,351,640.18	-14,103,585.27
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		53,455,225.45	39,351,640.18	-14,103,585.27

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	576.48	725.53
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	6.40	-
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	4.80	6.30
合计	587.68	731.83

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
其他应收款	-	49,000.00
待摊费用	-	-

合计		49,000.00
----	--	-----------

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	6,298.19	5,440.59
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	6,298.19	5,440.59

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,229.35	27.60
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	180,000.00	270,000.00
指数使用费用	10,909.40	23,285.52
合计	192,138.75	293,313.12

7.4.7.9 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	36,842,515.02	36,842,515.02
本期申购	19,914,221.54	19,914,221.54
本期赎回(以“-”号填列)	-28,139,367.76	-28,139,367.76
- 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	28,617,368.80	28,617,368.80

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	12,158,507.89	-6,205,876.68	5,952,631.21
本期利润	-1,297,596.79	12,849,250.82	11,551,654.03
本期基金份额交易产生的变动数	-2,454,051.50	-1,858,566.44	-4,312,617.94
其中：基金申购款	5,840,950.22	1,091,825.12	6,932,775.34
基金赎回款	-8,295,001.72	-2,950,391.56	-11,245,393.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,406,859.60	4,784,807.70	13,191,667.30

7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	24,967.12	29,497.08
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	308.68	430.76
其他	280.83	266.44
合计	25,556.63	30,194.28

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	33,661,905.68	25,551,631.34
减：卖出股票成本总额	34,924,546.29	30,523,672.94
买卖股票差价收入	-1,262,640.61	-4,972,041.60

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-买卖债券差价收入。

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无债券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无债券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益**7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.15 衍生工具收益**7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-其他投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	800,219.88	739,291.83
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-

合计	800,219.88	739,291.83
----	------------	------------

7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
1. 交易性金融资产	12,849,250.82	-10,728,779.08
——股票投资	12,849,250.82	-10,728,779.08
——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	12,849,250.82	-10,728,779.08

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	99,157.78	15,268.51
转换费收入	656.39	1,774.07
合计	99,814.17	17,042.58

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% 应归基金财产。

2. 本基金的转换费由转出和转入基金的申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中不低于转出基金的赎回费的 25% 归入转出基金的基金资产。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

交易所市场交易费用	89,758.38	83,508.32
银行间市场交易费用	-	-
合计	89,758.38	83,508.32

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	50,000.00	140,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	237,623.88	159,342.05
合计	347,623.88	359,342.05

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，逐日累计，按季支付，计算方法为：如前一日的基金资产规模净值超过或等于 40 亿元，按前一日基金资产净值的 0.09% 的年费率计提；如前一日的基金资产规模净值不足 40 亿元，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）	基金管理人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“中国邮政储蓄银行”）	基金托管人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国盛集团资产管理有限公司	基金管理人的股东

上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
----------------	-------------

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	454,925.76	484,170.08
其中：支付销售机构的客户维护费	182,528.45	186,836.90

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

	月 31 日	日
当期发生的基金应支付的托管费	68,238.84	72,625.42

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日		2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮储银行	2,906,226.25	24,967.12	3,668,838.52	29,497.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮储银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2019 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 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
603799	华友钴业	2019 年 12 月 31 日	重要事项未公告	39.39	2020 年 1 月 2 日	40.43	3,500	74,774.89	137,865.00	-

注：本基金截至 2019 年 12 月 31 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末及上年度末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法

律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。

其中，股票资产占基金资产的比例为 90%-95%，投资于中证锐联基本面 400 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

7.4.13.1 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、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长。

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，法律合规部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

董事会下属的合规及审计委员会，负责对公司整体风险管理和内部控制的有效性进行审议和评估。同时，督察长及合规及审计委员会负责检查、评价公司风险控制的充分性和有效性，并向

董事会报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险可能产生的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国邮储银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资或资产支持证券投资（2018 年 12 月 31 日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 12

月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金持有及承担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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	2,906,226.25	-	-	-	2,906,226.25

结算备付金	14,224.85	-	-	-	14,224.85
存出保证金	10,751.48	-	-	-	10,751.48
交易性金融资产	-	-	-	39,539,377.99	39,539,377.99
应收证券清算款	-	-	-	541,166.10	541,166.10
应收利息	-	-	-	587.68	587.68
应收申购款	-	-	-	11,011.95	11,011.95
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	2,931,202.58	-	-	40,092,143.72	43,023,346.30
负债					
应付赎回款	-	-	-	973,448.60	973,448.60
应付管理人报酬	-	-	-	36,891.01	36,891.01
应付托管费	-	-	-	5,533.65	5,533.65
应付交易费用	-	-	-	6,298.19	6,298.19
其他负债	-	-	-	192,138.75	192,138.75
负债总计	-	-	-	1,214,310.20	1,214,310.20
利率敏感度缺口	2,931,202.58	-	-	-38,877,833.52	41,809,036.10
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	3,668,838.52	-	-	-	3,668,838.52
存出保证金	13,917.03	-	-	-	13,917.03
交易性金融资产	-	-	-	39,351,640.18	39,351,640.18
应收证券清算款	-	-	-	59,095.59	59,095.59
应收利息	-	-	-	731.83	731.83
应收申购款	-	-	-	7,097.96	7,097.96
其他资产	-	-	-	49,000.00	49,000.00
资产总计	3,682,755.55	-	-	39,467,565.56	43,150,321.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,271.22	13,271.22
应付管理人报酬	-	-	-	37,521.71	37,521.71
应付托管费	-	-	-	5,628.24	5,628.24
应付交易费用	-	-	-	5,440.59	5,440.59
其他负债	-	-	-	293,313.12	293,313.12
负债总计	-	-	-	355,174.88	355,174.88
利率敏感度缺口	3,682,755.55	-	-	-39,112,390.68	42,795,146.23

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2019 年 12 月 31 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(2018 年 12 月 31 日: 同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所依法发行上市或银行间同业市场交易的股票和债券, 所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响, 也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金预算模型, 根据基金投资组合相对业绩比较基准的资产配置暴露度、行业配置暴露度和个股投资比例暴露度, 计算跟踪误差的预估值, 对基金的跟踪误差进行估计和控制, 预先防范基金收益表现偏离业绩比较基准过大的风险。同时, 本基金还将密切跟踪基金的实际跟踪误差, 及时分析跟踪误差的来源, 通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产占基金资产的比例为 90%-95%, 投资于中证锐联基本面 400 指数的成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产的 90%, 现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%, 其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等; 权证及其它金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 来测试本基金面临的潜在价格风险, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 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 12 月 31 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	39,539,377.99	94.57	39,351,640.18	91.95
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	39,539,377.99	94.57	39,351,640.18	91.95

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 500 基点	1,870,867.75	1,952,068.02
业绩比较基准下降 500 基点	-1,870,867.75	-1,952,068.02	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属

于第一层次的余额为 39,401,512.99 元,属于第二层次的余额为 137,865.00 元,无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日:第一层次 38,975,437.28 元,第二层次 331,256.90 元,第三层次 44,946.00 元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

	交易性金融资产
	股票投资
2019 年 1 月 1 日	44,946.00
购买	-
出售	-44,946.00
转入第三层次	-
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2019 年 12 月 31 日	-
	-
2019 年 12 月 31 日仍持有的资产计入	
2019 年度损益的未实现利得或损失的变动(从年初起算)	
——公允价值变动损益	

交易性金融资产

股票投资

2018 年 1 月 1 日	-
购买	-
出售	-
转入第三层次	44,946.00
转出第三层次	-
当期利得或损失总额	-
计入损益的利得或损失	-
2018 年 12 月 31 日	44,946.00

2018 年 12 月 31 日仍持有的资产计入

2018 年度损益的未实现利得或损失的

变动(从年初起算) -17,791.00

——公允价值变动损益

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下:

2018 年		不可观察输入值					
12 月 31 日	公允价值	估值技术	名称	范围/ 加权平均值	与公允价值 之间的关系		
交易性金融资产-信威集团	44,946.00			可比公司法	市盈率	33.16	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日, 本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日: 同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债, 其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	39,539,377.99	91.90
	其中：股票	39,539,377.99	91.90
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	2,920,451.10	6.79
8	其他各项资产	563,517.21	1.31
9	合计	43,023,346.30	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	305,292.00	0.73
B	采矿业	1,851,036.54	4.43
C	制造业	22,545,607.10	53.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,104,411.47	2.64
E	建筑业	1,300,627.28	3.11
F	批发和零售业	2,898,698.25	6.93
G	交通运输、仓储和邮政业	2,208,497.72	5.28
H	住宿和餐饮业	83,259.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	922,847.41	2.21
J	金融业	2,436,454.46	5.83
K	房地产业	2,370,948.29	5.67
L	租赁和商务服务业	419,251.50	1.00
M	科学研究和技术服务业	-	-

N	水利、环境和公共设施管理业	277,401.10	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,076.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	731,969.87	1.75
S	综合	-	-
	合计	39,539,377.99	94.57

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资按行业分类的境内股票投资组合。

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	600276	恒瑞医药	3,558	311,396.16	0.74
2	000425	徐工机械	48,900	267,483.00	0.64
3	600325	华发股份	33,440	261,835.20	0.63
4	601233	桐昆股份	17,185	257,603.15	0.62
5	600100	同方股份	29,300	256,961.00	0.61
6	000039	中集集团	26,140	256,694.80	0.61
7	600418	江淮汽车	49,200	246,984.00	0.59
8	002241	歌尔股份	12,348	245,972.16	0.59
9	000878	云南铜业	17,800	243,148.00	0.58
10	600522	中天科技	28,568	237,114.40	0.57
11	600739	辽宁成大	15,333	233,521.59	0.56
12	002475	立讯精密	6,382	232,943.00	0.56
13	000066	中国长城	14,800	230,288.00	0.55
14	600176	中国巨石	20,564	224,147.60	0.54
15	601555	东吴证券	22,283	222,607.17	0.53
16	600266	城建发展	27,280	220,968.00	0.53
17	000581	威孚高科	11,591	220,808.55	0.53
18	002183	怡亚通	52,190	219,719.90	0.53
19	600873	梅花生物	47,876	213,048.20	0.51
20	600528	中铁工业	18,300	210,450.00	0.50

21	600567	山鹰纸业	55,487	209,185.99	0.50
22	000059	华锦股份	34,300	208,887.00	0.50
23	600881	亚泰集团	65,287	208,265.53	0.50
24	601333	广深铁路	66,800	204,408.00	0.49
25	600516	方大炭素	16,737	203,521.92	0.49
26	600426	华鲁恒升	10,165	201,978.55	0.48
27	000728	国元证券	21,650	200,695.50	0.48
28	002078	太阳纸业	20,365	200,391.60	0.48
29	000786	北新建材	7,834	199,375.30	0.48
30	600409	三友化工	31,470	198,890.40	0.48
31	600507	方大特钢	19,756	198,745.36	0.48
32	601872	招商轮船	23,700	195,762.00	0.47
33	000830	鲁西化工	18,323	192,574.73	0.46
34	600664	哈药股份	50,800	192,532.00	0.46
35	002001	新和成	8,275	192,476.50	0.46
36	000623	吉林敖东	11,638	192,376.14	0.46
37	600039	四川路桥	56,992	191,493.12	0.46
38	600348	阳泉煤业	34,200	189,126.00	0.45
39	601108	财通证券	16,600	188,244.00	0.45
40	002244	滨江集团	38,100	187,452.00	0.45
41	002236	大华股份	9,350	185,878.00	0.44
42	000983	西山煤电	30,100	184,513.00	0.44
43	600729	重庆百货	6,078	181,428.30	0.43
44	002311	海大集团	5,029	181,044.00	0.43
45	000401	冀东水泥	10,600	180,306.00	0.43
46	600109	国金证券	19,256	179,080.80	0.43
47	600466	蓝光发展	23,980	176,732.60	0.42
48	000951	中国重汽	7,800	175,500.00	0.42
49	601636	旗滨集团	31,800	174,582.00	0.42
50	002081	金螳螂	19,567	172,580.94	0.41
51	002008	大族激光	4,280	171,200.00	0.41
52	600535	天士力	11,067	170,653.14	0.41
53	600369	西南证券	32,766	170,055.54	0.41
54	000423	东阿阿胶	4,800	169,776.00	0.41
55	000050	深天马 A	10,300	167,787.00	0.40
56	600694	大商股份	6,100	167,079.00	0.40
57	000963	华东医药	6,852	167,051.76	0.40
58	002233	塔牌集团	13,221	166,584.60	0.40
59	600717	天津港	26,460	166,168.80	0.40

60	600801	华新水泥	6,287	166,165.41	0.40
61	601012	隆基股份	6,690	166,112.70	0.40
62	600699	均胜电子	9,160	163,964.00	0.39
63	300226	上海钢联	2,100	163,380.00	0.39
64	300124	汇川技术	5,299	162,361.36	0.39
65	000060	中金岭南	37,480	161,164.00	0.39
66	300070	碧水源	21,178	160,952.80	0.38
67	002004	华邦健康	31,700	156,598.00	0.37
68	000701	厦门信达	29,360	155,901.60	0.37
69	002221	东华能源	20,000	155,200.00	0.37
70	600004	白云机场	8,885	155,043.25	0.37
71	600332	白云山	4,352	154,974.72	0.37
72	600970	中材国际	22,000	153,340.00	0.37
73	600489	中金黄金	18,000	152,640.00	0.37
74	600546	山煤国际	21,800	152,164.00	0.36
75	002065	东华软件	14,620	150,878.40	0.36
76	000960	锡业股份	14,418	150,523.92	0.36
77	000977	浪潮信息	5,000	150,500.00	0.36
78	600649	城投控股	26,200	149,864.00	0.36
79	601198	东兴证券	11,400	149,796.00	0.36
80	000543	皖能电力	31,625	146,740.00	0.35
81	002091	江苏国泰	21,300	146,331.00	0.35
82	002466	天齐锂业	4,800	144,864.00	0.35
83	601699	潞安环能	19,800	143,748.00	0.34
84	000768	中航飞机	8,710	142,669.80	0.34
85	000750	国海证券	26,628	142,193.52	0.34
86	002714	牧原股份	1,600	142,064.00	0.34
87	000513	丽珠集团	4,207	141,775.90	0.34
88	002050	三花智控	8,175	141,672.75	0.34
89	600056	中国医药	10,811	141,083.55	0.34
90	600438	通威股份	10,700	140,491.00	0.34
91	600498	烽火通信	5,115	140,406.75	0.34
92	601098	中南传媒	11,728	140,032.32	0.33
93	600859	王府井	9,989	139,746.11	0.33
94	600373	中文传媒	10,247	139,461.67	0.33
95	603156	养元饮品	4,800	139,344.00	0.33
96	600256	广汇能源	41,878	138,616.18	0.33
97	601128	常熟银行	15,200	138,472.00	0.33
98	000501	鄂武商 A	10,400	138,112.00	0.33

99	603799	华友钴业	3,500	137,865.00	0.33
100	600875	东方电气	14,900	136,931.00	0.33
101	002589	瑞康医药	17,800	136,882.00	0.33
102	600252	中恒集团	41,911	136,629.86	0.33
103	002508	老板电器	4,030	136,254.30	0.33
104	600597	光明乳业	10,704	135,833.76	0.32
105	000800	一汽轿车	13,600	135,592.00	0.32
106	600641	万业企业	7,200	135,360.00	0.32
107	000686	东北证券	14,536	135,184.80	0.32
108	000034	神州数码	6,800	134,980.00	0.32
109	601179	中国西电	36,900	134,316.00	0.32
110	601000	唐山港	51,474	133,832.40	0.32
111	002271	东方雨虹	5,050	132,865.50	0.32
112	000933	神火股份	24,200	132,616.00	0.32
113	002601	龙鳞佰利	8,600	132,354.00	0.32
114	600064	南京高科	13,505	131,673.75	0.31
115	300059	东方财富	8,333	131,411.41	0.31
116	600549	厦门钨业	10,069	131,299.76	0.31
117	000528	柳工	18,890	131,096.60	0.31
118	000690	宝新能源	23,104	130,537.60	0.31
119	002048	宁波华翔	8,438	130,451.48	0.31
120	601666	平煤股份	32,300	129,846.00	0.31
121	600380	健康元	12,514	129,519.90	0.31
122	600096	云天化	24,400	129,320.00	0.31
123	000012	南玻 A	25,778	129,147.78	0.31
124	600269	赣粤高速	31,200	128,856.00	0.31
125	000591	太阳能	35,200	128,832.00	0.31
126	000729	燕京啤酒	19,700	128,444.00	0.31
127	600308	华泰股份	27,800	127,602.00	0.31
128	601216	君正集团	40,704	127,403.52	0.30
129	002500	山西证券	15,310	126,919.90	0.30
130	600600	青岛啤酒	2,480	126,480.00	0.30
131	600320	振华重工	34,450	125,053.50	0.30
132	600160	巨化股份	17,163	124,946.64	0.30
133	000078	海王生物	33,300	124,209.00	0.30
134	000600	建投能源	25,000	122,250.00	0.29
135	600663	陆家嘴	9,024	121,914.24	0.29
136	600502	安徽建工	30,000	121,800.00	0.29
137	600708	光明地产	34,600	121,792.00	0.29

138	002340	格林美	25,000	121,750.00	0.29
139	002739	万达电影	6,700	121,605.00	0.29
140	000789	万年青	9,948	121,465.08	0.29
141	600312	平高电气	18,800	121,448.00	0.29
142	000685	中山公用	14,736	121,424.64	0.29
143	601588	北辰实业	37,000	121,360.00	0.29
144	002128	露天煤业	14,000	121,240.00	0.29
145	600141	兴发集团	11,770	120,995.60	0.29
146	600210	紫江企业	32,070	120,903.90	0.29
147	002152	广电运通	12,577	120,864.97	0.29
148	600138	中青旅	9,576	120,657.60	0.29
149	600710	苏美达	21,700	120,435.00	0.29
150	002926	华西证券	10,900	120,009.00	0.29
151	600482	中国动力	6,000	120,000.00	0.29
152	000028	国药一致	2,634	119,478.24	0.29
153	002251	步步高	13,111	119,310.10	0.29
154	000726	鲁泰 A	12,999	118,940.85	0.28
155	601866	中远海发	45,900	118,881.00	0.28
156	601231	环旭电子	6,182	118,879.86	0.28
157	600959	江苏有线	29,760	118,444.80	0.28
158	000627	天茂集团	16,800	118,272.00	0.28
159	600037	歌华有线	13,101	118,040.01	0.28
160	600497	驰宏锌锗	26,926	117,935.88	0.28
161	000937	冀中能源	32,200	117,852.00	0.28
162	002440	闰土股份	10,519	117,812.80	0.28
163	600742	一汽富维	9,726	117,587.34	0.28
164	000016	深康佳 A	26,900	117,553.00	0.28
165	000826	启迪环境	12,685	116,448.30	0.28
166	000559	万向钱潮	21,681	116,426.97	0.28
167	600026	中远海能	18,200	116,116.00	0.28
168	000400	许继电气	10,780	116,100.60	0.28
169	000717	韶钢松山	24,400	115,656.00	0.28
170	000718	苏宁环球	30,256	115,577.92	0.28
171	002422	科伦药业	4,914	115,429.86	0.28
172	601058	赛轮轮胎	25,745	115,080.15	0.28
173	000683	远兴能源	50,516	114,671.32	0.27
174	601717	郑煤机	17,715	114,616.05	0.27
175	601598	中国外运	26,900	114,594.00	0.27
176	600803	新奥股份	10,700	113,848.00	0.27

177	600111	北方稀土	10,500	113,820.00	0.27
178	600835	上海机电	6,856	113,603.92	0.27
179	600981	汇鸿集团	30,500	113,460.00	0.27
180	600085	同仁堂	4,024	113,396.32	0.27
181	600483	福能股份	12,300	113,160.00	0.27
182	600582	天地科技	35,438	113,047.22	0.27
183	600655	豫园股份	14,407	112,950.88	0.27
184	601611	中国核建	15,800	112,654.00	0.27
185	600879	航天电子	18,700	111,826.00	0.27
186	000921	海信家电	9,000	110,970.00	0.27
187	600008	首创股份	33,688	110,833.52	0.27
188	000900	现代投资	25,300	110,308.00	0.26
189	600339	中油工程	32,500	110,175.00	0.26
190	002419	天虹股份	10,350	109,192.50	0.26
191	002701	奥瑞金	24,518	108,124.38	0.26
192	000999	华润三九	3,398	107,648.64	0.26
193	000860	顺鑫农业	2,036	107,256.48	0.26
194	002007	华兰生物	3,028	106,434.20	0.25
195	603766	隆鑫通用	28,435	106,062.55	0.25
196	600491	龙元建设	14,500	105,995.00	0.25
197	600761	安徽合力	10,872	105,784.56	0.25
198	000758	中色股份	24,146	105,759.48	0.25
199	002294	信立泰	5,300	105,682.00	0.25
200	300433	蓝思科技	7,550	104,341.00	0.25
201	600884	杉杉股份	7,700	104,027.00	0.25
202	600572	康恩贝	16,845	103,596.75	0.25
203	600580	卧龙电驱	8,600	103,372.00	0.25
204	300408	三环集团	4,600	102,488.00	0.25
205	000807	云铝股份	19,922	102,399.08	0.24
206	000877	天山股份	8,614	102,075.90	0.24
207	002129	中环股份	8,600	101,566.00	0.24
208	600569	安阳钢铁	39,800	101,490.00	0.24
209	601021	春秋航空	2,300	100,947.00	0.24
210	601966	玲珑轮胎	4,400	100,892.00	0.24
211	601678	滨化股份	19,710	100,718.10	0.24
212	600977	中国电影	6,600	100,452.00	0.24
213	600612	老凤祥	2,100	99,981.00	0.24
214	000887	中鼎股份	11,033	99,848.65	0.24
215	000598	兴蓉环境	21,517	99,623.71	0.24

216	600123	兰花科创	15,500	99,510.00	0.24
217	600183	生益科技	4,734	99,035.28	0.24
218	600511	国药股份	3,570	97,425.30	0.23
219	600273	嘉化能源	8,600	96,750.00	0.23
220	600718	东软集团	8,492	96,384.20	0.23
221	600623	华谊集团	14,400	95,760.00	0.23
222	000550	江铃汽车	6,900	95,220.00	0.23
223	600711	盛屯矿业	17,900	94,691.00	0.23
224	300146	汤臣倍健	5,800	94,482.00	0.23
225	601878	浙商证券	8,400	93,492.00	0.22
226	002624	完美世界	2,100	92,694.00	0.22
227	600787	中储股份	17,787	92,670.27	0.22
228	300017	网宿科技	9,700	92,441.00	0.22
229	002217	合力泰	16,600	92,130.00	0.22
230	600939	重庆建工	19,100	91,871.00	0.22
231	002237	恒邦股份	6,512	91,428.48	0.22
232	600633	浙数文化	9,900	90,585.00	0.22
233	002191	劲嘉股份	7,912	90,275.92	0.22
234	600973	宝胜股份	23,500	89,300.00	0.21
235	002563	森马服饰	9,000	88,830.00	0.21
236	600388	龙净环保	9,097	88,695.75	0.21
237	002408	齐翔腾达	12,375	88,481.25	0.21
238	600020	中原高速	20,100	88,440.00	0.21
239	600737	中粮糖业	10,431	88,246.26	0.21
240	002051	中工国际	9,070	88,160.40	0.21
241	002242	九阳股份	3,472	87,355.52	0.21
242	600657	信达地产	21,838	87,133.62	0.21
243	002042	华孚时尚	11,700	85,878.00	0.21
244	603885	吉祥航空	5,680	85,200.00	0.20
245	600185	格力地产	17,600	85,184.00	0.20
246	600038	中直股份	1,764	84,160.44	0.20
247	002013	中航机电	12,103	83,994.82	0.20
248	600598	北大荒	8,600	83,764.00	0.20
249	600395	盘江股份	13,700	83,707.00	0.20
250	600073	上海梅林	10,500	83,685.00	0.20
251	600686	金龙汽车	11,883	83,418.66	0.20
252	600754	锦江酒店	2,900	83,259.00	0.20
253	600909	华安证券	11,400	83,220.00	0.20
254	300015	爱尔眼科	2,100	83,076.00	0.20

255	600809	山西汾酒	922	82,703.40	0.20
256	002157	正邦科技	5,102	82,652.40	0.20
257	600997	开滦股份	15,000	81,600.00	0.20
258	600908	无锡银行	14,700	81,585.00	0.20
259	600691	阳煤化工	38,400	80,640.00	0.19
260	600315	上海家化	2,584	79,948.96	0.19
261	600094	大名城	13,600	79,560.00	0.19
262	002299	圣农发展	3,300	79,464.00	0.19
263	002010	传化智联	11,300	78,874.00	0.19
264	002602	世纪华通	6,800	77,724.00	0.19
265	002503	搜于特	32,500	77,675.00	0.19
266	603589	口子窖	1,400	76,874.00	0.18
267	600120	浙江东方	8,734	76,247.82	0.18
268	000021	深科技	6,239	75,991.02	0.18
269	002203	海亮股份	7,300	74,825.00	0.18
270	000429	粤高速 A	9,000	74,340.00	0.18
271	002267	陕天然气	10,300	73,851.00	0.18
272	600648	外高桥	4,251	73,839.87	0.18
273	000031	大悦城	10,172	73,034.96	0.17
274	600566	济川药业	3,000	72,540.00	0.17
275	601886	江河集团	9,981	72,462.06	0.17
276	002375	亚厦股份	12,488	72,430.40	0.17
277	000089	深圳机场	7,400	72,298.00	0.17
278	603369	今世缘	2,200	71,984.00	0.17
279	600006	东风汽车	15,614	71,512.12	0.17
280	600062	华润双鹤	5,440	70,992.00	0.17
281	002061	浙江交科	12,000	70,440.00	0.17
282	601928	凤凰传媒	9,212	70,103.32	0.17
283	002302	西部建设	6,200	69,998.00	0.17
284	002032	苏泊尔	900	69,102.00	0.17
285	601163	三角轮胎	4,400	67,320.00	0.16
286	600162	香江控股	28,600	65,494.00	0.16
287	000537	广宇发展	8,400	65,268.00	0.16
288	000620	新华联	16,000	64,800.00	0.15
289	300750	宁德时代	600	63,840.00	0.15
290	600748	上实发展	10,600	62,964.00	0.15
291	601369	陕鼓动力	9,400	62,510.00	0.15
292	601958	金钼股份	7,700	61,677.00	0.15
293	000902	新洋丰	7,800	61,620.00	0.15

294	600295	鄂尔多斯	6,800	61,336.00	0.15
295	600231	凌钢股份	21,940	60,554.40	0.14
296	300251	光线传媒	5,100	60,180.00	0.14
297	601326	秦港股份	18,800	59,972.00	0.14
298	002745	木林森	4,400	59,884.00	0.14
299	002080	中材科技	4,768	59,123.20	0.14
300	601139	深圳燃气	7,300	57,159.00	0.14
301	600667	太极实业	7,000	56,770.00	0.14
302	002372	伟星新材	4,244	55,893.48	0.13
303	000596	古井贡酒	400	54,368.00	0.13
304	000553	安道麦 A	5,400	54,000.00	0.13
305	601107	四川成渝	12,800	53,888.00	0.13
306	601566	九牧王	4,600	52,624.00	0.13
307	601801	皖新传媒	9,522	52,180.56	0.12
308	600420	现代制药	5,800	51,852.00	0.12
309	603198	迎驾贡酒	2,600	51,792.00	0.12
310	000938	紫光股份	1,564	49,422.40	0.12
311	000869	张裕 A	1,700	48,790.00	0.12
312	601019	山东出版	6,900	47,955.00	0.11
313	002482	广田集团	10,822	47,400.36	0.11
314	603833	欧派家居	400	46,800.00	0.11
315	000582	北部湾港	5,100	45,645.00	0.11
316	601228	广州港	11,900	45,577.00	0.11
317	603056	德邦股份	4,100	45,551.00	0.11
318	002314	南山控股	14,000	42,980.00	0.10
319	601577	长沙银行	4,400	39,908.00	0.10
320	002936	郑州银行	8,400	39,060.00	0.09
321	603328	依顿电子	3,400	38,488.00	0.09

8.3.2 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。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600100	同方股份	380,242.00	0.89

2	000039	中集集团	370,934.18	0.87
3	600418	江淮汽车	362,137.00	0.85
4	000401	冀东水泥	324,467.00	0.76
5	601333	广深铁路	299,779.00	0.70
6	601598	中国外运	273,593.16	0.64
7	601108	财通证券	259,902.00	0.61
8	600528	中铁工业	247,846.00	0.58
9	000983	西山煤电	243,579.00	0.57
10	000066	中国长城	238,648.00	0.56
11	600717	天津港	231,159.00	0.54
12	600516	方大炭素	223,842.00	0.52
13	600881	亚泰集团	192,783.00	0.45
14	603156	养元饮品	192,214.00	0.45
15	601233	桐昆股份	191,729.00	0.45
16	600989	宝丰能源	189,584.88	0.44
17	600546	山煤国际	188,746.00	0.44
18	300146	汤臣倍健	187,354.00	0.44
19	002183	怡亚通	175,244.00	0.41
20	600710	苏美达	172,294.00	0.40

注：“买入金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 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	002157	正邦科技	382,387.00	0.89
2	002241	歌尔股份	363,063.00	0.85
3	601555	东吴证券	315,755.00	0.74
4	600875	东方电气	309,402.00	0.72
5	600183	生益科技	308,979.00	0.72
6	601997	贵阳银行	305,744.00	0.71
7	600989	宝丰能源	283,695.36	0.66
8	000550	江铃汽车	279,722.00	0.65
9	000425	徐工机械	268,878.00	0.63
10	000703	恒逸石化	266,681.00	0.62
11	601168	西部矿业	263,388.00	0.62
12	002475	立讯精密	249,522.00	0.58

13	002092	中泰化学	247,551.52	0.58
14	600325	华发股份	235,692.00	0.55
15	600782	新钢股份	230,412.00	0.54
16	000671	阳光城	216,937.98	0.51
17	000878	云南铜业	216,278.00	0.51
18	000413	东旭光电	207,911.00	0.49
19	601012	隆基股份	205,743.00	0.48
20	600664	哈药股份	205,103.00	0.48

注：“卖出金额”按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 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	22,359,072.44
卖出股票收入（成交）总额	33,661,905.68

注：“买入股票的成本”“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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 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。

8.10.2 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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除江淮汽车以外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。

2019 年 7 月 6 日, 因车辆销售“以次充好”行为, 江淮汽车收到北京市生态环境局出具的《行政处罚决定书》。

本基金管理人的研究部门对江淮汽车保持了及时的研究跟踪, 投资决策符合本基金管理人的投资流程。

8.12.2 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。

8.12.3 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	10,751.48
2	应收证券清算款	541,166.10
3	应收股利	-
4	应收利息	587.68
5	应收申购款	11,011.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	563,517.21

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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未存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
3,661	7,816.82	516,234.95	1.80%	28,101,133.85	98.20%

9.2 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	857,808.73	3.00%

9.3 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	0~10

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 5 月 14 日）基金份额总额	413,537,496.16
本报告期期初基金份额总额	36,842,515.02
本报告期基金总申购份额	19,914,221.54
减:本报告期基金总赎回份额	28,139,367.76
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	28,617,368.80

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

11.5 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)。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 60,000 元。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	55,091,658.82	100.00%	51,308.32	100.00%	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；
具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
佣金费率合理；
本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期无新增交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金2018年第4季度报告	报刊及公司官网	2019年1月21日
3	浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金2018年年度报告摘要	报刊及公司官网	2019年3月27日
4	浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金2018年年度报告	公司官网	2019年3月27日
5	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
6	浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金2019年第1季度报告	报刊及公司官网	2019年4月19日
7	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
8	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

9	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金招募说明书摘要（更新）2019 年第 1 号	报刊及公司官网	2019 年 6 月 27 日
10	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金招募说明书正文（更新）2019 年第 1 号	公司官网	2019 年 6 月 27 日
11	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	报刊及公司官网	2019 年 7 月 16 日
12	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2019 年半年度报告摘要	报刊及公司官网	2019 年 8 月 23 日
13	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2019 年半年度报告	公司官网	2019 年 8 月 23 日
14	关于浦银安盛基金管理有限公司旗下部分基金在兴业银行开通基金定投及参加其费率优惠活动的公告	报刊及指定网站	2019 年 10 月 10 日
15	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏汇林保大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	报刊及指定网站	2019 年 10 月 14 日
16	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	指定网站	2019 年 10 月 25 日
17	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下公募基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改基金合同和托管协议的公告	报刊及指定网站	2019 年 11 月 26 日
18	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金招募说明书摘要（更新）2019 年第 2 号	指定网站	2019 年 11 月 26 日
19	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金招募说明书正文（更新）2019 年第 2 号	指定网站	2019 年 11 月 26 日
20	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同	指定网站	2019 年 11 月 26 日
21	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金托管协议	指定网站	2019 年 11 月 26 日
22	浦银安盛基金管理有限公司关于降低旗下部分开放式基金最低申购金额的公告	报刊及指定网站	2019 年 12 月 4 日

23	关于旗下部分基金参加中国工商银行费率优惠活动的公告	报刊及指定网站	2019 年 12 月 25 日
24	关于旗下部分基金参加中国邮政储蓄银行网上银行和手机银行基金申购费率优惠活动的公告	报刊及指定网站	2019 年 12 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

备查文件目录

12.2 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准基金募集的文件
- 2、 浦银安盛中证锐联基本面 400 指数型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛中证锐联基本面 400 指数型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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

12.3 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。

12.4 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

2020 年 3 月 31 日