

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 2020 年中期报告

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：交通银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 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。本中期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 2020 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	49
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	52
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	56

§11 影响投资者决策的其他重要信息	58
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	58
§12 备查文件目录	59
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	浦银安盛中证高股息 ETF
场内简称	高股息;扩位证券简称: 高股息 ETF
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	169,503,444.00 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

注: 为便利投资者, 根据上海证券交易所于 2020 年 2 月 19 日发布的《关于上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称相关事项的通知》的相关要求及规范, 经履行适当程序, 本基金自 2020 年 3 月 16 日起, 增加扩位证券简称“高股息 ETF”, 基金代码和场内简称保持不变。

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
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 号
办公地址		上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200020	200336
法定代表人		谢伟	任德奇

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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	9,324,143.82
本期利润	16,346,143.98
加权平均基金份额本期利润	0.1294
本期加权平均净值利润率	12.26%
本期基金份额净值增长率	6.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	12,220,575.27
期末可供分配基金份额利润	0.0721
期末基金资产净值	191,385,671.42
期末基金份额净值	1.1291
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	12.91%

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

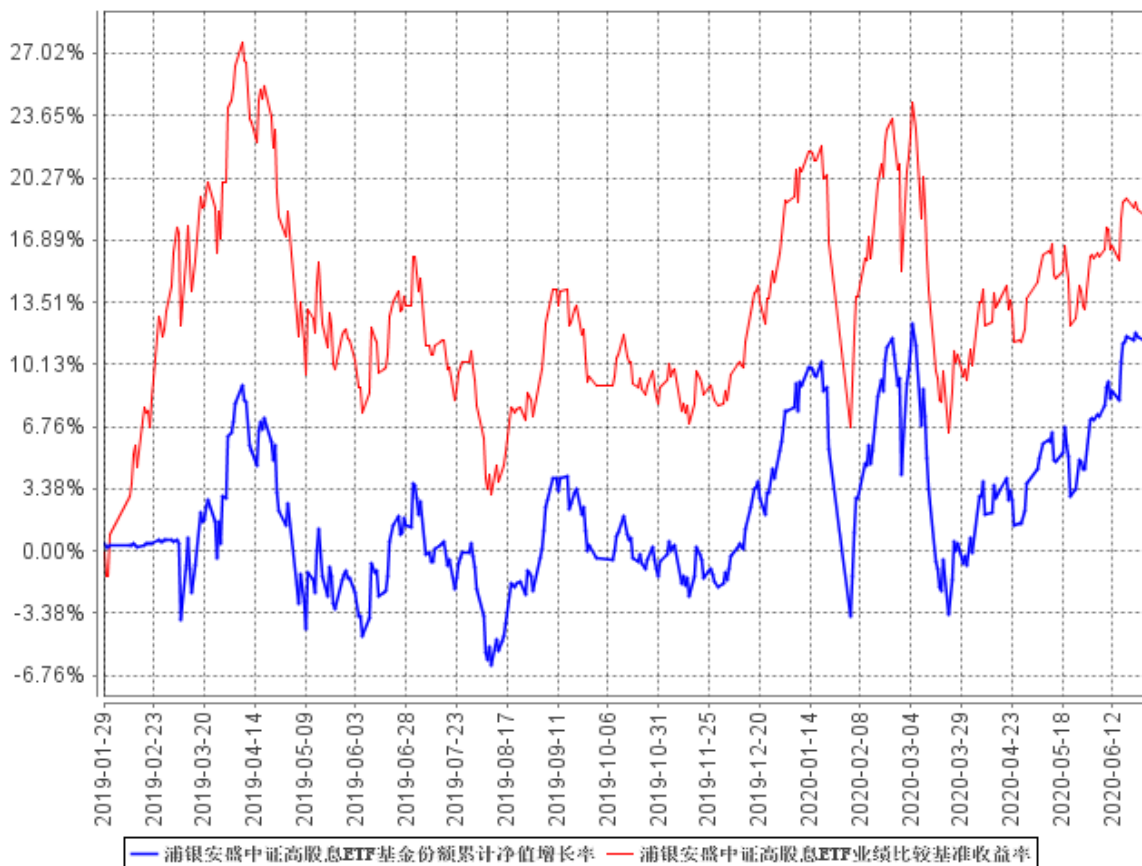
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.09%	0.81%	5.84%	0.85%	2.25%	-0.04%
过去三个月	13.22%	0.94%	8.92%	0.97%	4.30%	-0.03%
过去六个月	6.56%	1.60%	2.24%	1.62%	4.32%	-0.02%
过去一年	11.47%	1.26%	5.62%	1.29%	5.85%	-0.03%
自基金合同生效起至今	12.91%	1.29%	19.73%	1.39%	-6.82%	-0.10%

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：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。建仓期结束时符合相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为人民币 19.1 亿元，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2020 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 62 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、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、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）、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、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联接基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛科技创新优选三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放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	2019 年 1 月 29 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；

	监，公司职工监事，公司旗下部分基金的基金经理。				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。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。
高钢杰	公司旗下部分基金的基金经理。	2019 年 3 月 19 日	-	10	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。2020 年

					6 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。
--	--	--	--	--	--

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

2020 年上半年，新冠疫情爆发后在世界多个国家持续蔓延，全球确诊人数持续增加，中国率先控制住疫情并推动复工复产，海外主流经济体也积极跟进。货币政策、财政政策整体较为宽松，助力全球经济逐步走向复苏。A 股市场主要指数探底回升，波动水平明显上升。

在投资策略方面，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，跟踪误差较小，较好地实现了基金的投资目标。

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 1.1291 元；本报告期基金份额净值增长率为 6.56%，业绩比较基准收益率为 2.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内经济复苏将会持续，但复苏力度取决于多方面的因素，包括货币政策是否会边际收紧、中美贸易摩擦的发展态势、新冠病毒疫苗是否能够更大范围地被应用等。整体上，在货币政策相对宽松的大背景下，A 股市场有望继续震荡上行。

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、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

2020 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

2020 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。

本基金报告期内未进行利润分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

2020 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中期报告中财务指标、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：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,050,228.77	550,742.60
结算备付金		446,883.39	11,913.67
存出保证金		68,980.11	5,973.95
交易性金融资产	6.4.7.2	185,797,697.63	17,063,381.68
其中：股票投资		185,797,697.63	17,063,381.68
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		463,137.39	-
应收利息	6.4.7.5	1,167.37	139.96
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		191,828,094.66	17,632,151.86
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		176,881.16	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		81,969.90	7,686.31
应付托管费		16,393.97	1,537.24
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	117,259.67	25,191.15
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	49,918.54	110,000.00
负债合计		442,423.24	144,414.70
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	169,503,444.00	16,503,444.00
未分配利润	6.4.7.10	21,882,227.42	984,293.16
所有者权益合计		191,385,671.42	17,487,737.16
负债和所有者权益总计		191,828,094.66	17,632,151.86

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1291 元，基金份额总额 169,503,444.00 份。

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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 29 日(基金 合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		17,088,167.01	673,234.05
1.利息收入		11,101.72	837,873.64
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,101.72	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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		9,844,231.27	910,431.26
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,150,724.16	-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	4,693,507.11	944,719.41
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,022,000.16	-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	210,833.86	-343,922.00

减：二、费用		742,023.03	1,334,714.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	323,704.06	275,046.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	64,740.84	55,009.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	266,856.07	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	86,722.06	167,094.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,346,143.98	-661,480.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,346,143.98	-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：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	16,503,444.00	984,293.16	17,487,737.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,346,143.98	16,346,143.98
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）	153,000,000.00	4,551,790.28	157,551,790.28
其中：1. 基金申购款	227,000,000.00	9,980,944.66	236,980,944.66
2. 基金赎回款	-74,000,000.00	-5,429,154.38	-79,429,154.38
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	169,503,444.00	21,882,227.42	191,385,671.42

项目	上年度可比期间		
	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
金净值)			
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
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)	34,503,444.00	443,485.61	34,946,929.61

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

 郁蓓华 郁蓓华 钱琨
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日期间

的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	5,050,228.77
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	5,050,228.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	178,165,374.70	185,797,697.63	7,632,322.93
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	178,165,374.70	185,797,697.63	7,632,322.93

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	958.48
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	180.99
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	27.90
合计	1,167.37

6.4.7.6 其他资产

本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	117,259.67
银行间市场应付交易费用	-
合计	117,259.67

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	14,918.54
应付指数使用费	35,000.00
合计	49,918.54

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,503,444.00	16,503,444.00
本期申购	227,000,000.00	227,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-74,000,000.00	-74,000,000.00
- 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	169,503,444.00	169,503,444.00

注：申购含红利再投份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	188,676.69	795,616.47	984,293.16
本期利润	9,324,143.82	7,022,000.16	16,346,143.98
本期基金份额交易产生的变动数	2,707,754.76	1,844,035.52	4,551,790.28
其中：基金申购款	5,752,954.11	4,227,990.55	9,980,944.66
基金赎回款	-3,045,199.35	-2,383,955.03	-5,429,154.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,220,575.27	9,661,652.15	21,882,227.42

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	8,991.88
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,820.98
其他	288.86
合计	11,101.72

6.4.7.12 股票投资收益**6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,178,267.68
股票投资收益——赎回差价收入	-27,543.52
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	5,150,724.16

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	56,560,932.11
减：卖出股票成本总额	51,382,664.43
买卖股票差价收入	5,178,267.68

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	212,576,810.78
减：现金支付赎回款总额	174,173,041.78

减：赎回股票成本总额	38,431,312.52
赎回差价收入	-27,543.52

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,693,507.11
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	4,693,507.11

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	7,022,000.16
——股票投资	7,022,000.16
——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	7,022,000.16

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	210,833.86
合计	210,833.86

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	266,856.07
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	266,856.07

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	14,918.54
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	320.00
指数使用费	71,483.52
沪深股东帐户开户费	-
合计	86,722.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 债券交易

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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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。

6.4.10.1.4 权证交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月29日(基金合同生效日) 至2019年6月30日
当期发生的基金应支付	323,704.06	275,046.52

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	914.29	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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 29 日 (基金合同生效日) 至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	64,740.84	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。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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

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。

6.4.10.4.2 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

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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

基金管理人在本报告期内及上年度可比期间未持有本基金。

6.4.10.5.2 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

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年末未持有本基金。

6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月29日(基金合同生效日)至 2019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	5,050,228.77	8,991.88	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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	16.21	16.21	7,576	122,806.96	122,806.96	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股未上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股未上市	36.18	36.18	2,452	88,713.36	88,713.36	-

688377	迪威 尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	16.42	16.42	5,360	88,011.20	88,011.20	-
688600	皖仪 科技	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船 汉光	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 9 日	新股未 上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安 高科	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 3 日	新股未 上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝 股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 2 日	新股未 上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特 智能	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股未 上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股未 上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688106	金宏 气体	2020 年 6 月 16 日	2020 年 12 月 16 日	科创板 锁定	15.48	41.36	9,387	145,310.76	388,246.32	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金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。

6.4.12.3.2 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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中证高股息精选指数，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。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、权证等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行法定程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，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。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：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。

6.4.13.2 信用风险

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

本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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人交通银行股份有限公司，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 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券投资。

6.4.13.3 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。

于 2020 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持证券在证券交易所上市，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 2020 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面

临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,050,228.77	-	-	-	5,050,228.77
结算备付金	446,883.39	-	-	-	446,883.39
存出保证金	68,980.11	-	-	-	68,980.11
交易性金融资产	-	-	-	185,797,697.63	185,797,697.63
应收证券清算款	-	-	-	463,137.39	463,137.39
应收利息	-	-	-	1,167.37	1,167.37
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	5,566,092.27	-	-	186,262,002.39	191,828,094.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	176,881.16	176,881.16
应付管理人报酬	-	-	-	81,969.90	81,969.90
应付托管费	-	-	-	16,393.97	16,393.97
应付交易费用	-	-	-	117,259.67	117,259.67
其他负债	-	-	-	49,918.54	49,918.54
负债总计	-	-	-	442,423.24	442,423.24
利率敏感度缺口	5,566,092.27	-	-	-185,819,579.15	191,385,671.42
上年度末 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	550,742.60	-	-	-	550,742.60
结算备付金	11,913.67	-	-	-	11,913.67
存出保证金	5,973.95	-	-	-	5,973.95
交易性金融资产	-	-	-	17,063,381.68	17,063,381.68
应收利息	-	-	-	139.96	139.96
资产总计	568,630.22	-	-	17,063,521.64	17,632,151.86
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	7,686.31	7,686.31
应付托管费	-	-	-	1,537.24	1,537.24
应付交易费用	-	-	-	25,191.15	25,191.15
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	144,414.70	144,414.70
利率敏感度缺口	568,630.22	-	-	16,919,106.94	17,487,737.16

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2020 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证高股息精选指数，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金股票组合根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中中证高股息精选指数成份股和备选成份股股票投资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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	185,797,697.63	97.08	17,063,381.68	97.57
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	185,797,697.63	97.08	17,063,381.68	97.57

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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(2020年6月30日)	上年度末(2019年12月31日)
	业绩比较基准上升500基点	9,142,842.73	821,142.48
	业绩比较基准下降500基点	-9,142,842.73	-821,142.48

§ 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	185,797,697.63	96.86
	其中：股票	185,797,697.63	96.86
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	5,497,112.16	2.87
8	其他各项资产	533,284.87	0.28
9	合计	191,828,094.66	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	4,380,185.00	2.29
B	采矿业	8,742,701.00	4.57
C	制造业	147,696,506.12	77.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,041,520.00	0.54
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	18,794,465.36	9.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,077,717.00	1.09
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	1,920,496.40	1.00
S	综合	-	-
	合计	184,653,590.88	96.48

7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	-	-
C	制造业	996,435.90	0.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	134,904.53	0.07
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	1,144,106.75	0.60

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002601	龙蟠佰利	335,900	6,214,150.00	3.25
2	603328	依顿电子	552,700	5,764,661.00	3.01
3	000429	粤高速 A	803,900	5,619,261.00	2.94
4	600507	方大特钢	1,020,404	5,295,896.76	2.77
5	601088	中国神华	312,000	4,480,320.00	2.34
6	600114	东睦股份	379,600	3,940,248.00	2.06
7	002110	三钢闽光	572,600	3,813,516.00	1.99
8	600598	北大荒	222,600	3,583,860.00	1.87
9	002706	良信电器	208,500	3,477,780.00	1.82
10	002233	塔牌集团	281,300	3,384,039.00	1.77
11	002756	永兴材料	168,400	3,214,756.00	1.68
12	000789	万年青	245,300	3,157,011.00	1.65
13	600585	海螺水泥	57,800	3,058,198.00	1.60
14	002626	金达威	114,900	2,982,804.00	1.56
15	601003	柳钢股份	668,600	2,961,898.00	1.55
16	300298	三诺生物	90,700	2,915,098.00	1.52
17	601006	大秦铁路	401,200	2,824,448.00	1.48
18	300121	阳谷华泰	337,950	2,777,949.00	1.45
19	600377	宁沪高速	278,336	2,730,476.16	1.43
20	600897	厦门空港	149,870	2,684,171.70	1.40
21	002001	新和成	87,500	2,546,250.00	1.33
22	603658	安图生物	15,600	2,534,064.00	1.32
23	600563	法拉电子	39,800	2,459,640.00	1.29
24	002128	露天煤业	300,100	2,325,775.00	1.22
25	002734	利民股份	154,870	2,318,403.90	1.21
26	600660	福耀玻璃	109,500	2,285,265.00	1.19
27	300547	川环科技	282,900	2,209,449.00	1.15
28	600309	万华化学	44,000	2,199,560.00	1.15
29	002737	葵花药业	148,200	2,168,166.00	1.13
30	600529	山东药玻	37,300	2,163,400.00	1.13
31	002478	常宝股份	446,100	2,154,663.00	1.13
32	600566	济川药业	80,600	2,052,076.00	1.07
33	601225	陕西煤业	268,600	1,936,606.00	1.01
34	300230	永利股份	439,900	1,909,166.00	1.00
35	002381	双箭股份	203,800	1,876,998.00	0.98
36	600479	千金药业	202,560	1,873,680.00	0.98
37	002843	泰嘉股份	237,900	1,850,862.00	0.97

38	600801	华新水泥	74,100	1,756,911.00	0.92
39	300206	理邦仪器	94,500	1,723,680.00	0.90
40	002099	海翔药业	216,600	1,713,306.00	0.90
41	002597	金禾实业	74,300	1,706,671.00	0.89
42	603811	诚意药业	56,376	1,668,729.60	0.87
43	002117	东港股份	144,700	1,632,216.00	0.85
44	000568	泸州老窖	17,800	1,621,936.00	0.85
45	002677	浙江美大	143,300	1,616,424.00	0.84
46	600449	宁夏建材	132,100	1,614,262.00	0.84
47	002440	闰土股份	172,800	1,579,392.00	0.83
48	000898	鞍钢股份	640,700	1,569,715.00	0.82
49	600233	圆通速递	106,700	1,553,552.00	0.81
50	000877	天山股份	102,000	1,540,200.00	0.80
51	002572	索菲亚	63,400	1,532,378.00	0.80
52	600987	航民股份	280,735	1,501,932.25	0.78
53	002191	劲嘉股份	165,600	1,475,496.00	0.77
54	002468	申通快递	89,800	1,473,618.00	0.77
55	000672	上峰水泥	62,200	1,468,542.00	0.77
56	002546	新联电子	370,400	1,455,672.00	0.76
57	600750	江中药业	112,080	1,416,691.20	0.74
58	600229	城市传媒	184,920	1,372,106.40	0.72
59	600577	精达股份	492,300	1,368,594.00	0.72
60	002007	华兰生物	26,630	1,334,429.30	0.70
61	002056	横店东磁	116,100	1,306,125.00	0.68
62	002032	苏泊尔	18,200	1,292,200.00	0.68
63	601678	滨化股份	302,900	1,284,296.00	0.67
64	601000	唐山港	573,700	1,279,351.00	0.67
65	603886	元祖股份	77,700	1,274,280.00	0.67
66	600486	扬农化工	15,300	1,262,250.00	0.66
67	002020	京新药业	116,000	1,240,040.00	0.65
68	600703	三安光电	49,139	1,228,475.00	0.64
69	002803	吉宏股份	48,550	1,210,837.00	0.63
70	002449	国星光电	103,532	1,200,971.20	0.63
71	000786	北新建材	54,302	1,158,261.66	0.61
72	002643	万润股份	67,400	1,157,258.00	0.60
73	603866	桃李面包	22,300	1,134,847.00	0.59
74	600252	中恒集团	351,700	1,128,957.00	0.59
75	600160	巨化股份	157,320	1,083,934.80	0.57
76	600305	恒顺醋业	57,100	1,059,205.00	0.55

77	600995	文山电力	138,500	1,041,520.00	0.54
78	600668	尖峰集团	69,300	1,010,394.00	0.53
79	002757	南兴股份	57,225	975,686.25	0.51
80	300575	中旗股份	24,300	959,607.00	0.50
81	603165	荣晟环保	83,120	951,724.00	0.50
82	600867	通化东宝	54,200	944,706.00	0.49
83	300408	三环集团	34,100	944,570.00	0.49
84	300009	安科生物	51,470	921,313.00	0.48
85	300349	金卡智能	57,600	866,880.00	0.45
86	601100	恒立液压	10,100	810,020.00	0.42
87	002746	仙坛股份	60,100	796,325.00	0.42
88	002587	奥拓电子	126,100	718,770.00	0.38
89	600062	华润双鹤	52,260	690,877.20	0.36
90	600426	华鲁恒升	37,700	666,536.00	0.35
91	603579	荣泰健康	24,400	654,408.00	0.34
92	000910	大亚圣象	41,200	640,248.00	0.33
93	002222	福晶科技	41,300	633,542.00	0.33
94	002120	韵达股份	25,750	629,587.50	0.33
95	600230	沧州大化	68,300	577,135.00	0.30
96	300637	扬帆新材	60,300	565,011.00	0.30
97	601858	中国科传	61,000	548,390.00	0.29
98	600231	凌钢股份	242,300	537,906.00	0.28
99	300389	艾比森	44,800	441,728.00	0.23
100	002408	齐翔腾达	61,900	384,399.00	0.20

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688106	金宏气体	9,387	388,246.32	0.20
2	688568	中科星图	7,576	122,806.96	0.06
3	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.06
4	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.05
5	688027	国盾量子	2,452	88,713.36	0.05
6	688377	迪威尔	5,360	88,011.20	0.05
7	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.04
8	603087	甘李药业	645	64,693.50	0.03
9	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.01

10	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
11	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
12	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
13	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.01
14	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
15	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
16	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
17	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002601	龙麟佰利	7,841,967.00	44.84
2	000429	粤高速 A	7,426,213.00	42.47
3	002110	三钢闽光	6,197,945.80	35.44
4	002233	塔牌集团	4,783,688.00	27.35
5	000789	万年青	4,312,565.00	24.66
6	002756	永兴材料	4,138,491.65	23.67
7	300121	阳谷华泰	3,727,169.00	21.31
8	002626	金达威	3,369,678.00	19.27
9	002478	常宝股份	3,329,187.00	19.04
10	002706	良信电器	3,283,720.00	18.78
11	002128	露天煤业	3,237,957.23	18.52
12	002737	葵花药业	3,105,433.39	17.76
13	002001	新和成	2,975,218.00	17.01
14	300547	川环科技	2,907,471.80	16.63
15	300230	永利股份	2,884,251.00	16.49
16	002843	泰嘉股份	2,723,299.50	15.57
17	002597	金禾实业	2,552,458.00	14.60
18	002440	闰土股份	2,513,050.00	14.37
19	000898	鞍钢股份	2,503,981.00	14.32
20	002734	利民股份	2,462,192.00	14.08
21	002677	浙江美大	2,457,508.00	14.05
22	300298	三诺生物	2,370,074.68	13.55

23	002117	东港股份	2,354,328.44	13.46
24	002381	双箭股份	2,306,505.00	13.19
25	002191	劲嘉股份	2,256,858.00	12.91
26	002099	海翔药业	2,028,378.12	11.60
27	002468	申通快递	2,027,809.00	11.60
28	000672	上峰水泥	1,984,362.98	11.35
29	002546	新联电子	1,981,827.00	11.33
30	000568	泸州老窖	1,954,238.56	11.17
31	002572	索菲亚	1,817,725.00	10.39
32	000786	北新建材	1,772,398.46	10.14
33	002020	京新药业	1,735,969.00	9.93
34	002449	国星光电	1,717,351.48	9.82
35	002032	苏泊尔	1,669,686.00	9.55
36	002056	横店东磁	1,640,905.40	9.38
37	000877	天山股份	1,603,126.00	9.17
38	300206	理邦仪器	1,592,911.00	9.11
39	002803	吉宏股份	1,519,989.20	8.69
40	002643	万润股份	1,396,043.97	7.98
41	002007	华兰生物	1,343,466.20	7.68
42	002746	仙坛股份	1,287,491.50	7.36
43	002587	奥拓电子	1,258,357.00	7.20
44	300349	金卡智能	1,217,772.13	6.96
45	002757	南兴股份	1,071,991.00	6.13
46	300637	扬帆新材	1,008,654.00	5.77
47	300408	三环集团	992,209.09	5.67
48	300575	中旗股份	919,484.00	5.26
49	300009	安科生物	914,327.00	5.23
50	600233	圆通速递	898,621.00	5.14
51	002120	韵达股份	863,352.00	4.94
52	603328	依顿电子	785,535.00	4.49
53	002408	齐翔腾达	717,926.00	4.11
54	300389	艾比森	699,707.00	4.00
55	000910	大亚圣象	693,994.00	3.97
56	600585	海螺水泥	677,671.00	3.88
57	002222	福晶科技	648,865.00	3.71
58	600507	方大特钢	552,710.00	3.16

59	600563	法拉电子	502,257.00	2.87
60	601088	中国神华	482,968.00	2.76
61	603811	诚意药业	432,918.00	2.48

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002601	龙蟠佰利	3,031,624.00	17.34
2	002110	三钢闽光	2,103,064.80	12.03
3	000429	粤高速 A	1,860,421.00	10.64
4	002233	塔牌集团	1,726,440.00	9.87
5	000789	万年青	1,626,364.00	9.30
6	002706	良信电器	1,518,272.00	8.68
7	300121	阳谷华泰	1,447,132.00	8.28
8	300298	三诺生物	1,365,414.10	7.81
9	002756	永兴材料	1,359,909.00	7.78
10	002626	金达威	1,306,045.00	7.47
11	002128	露天煤业	1,165,952.00	6.67
12	002478	常宝股份	1,139,861.00	6.52
13	002843	泰嘉股份	1,063,165.50	6.08
14	002597	金禾实业	1,057,671.00	6.05
15	002737	葵花药业	1,035,687.00	5.92
16	002001	新和成	1,027,833.00	5.88
17	002440	闰土股份	918,829.00	5.25
18	002381	双箭股份	887,117.86	5.07
19	002677	浙江美大	883,380.49	5.05
20	300230	永利股份	877,659.00	5.02
21	002117	东港股份	855,078.00	4.89
22	000898	鞍钢股份	851,241.60	4.87
23	000672	上峰水泥	843,511.00	4.82
24	002803	吉宏股份	820,295.00	4.69
25	002734	利民股份	818,608.00	4.68
26	300206	理邦仪器	791,093.00	4.52
27	002572	索菲亚	751,083.00	4.29
28	002191	劲嘉股份	743,081.00	4.25
29	002099	海翔药业	728,062.00	4.16

30	300547	川环科技	719,440.00	4.11
31	000568	泸州老窖	658,042.00	3.76
32	002546	新联电子	621,351.00	3.55
33	002056	横店东磁	621,116.00	3.55
34	002020	京新药业	596,413.44	3.41
35	000877	天山股份	595,014.00	3.40
36	002007	华兰生物	557,188.00	3.19
37	002449	国星光电	546,855.00	3.13
38	000786	北新建材	539,886.02	3.09
39	002746	仙坛股份	530,531.00	3.03
40	002032	苏泊尔	523,132.00	2.99
41	601100	恒立液压	503,586.00	2.88
42	002643	万润股份	485,382.00	2.78
43	002468	申通快递	471,310.76	2.70
44	002587	奥拓电子	437,898.00	2.50
45	300349	金卡智能	427,051.00	2.44
46	688312	燕麦科技	396,754.39	2.27
47	300637	扬帆新材	390,976.00	2.24
48	688599	天合光能	382,922.42	2.19
49	688520	神州细胞	382,862.40	2.19
50	002408	齐翔腾达	381,260.00	2.18
51	688558	国盛智科	381,111.20	2.18
52	688518	联赢激光	373,943.43	2.14
53	002757	南兴股份	368,323.00	2.11

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	142,171,088.77
卖出股票收入（成交）总额	56,560,932.11

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

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

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

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所有资产支持证券投资明细

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除龙鳞佰利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。

2020 年 2 月 4 日，因未依法报批建设项目环境影响评价文件，龙鳞佰利收到河南省生态环境厅出具的《行政处罚决定书》。

本基金管理人的研究部门对龙鳞佰利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。

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	68,980.11
2	应收证券清算款	463,137.39
3	应收股利	-
4	应收利息	1,167.37
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	533,284.87

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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	688106	金宏气体	388,246.32	0.20	科创板锁定
2	688568	中科星图	122,806.96	0.06	新股锁定
3	688277	天智航	106,072.40	0.06	新股锁定
4	688528	秦川物联	94,458.21	0.05	新股锁定
5	688027	国盾量子	88,713.36	0.05	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
364	465,668.80	163,807,444.00	96.64%	5,696,000.00	3.36%

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

项目	持有份额（份）	占总份额比例
交通银行股份有限公司—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	51,085,900.00	30.14%

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	浦银安盛基金—尊享盈新客理财 2 号—浦银安盛盛卓 7 号 FOF 单一资产 管理计划	101,620,700.00	59.95%
2	交通银行股份有限公司—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	51,085,900.00	30.14%
3	方正证券股份有限公司	3,528,200.00	2.08%
4	中信证券股份有限公司	3,236,844.00	1.91%
5	华泰证券股份有限公司	2,194,600.00	1.29%
6	招商证券股份有限公司	1,627,100.00	0.96%
7	郑总平	524,200.00	0.31%
8	申万宏源证券有限公司	512,100.00	0.30%
9	史晨飞	500,000.00	0.29%
10	王俊	250,000.00	0.15%

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	0.00%

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
本报告期期初基金份额总额	16,503,444.00
本报告期基金总申购份额	227,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	74,000,000.00
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	169,503,444.00

§ 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	161,970,804.69	82.87%	150,845.14	82.87%	-
招商证券	2	33,487,824.24	17.13%	31,187.76	17.13%	-
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	-	-	-	-	-

国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	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	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	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：

本基金本报告期内减少中山证券交易单元。

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	成交金额	占当期权证成交总额的比例

				的比例		
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于调整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指数许可使用费收取下限的公告	报刊及指定网站	2020年1月8日
2	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摘要(更新)2020年第1号	指定网站	2020年1月8日
3	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正文(更新)2020年第1号	指定网站	2020年1月8日

4	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结算模式调整的公告	报刊及指定网站	2020 年 1 月 18 日
5	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正文（更新）2020 年第 2 号	指定网站	2020 年 1 月 18 日
6	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摘要（更新）2020 年第 2 号	指定网站	2020 年 1 月 18 日
7	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 年第 4 季度报告	指定网站	2020 年 1 月 20 日
8	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增加扩位证券简称的公告	报刊及指定网站	2020 年 3 月 14 日
9	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 年年度报告	指定网站	2020 年 3 月 31 日
10	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 2020 年第 1 季度报告	指定网站	2020 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2020 年 1 月 20 日-2020 年 6 月 30 日	0.00	101,620,700.00	0.00	101,620,700.00	59.95%
	2	2020 年 5 月 11 日-2020 年 6 月 30 日	0.00	73,906,300.00	22,820,400.00	51,085,900.00	30.14%
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>基金管理人提示投资者注意：当特定的机构投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、 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
- 3、 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
- 4、 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托管协议
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会指定报刊上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

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

浦银安盛基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日