

浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资  
基金  
2020 年第 2 季度报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 7 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	21,550,332.21 份
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数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。
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

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2020年4月1日—2020年6月30日）
1. 本期已实现收益	1,395,568.18
2. 本期利润	3,811,591.72
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1653
4. 期末基金资产净值	32,680,665.96
5. 期末基金份额净值	1.516

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期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	净值增长率 ①	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	12.21%	0.94%	11.92%	0.96%	0.29%	-0.02%
过去六个月	3.76%	1.57%	3.81%	1.58%	-0.05%	-0.01%
过去一年	9.54%	1.26%	7.70%	1.29%	1.84%	-0.03%
过去三年	-4.11%	1.32%	-7.06%	1.35%	2.95%	-0.03%
过去五年	-29.55%	1.66%	-31.26%	1.67%	1.71%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	51.60%	1.57%	44.73%	1.60%	6.87%	-0.03%

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

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



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	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

	旗下部分基金的基金经理。			<p>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。2020 年 4 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联接基金及浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，兼任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--------------	--	--	---

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，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，本着诚实信用、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。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个基金组合。

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 日和 10 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。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年第二季度，随着新冠肺炎疫情在国内得到有效控制，国内生产经营活动持续改善，制造业 PMI 指数保持在荣枯线 50 以上，基建投资托底，房地产和汽车销售明显恢复，海外疫情对出口的影响弱于市场预期。政府出台一系列货币和财政政策，信贷和社融增速较快，对经济企稳回升起到了支撑作用。二季度，A 股市场大幅反弹，受疫情影响较小的食品饮料、信息技术和与病毒疫苗研发相关的生物医药等成长性行业表现较好，金融和周期性行业表现较弱，市场内部分化更趋明显。中证锐联基本面 400 指数成份股以中小盘优质成长股为主，该指数二季度上涨 12.56%，6 月末市盈率为 25.71 倍，股息率为 1.72%，当前估值水平合理，具有良好的投资价值。

本报告期内，本基金采取完全复制方法，密切跟踪标的指数的表现，组合表现与业绩比较基

准基本一致。

#### 4.5 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 1.516 元；本报告期基金份额净值增长率为 12.21%，业绩比较基准收益率为 11.92%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 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 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	30,538,186.20	90.74
	其中：股票	30,538,186.20	90.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	26,500.00	0.08
	其中：债券	26,500.00	0.08
	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	3,011,713.47	8.95
8	其他资产	79,964.77	0.24
9	合计	33,656,364.44	100.00

### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	261,930.00	0.80

B	采矿业	1,383,227.54	4.23
C	制造业	16,644,538.95	50.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	643,931.46	1.97
E	建筑业	831,799.41	2.55
F	批发和零售业	2,650,231.06	8.11
G	交通运输、仓储和邮政业	1,298,206.59	3.97
H	住宿和餐饮业	52,725.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	948,337.20	2.90
J	金融业	2,557,633.28	7.83
K	房地产业	1,887,208.40	5.77
L	租赁和商务服务业	493,727.52	1.51
M	科学研究和技术服务业	85,008.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	189,370.06	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	22,200.00	0.07
Q	卫生和社会工作	72,561.50	0.22
R	文化、体育和娱乐业	415,439.50	1.27
S	综合	47,679.00	0.15
	合计	30,485,754.47	93.28

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	39,089.61	0.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,105.52	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,236.60	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服	-	-



	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	52,431.73	0.16

### 5.2.3 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。

## 5.3 报告期末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

### 5.3.1 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601012	隆基股份	5,490	223,607.70	0.68
2	600325	华发股份	27,240	192,314.40	0.59
3	300226	上海钢联	2,420	190,212.00	0.58
4	600827	百联股份	13,000	187,850.00	0.57
5	002241	歌尔股份	6,248	183,441.28	0.56
6	002475	立讯精密	3,526	181,060.10	0.55
7	600859	王府井	3,889	177,143.95	0.54
8	002183	怡亚通	32,590	174,682.40	0.53
9	600522	中天科技	15,168	173,673.60	0.53
10	000039	中集集团	23,440	169,471.20	0.52

### 5.3.2 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300842	帝科股份	288	11,727.36	0.04
2	603087	甘李药业	107	10,732.10	0.03
3	300839	博汇股份	318	7,444.38	0.02
4	300843	胜蓝股份	545	5,455.45	0.02
5	600956	新天绿能	1,013	5,105.52	0.02

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	26,500.00	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	26,500.00	0.08

**5.5 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债券投资明细**

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转 2	234	23,400.00	0.07
2	128114	正邦转债	31	3,100.00	0.01

**5.6 报告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。

**5.7 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。

**5.8 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权证投资明细**

注：本基金本报告期末未持有权证。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 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。

### 5.10.3 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。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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

### 5.11.2 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。

### 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	7,920.73
2	应收证券清算款	48,606.56
3	应收股利	-
4	应收利息	490.43
5	应收申购款	22,947.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	79,964.77

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明****5.11.5.1 报告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。

**5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300843	胜蓝股份	5,455.45	0.02	新股锁定

**5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

-

**§ 6 开放式基金份额变动**

单位：份

报告期期初基金份额总额	24,200,680.36
报告期期间基金总申购份额	239,311.47
减：报告期期间基金总赎回份额	2,889,659.62
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	21,550,332.21

**§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况****7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

**7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细**

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 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

### 9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

### 9.3 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

2020 年 7 月 21 日