

浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资 基金 2021 年中期报告

2021 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

送出日期：2021 年 8 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 30 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 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	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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
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	47

7.7 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.....	47
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	47
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.....	47
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§ 8 基金份额持有人信息.....	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	49
§ 9 开放式基金份额变动.....	49
§ 10 重大事件揭示.....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
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.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
10.4 基金投资策略的改变.....	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
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.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
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.....	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	52
§ 12 备查文件目录.....	52
12.1 备查文件目录.....	52
12.2 存放地点.....	52
12.3 查阅方式.....	52

§ 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
前端交易代码	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	13,865,791.02 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

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	薛香	田东辉
	联系电话	021-23212888	010-68858113
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	tia donghui@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	北京市西城区金融大街 3 号

	38 楼	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(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,520,082.98
本期利润	1,409,516.52
加权平均基金份额本期利润	0.0946
本期加权平均净值利润率	5.27%
本期基金份额净值增长率	5.28%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	7,854,388.56
期末可供分配基金份额利润	0.5665
期末基金资产净值	25,738,021.86
期末基金份额净值	1.856
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	85.60%

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

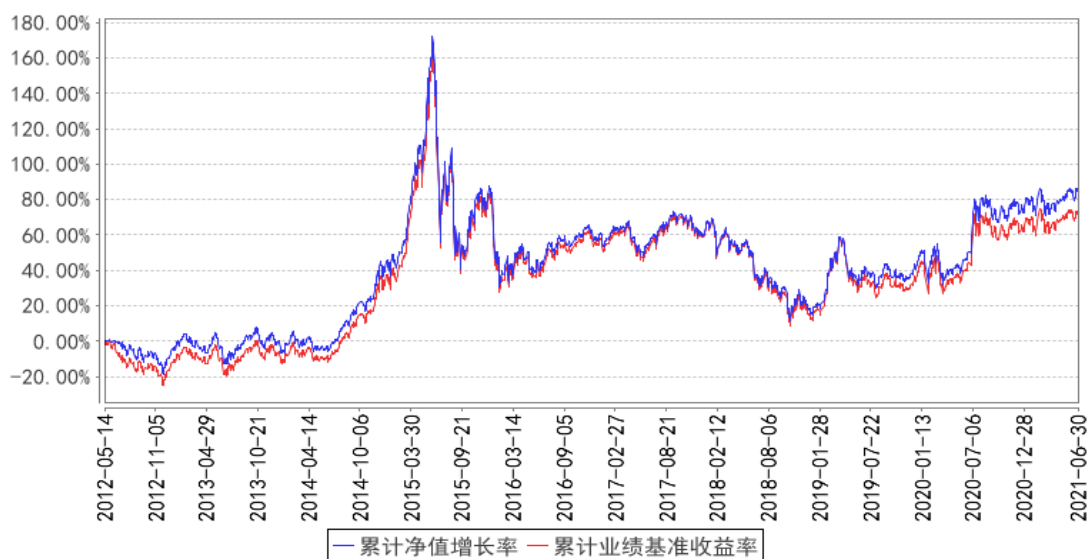
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.00%	0.69%	-0.61%	0.63%	0.61%	0.06%
过去三个月	5.94%	0.66%	4.98%	0.66%	0.96%	0.00%
过去六个月	5.28%	0.99%	4.35%	1.02%	0.93%	-0.03%
过去一年	22.43%	1.20%	19.29%	1.22%	3.14%	-0.02%
过去三年	34.88%	1.34%	27.05%	1.37%	7.83%	-0.03%
自基金合同生效起至今	85.60%	1.54%	72.65%	1.56%	12.95%	-0.02%

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指数累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产管理有限公司，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 2021 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 74 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（LOF）、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、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、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、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、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、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、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、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金

(FOF)、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

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、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统也主要是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，公司旗下部分基金基金经理。	2012 年 5 月 14 日	-	20 年	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 月起担任浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。2012 年 3 月担任本公司职工监事。2012 年 5 月起，担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，担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，担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，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 4 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。2020 年 6 月起，担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。2020 年 9 月起，担任浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021 年 5 月起，担任浦银安盛鑫福混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

2、证券从业年限的计算标准遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，以及公司的规章制度，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立健全有效的公平交易执行体系，保证公平对待旗下的每一个投资组合。

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，保证公募基金及专户业务的独立投资决策机制；在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3 日，5 日）发生的不同组合对同一股票的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，在疫苗广泛接种的背景下，全球经济逐渐走向复苏。中国 GDP 上半年同比增长 12.7%，出口和制造业增长较快，消费恢复缓慢但回升态势稳健。商品价格由于短期供应端偏紧而有所提升，但通胀向下游传导的动能不足，CPI 和 PPI 均呈现冲高回落态势，受益于价格上涨的上游原材料企业股票上半年涨幅较好。国内货币环境保持适度宽松，对高景气行业成长股的估值形成一定支撑，但受到美联储可能缩减购债规模等外部因素影响，以及社融及货币供应量增速下降，市场整体估值水平还是承受一定的压力，年初估值较高的消费股上半年表现偏弱。上半年，主题板块表现与政策相关性较高，国家提出“碳达峰”、“碳中和”的远期目标，政策鼓励新能源产业加快发展，带动光伏、锂电板块在二季度大幅上涨；而一些关系到民生教育、住房等规范发展政策措施出台，使得相关领域的上市公司股价波动加大。2021 年上半年，股票市场整体呈现分化严重的结构性行情，板块间的估值差异拉大，给投资管理带来了很大的挑战。中证锐联基本面 400 指数成份股以中小盘优质成长股为主，上半年涨幅为 5.28%。

本报告期内，本基金采取完全复制指数方法，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛基本面 400 指数基金份额净值为 1.856 元，本报告期基金份额净值增长率为 5.28%；同期业绩比较基准收益率为 4.35%。

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，尽管新出现的新冠变异毒株对疫情防控产生一些扰动，但经济恢复常态的趋势不会改变，市场股票估值也将回归到稳定预期下的价值评估框架之下。上半年高景气度行业估值提升较大，后续可能会有所回调，但估值合理、成长性高的中小盘优质上市公司股票依然具有良好的投资价值。

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分管高管、金融工程部负责人、研究部负责人、风险管理部和监察稽核部负责人、基金运营部负责人组成。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签订了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十六部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金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；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；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。

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

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,220,317.92	2,025,048.51
结算备付金		-	-

存出保证金		3,227.55	3,827.35
交易性金融资产	6.4.7.2	23,623,912.04	28,633,653.26
其中：股票投资		23,623,912.04	28,633,653.26
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		175,847.96	6,911.43
应收利息	6.4.7.5	415.22	435.92
应收股利		-	-
应收申购款		1,153.42	16,000.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		26,024,874.11	30,685,877.18
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020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		37,550.12	-
应付赎回款		85,728.79	41,670.61
应付管理人报酬		21,341.82	26,173.72
应付托管费		3,201.29	3,926.06
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	11,059.44	2,350.72
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	127,970.79	168,035.44
负债合计		286,852.25	242,156.55
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	13,865,791.02	17,265,170.27
未分配利润	6.4.7.10	11,872,230.84	13,178,550.36
所有者权益合计		25,738,021.86	30,443,720.63
负债和所有者权益总计		26,024,874.11	30,685,877.18

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.856 元，基金份额总额 13,865,791.02 份。

6.2 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		1,690,917.58	1,581,484.33
1. 利息收入		7,558.20	9,483.29
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,558.20	8,945.52
债券利息收入		-	537.77
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）		2,792,666.09	1,223,413.62
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,531,460.01	881,739.87
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	720.00
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	261,206.08	340,953.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-1,110,566.46	344,243.83
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	1,259.75	4,343.59
减：二、费用		281,401.06	397,942.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	132,625.96	173,774.78
2. 托管费	6.4.10.2.2	19,893.96	26,066.21
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	28,893.19	56,095.81
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	99,987.95	142,005.76

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,409,516.52	1,183,541.77
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,409,516.52	1,183,541.77

6.3 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	17,265,170.27	13,178,550.36	30,443,720.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,409,516.52	1,409,516.52
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）	-3,399,379.25	-2,715,836.04	-6,115,215.29
其中：1. 基金申购款	407,062.98	321,711.79	728,774.77
2. 基金赎回款	-3,806,442.23	-3,037,547.83	-6,843,990.06
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）	13,865,791.02	11,872,230.84	25,738,021.86
项目	上年度可比期间 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	28,617,368.80	13,191,667.30	41,809,036.10

权益（基金净值）			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,183,541.77	1,183,541.77
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）	-7,067,036.59	-3,244,875.32	-10,311,911.91
其中：1. 基金申购款	855,754.17	367,740.71	1,223,494.88
2. 基金赎回款	-7,922,790.76	-3,612,616.03	-11,535,406.79
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）	21,550,332.21	11,130,333.75	32,680,665.96

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》的核准, 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 指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、存托凭证、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（含存托凭证）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%，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×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 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。

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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	2,220,317.92
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	2,220,317.92

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	21,488,162.98	23,623,912.04	2,135,749.06
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	21,488,162.98	23,623,912.04	2,135,749.06

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	413.87
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	-
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	1.35
合计	415.22

6.4.7.6 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	11,059.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	11,059.44

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	77.25
应付证券出借违约金	-
预提费用	114,630.98
应付指数使用费	13,262.56
合计	127,970.79

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,265,170.27	17,265,170.27
本期申购	407,062.98	407,062.98
本期赎回（以“-”号填列）	-3,806,442.23	-3,806,442.23
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-

本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	13,865,791.02	13,865,791.02

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,730,840.79	6,447,709.57	13,178,550.36
本期利润	2,520,082.98	-1,110,566.46	1,409,516.52
本期基金份额交易产生的变动数	-1,396,535.21	-1,319,300.83	-2,715,836.04
其中：基金申购款	169,396.03	152,315.76	321,711.79
基金赎回款	-1,565,931.24	-1,471,616.59	-3,037,547.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,854,388.56	4,017,842.28	11,872,230.84

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	7,527.21
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	1.83
其他	29.16
合计	7,558.20

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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,531,460.01
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	2,531,460.01

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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	11,712,994.00
减：卖出股票成本总额	9,181,533.99
买卖股票差价收入	2,531,460.01

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：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

注：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

注：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

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期均无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	261,206.08
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	261,206.08

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-1,110,566.46
股票投资	-1,110,566.46
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-1,110,566.46

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	1,158.69
基金转换费收入	101.06
合计	1,259.75

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

2. 本基金的转换费由转出基金赎回费和基金申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25% 归入转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	28,893.19
银行间市场交易费用	-
合计	28,893.19

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
指数使用费	55,356.97
合计	99,987.95

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至 2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	132,625.96	173,774.78
其中：支付销售机构的客户维护 费	52,943.48	71,400.35

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	19,893.96	26,066.21

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期末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

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。

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

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。

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

注：基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.10.5.2 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。

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		上年度可比期间	
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国邮储银行	2,220,317.92	7,527.21	3,011,713.47	8,817.87
--------	--------------	----------	--------------	----------

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 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
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项停牌	3.05	2021年07月14日	3.36	12,300	52,890.00	37,515.00	-
600093	*ST 易见	2021年5月6日	重大事项停牌	5.93	2021年07月07日	5.63	4,100	47,565.12	24,313.00	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 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。

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

注：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

注：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)、存托凭证、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。

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力机构，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 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0% (2020 年 12 月 31 日：0%)。

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。

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 2021 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上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 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。

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 2021 年 6 月 30 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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	2,220,317.92	-	-	-	2,220,317.92
存出保证金	3,227.55	-	-	-	3,227.55
交易性金融资产	-	-	-	23,623,912.04	23,623,912.04
应收利息	-	-	-	415.22	415.22
应收申购款	-	-	-	1,153.42	1,153.42
应收证券清算款	-	-	-	175,847.96	175,847.96
资产总计	2,223,545.47	-	-	23,801,328.64	26,024,874.11
负债					
应付赎回款	-	-	-	85,728.79	85,728.79
应付管理人报酬	-	-	-	21,341.82	21,341.82
应付托管费	-	-	-	3,201.29	3,201.29
应付证券清算款	-	-	-	37,550.12	37,550.12
应付交易费用	-	-	-	11,059.44	11,059.44
其他负债	-	-	-	127,970.79	127,970.79
负债总计	-	-	-	286,852.25	286,852.25
利率敏感度缺口	2,223,545.47	-	-	23,514,476.39	25,738,021.86
上年度末 2020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	2,025,048.51	-	-	-	2,025,048.51

存出保证金	3,827.35	-	-	3,827.35
交易性金融资产	-	-	28,633,653.26	28,633,653.26
应收证券清算款	-	-	6,911.43	6,911.43
应收利息	-	-	435.92	435.92
应收申购款	-	-	16,000.71	16,000.71
资产总计	2,028,875.86	-	28,657,001.32	30,685,877.18
负债	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	41,670.61	41,670.61
应付管理人报酬	-	-	26,173.72	26,173.72
应付托管费	-	-	3,926.06	3,926.06
应付交易费用	-	-	2,350.72	2,350.72
其他负债	-	-	168,035.44	168,035.44
负债总计	-	-	242,156.55	242,156.55
利率敏感度缺口	2,028,875.86	-	28,414,844.77	30,443,720.63

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 2021 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。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	23,623,912.04	91.79	28,633,653.26	94.05
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	23,623,912.04	91.79	28,633,653.26	94.05

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 500 基点	1,133,368.28	1,401,936.16
	业绩比较基准下降 500 基点	-1,133,368.28	-1,401,936.16

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	23,623,912.04	90.77
	其中：股票	23,623,912.04	90.77
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	2,220,317.92	8.53
8	其他各项资产	180,644.15	0.69
9	合计	26,024,874.11	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	145,176.00	0.56
B	采矿业	1,131,929.90	4.40
C	制造业	12,250,912.79	47.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	503,962.64	1.96
E	建筑业	579,036.70	2.25
F	批发和零售业	1,636,920.17	6.36
G	交通运输、仓储和邮政业	701,342.35	2.72
H	住宿和餐饮业	51,255.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	557,281.51	2.17
J	金融业	1,817,215.63	7.06
K	房地产业	865,736.29	3.36
L	租赁和商务服务业	277,964.70	1.08
M	科学研究和技术服务业	118,382.04	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	197,036.93	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	16,712.00	0.06
Q	卫生和社会工作	68,495.70	0.27
R	文化、体育和娱乐业	184,718.06	0.72
S	综合	-	-
	合计	21,104,078.41	82.00

7.2.2 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	75,900.00	0.29
C	制造业	1,278,059.28	4.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	318,265.00	1.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	60,593.00	0.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	233,843.00	0.91
J	金融业	321,734.35	1.25
K	房地产业	174,239.00	0.68
L	租赁和商务服务业	33,600.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,600.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	2,519,833.63	9.79

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：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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601233	桐昆股份	8,085	194,767.65	0.76

2	600325	华发股份	27,040	182,249.60	0.71
3	000039	中集集团	9,140	166,165.20	0.65
4	002241	歌尔股份	3,748	160,189.52	0.62
5	600418	江淮汽车	12,400	154,132.00	0.60
6	000034	神州数码	6,800	148,580.00	0.58
7	600522	中天科技	14,668	146,680.00	0.57
8	600060	海信视像	7,900	133,510.00	0.52
9	000401	冀东水泥	10,800	133,380.00	0.52
10	600176	中国巨石	8,246	127,895.46	0.50
11	600166	福田汽车	36,100	124,545.00	0.48
12	000059	华锦股份	15,100	123,216.00	0.48
13	000830	鲁西化工	6,423	120,302.79	0.47
14	000983	山西焦煤	14,470	120,245.70	0.47
15	603259	药明康德	756	118,382.04	0.46
16	300226	上海钢联	1,920	114,336.00	0.44
17	601555	东吴证券	13,708	114,324.72	0.44
18	000963	华东医药	2,452	112,816.52	0.44
19	600348	华阳股份	15,200	112,784.00	0.44
20	000728	国元证券	14,145	112,735.65	0.44
21	601699	潞安环能	9,500	112,195.00	0.44
22	000938	紫光股份	5,025	109,947.00	0.43
23	300059	东方财富	3,331	109,223.49	0.42
24	002311	海大集团	1,329	108,446.40	0.42
25	601128	常熟银行	17,200	106,640.00	0.41
26	002001	新和成	3,710	106,402.80	0.41
27	000960	锡业股份	6,518	104,483.54	0.41
28	600739	辽宁成大	4,933	102,655.73	0.40
29	600426	华鲁恒升	3,285	101,670.75	0.40
30	600390	五矿资本	17,000	101,660.00	0.39
31	600710	苏美达	16,400	101,352.00	0.39
32	002456	欧菲光	11,400	101,232.00	0.39
33	002129	中环股份	2,600	100,360.00	0.39
34	002299	圣农发展	4,200	100,296.00	0.39
35	600100	同方股份	16,400	100,204.00	0.39
36	600143	金发科技	4,800	100,128.00	0.39
37	002183	怡亚通	17,390	99,644.70	0.39
38	603858	步长制药	4,300	96,707.00	0.38
39	300760	迈瑞医疗	200	96,010.00	0.37
40	600502	安徽建工	24,500	95,060.00	0.37
41	000488	晨鸣纸业	11,600	94,424.00	0.37
42	601636	旗滨集团	5,000	92,800.00	0.36
43	600827	百联股份	4,600	92,690.00	0.36

44	002271	东方雨虹	1,675	92,661.00	0.36
45	002385	大北农	13,600	92,480.00	0.36
46	600873	XD 梅花生	16,476	92,265.60	0.36
47	000050	深天马 A	6,500	92,170.00	0.36
48	002422	科伦药业	4,614	92,049.30	0.36
49	600208	新湖中宝	30,200	91,808.00	0.36
50	600487	亨通光电	8,000	91,200.00	0.35
51	601333	广深铁路	43,000	91,160.00	0.35
52	600266	城建发展	19,096	90,515.04	0.35
53	600893	航发动力	1,700	90,423.00	0.35
54	002078	太阳纸业	6,765	90,312.75	0.35
55	000977	浪潮信息	3,200	90,016.00	0.35
56	600466	蓝光发展	30,380	89,621.00	0.35
57	000768	中航西飞	3,410	89,614.80	0.35
58	600528	中铁工业	11,000	89,100.00	0.35
59	600008	首创环保	29,588	89,059.88	0.35
60	002340	格林美	9,500	88,825.00	0.35
61	601168	西部矿业	7,400	88,282.00	0.34
62	600409	三友化工	8,670	87,653.70	0.34
63	002384	东山精密	4,200	87,528.00	0.34
64	000878	云南铜业	6,800	87,244.00	0.34
65	002081	金螳螂	10,967	86,858.64	0.34
66	002236	大华股份	4,050	85,455.00	0.33
67	000513	丽珠集团	1,707	85,384.14	0.33
68	300124	汇川技术	1,148	85,250.48	0.33
69	300070	碧水源	11,578	84,635.18	0.33
70	600801	华新水泥	4,787	84,107.59	0.33
71	000786	北新建材	2,134	83,759.50	0.33
72	002091	江苏国泰	9,200	83,720.00	0.33
73	600699	均胜电子	3,260	83,195.20	0.32
74	600584	长电科技	2,200	82,896.00	0.32
75	600085	同仁堂	2,024	82,680.40	0.32
76	600516	方大炭素	10,992	81,780.48	0.32
77	601901	方正证券	8,700	81,432.00	0.32
78	300207	欣旺达	2,500	81,400.00	0.32
79	002157	正邦科技	6,802	81,283.90	0.32
80	600859	王府井	2,789	80,546.32	0.31
81	002508	老板电器	1,730	80,445.00	0.31
82	601717	郑煤机	6,915	80,421.45	0.31
83	603799	华友钴业	700	79,940.00	0.31
84	600970	中材国际	8,700	79,779.00	0.31
85	600745	闻泰科技	800	77,520.00	0.30

86	002075	沙钢股份	7,100	77,461.00	0.30
87	000661	长春高新	200	77,400.00	0.30
88	000581	威孚高科	3,691	76,883.53	0.30
89	002233	塔牌集团	7,421	76,287.88	0.30
90	600126	杭钢股份	14,800	75,924.00	0.29
91	600096	云天化	5,400	75,816.00	0.29
92	002958	青农商行	17,700	75,756.00	0.29
93	601666	平煤股份	10,600	75,366.00	0.29
94	600498	烽火通信	4,015	74,799.45	0.29
95	600694	大商股份	3,600	74,736.00	0.29
96	002221	东华能源	6,800	74,460.00	0.29
97	002230	科大讯飞	1,100	74,338.00	0.29
98	603156	养元饮品	2,580	73,736.40	0.29
99	601216	君正集团	14,404	73,316.36	0.28
100	000690	宝新能源	14,304	73,093.44	0.28
101	600109	国金证券	5,756	73,043.64	0.28
102	600141	兴发集团	3,870	72,872.10	0.28
103	000591	太阳能	11,600	72,268.00	0.28
104	600549	厦门钨业	3,469	72,259.27	0.28
105	000627	天茂集团	19,900	72,038.00	0.28
106	002008	大族激光	1,780	71,894.20	0.28
107	000623	吉林敖东	4,638	71,842.62	0.28
108	601872	招商轮船	15,340	70,870.80	0.28
109	600079	人福医药	2,500	70,675.00	0.27
110	000016	深康佳 A	10,600	70,596.00	0.27
111	601718	际华集团	25,000	70,500.00	0.27
112	601866	中远海发	18,800	70,500.00	0.27
113	600567	山鹰国际	20,387	70,335.15	0.27
114	000036	华联控股	14,900	69,434.00	0.27
115	002416	爱施德	6,900	69,207.00	0.27
116	300146	汤臣倍健	2,100	69,090.00	0.27
117	002048	宁波华翔	3,538	68,991.00	0.27
118	600183	生益科技	2,934	68,684.94	0.27
119	300015	爱尔眼科	965	68,495.70	0.27
120	000423	东阿阿胶	1,900	68,229.00	0.27
121	002938	鹏鼎控股	1,900	68,172.00	0.26
122	000090	天健集团	12,300	68,019.00	0.26
123	002085	万丰奥威	12,100	67,760.00	0.26
124	603589	口子窖	1,000	67,690.00	0.26
125	600535	天士力	4,567	67,637.27	0.26
126	600600	青岛啤酒	580	67,077.00	0.26
127	600307	酒钢宏兴	28,700	66,584.00	0.26

128	300058	蓝色光标	11,000	66,550.00	0.26
129	601058	赛轮轮胎	6,645	66,383.55	0.26
130	600489	中金黄金	7,700	66,374.00	0.26
131	600884	杉杉股份	2,840	66,228.80	0.26
132	002563	森马服饰	5,500	65,725.00	0.26
133	002589	瑞康医药	14,800	65,564.00	0.25
134	002004	华邦健康	10,500	65,205.00	0.25
135	601108	财通证券	6,200	65,038.00	0.25
136	600004	白云机场	5,785	64,676.30	0.25
137	600150	中国船舶	3,900	64,389.00	0.25
138	600908	无锡银行	11,100	64,380.00	0.25
139	000060	中金岭南	14,180	64,093.60	0.25
140	002966	苏州银行	8,700	63,945.00	0.25
141	600565	迪马股份	25,100	63,754.00	0.25
142	600233	圆通速递	6,300	63,063.00	0.25
143	002007	华兰生物	1,716	62,942.88	0.24
144	002572	索菲亚	2,600	62,920.00	0.24
145	600667	太极实业	6,900	62,790.00	0.24
146	002294	信立泰	1,900	62,510.00	0.24
147	000540	中天金融	22,700	61,971.00	0.24
148	002080	中材科技	2,368	61,970.56	0.24
149	600061	国投资本	7,296	61,943.04	0.24
150	603816	顾家家居	800	61,824.00	0.24
151	601567	三星医疗	2,900	61,770.00	0.24
152	000528	柳工	7,490	61,418.00	0.24
153	600039	四川路桥	9,792	61,395.84	0.24
154	000066	中国长城	4,200	61,320.00	0.24
155	600256	广汇能源	18,378	61,198.74	0.24
156	002120	韵达股份	4,480	60,614.40	0.24
157	002408	齐翔腾达	4,875	60,547.50	0.24
158	002050	三花智控	2,498	59,902.04	0.23
159	600711	盛屯矿业	8,400	59,892.00	0.23
160	600729	重庆百货	2,178	59,786.10	0.23
161	600160	巨化股份	6,763	59,784.92	0.23
162	000902	新洋丰	3,800	59,394.00	0.23
163	300408	三环集团	1,400	59,388.00	0.23
164	000078	海王生物	18,100	59,006.00	0.23
165	000807	云铝股份	4,922	58,571.80	0.23
166	600497	驰宏锌锗	13,526	58,297.06	0.23
167	600612	老凤祥	1,100	58,267.00	0.23
168	002602	世纪华通	8,940	57,394.80	0.22
169	600623	华谊集团	6,500	57,265.00	0.22

170	600875	东方电气	5,200	57,044.00	0.22
171	601966	玲珑轮胎	1,300	56,862.00	0.22
172	000829	天音控股	6,900	56,856.00	0.22
173	002244	滨江集团	13,500	56,565.00	0.22
174	600491	龙元建设	10,500	56,490.00	0.22
175	600742	一汽富维	5,524	56,289.56	0.22
176	300122	智飞生物	300	56,019.00	0.22
177	000887	中鼎股份	4,633	55,966.64	0.22
178	600583	海油工程	12,300	55,350.00	0.22
179	600511	国药股份	1,670	55,210.20	0.21
180	601360	三六零	4,500	54,945.00	0.21
181	600809	山西汾酒	122	54,656.00	0.21
182	002203	海亮股份	5,100	54,264.00	0.21
183	000028	国药一致	1,434	54,262.56	0.21
184	600123	兰花科创	7,000	54,180.00	0.21
185	600482	中国动力	3,100	54,002.00	0.21
186	600056	中国医药	4,411	53,593.65	0.21
187	600879	航天电子	7,100	53,392.00	0.21
188	601886	江河集团	6,181	53,280.22	0.21
189	600588	用友网络	1,600	53,216.00	0.21
190	600664	哈药股份	18,400	53,176.00	0.21
191	300072	三聚环保	9,200	52,808.00	0.21
192	600295	鄂尔多斯	2,900	51,881.00	0.20
193	002310	东方园林	15,200	51,832.00	0.20
194	000921	海信家电	3,600	51,732.00	0.20
195	600369	西南证券	10,566	51,456.42	0.20
196	000951	中国重汽	1,900	51,414.00	0.20
197	300003	乐普医疗	1,600	51,392.00	0.20
198	600691	阳煤化工	15,000	51,300.00	0.20
199	600754	锦江酒店	900	51,255.00	0.20
200	601000	唐山港	21,174	51,029.34	0.20
201	600038	中直股份	964	50,841.36	0.20
202	600308	华泰股份	9,200	50,784.00	0.20
203	601198	东兴证券	4,600	50,278.00	0.20
204	002841	视源股份	400	49,716.00	0.19
205	002500	山西证券	7,403	49,674.13	0.19
206	600483	福能股份	4,700	49,303.00	0.19
207	600298	安琪酵母	900	48,942.00	0.19
208	600997	开滦股份	6,500	48,750.00	0.19
209	000686	东北证券	5,736	48,469.20	0.19
210	603806	福斯特	460	48,359.80	0.19
211	600380	健康元	3,514	48,247.22	0.19

212	600582	天地科技	12,338	48,118.20	0.19
213	600058	五矿发展	6,100	48,068.00	0.19
214	002010	传化智联	6,200	47,802.00	0.19
215	600111	北方稀土	2,300	47,610.00	0.18
216	002831	裕同科技	1,600	47,504.00	0.18
217	000550	江铃汽车	2,000	46,860.00	0.18
218	000501	鄂武商 A	4,000	46,800.00	0.18
219	002701	奥瑞金	8,918	45,838.52	0.18
220	600335	国机汽车	7,700	45,661.00	0.18
221	601021	春秋航空	800	45,520.00	0.18
222	000999	华润三九	1,698	45,421.50	0.18
223	000933	神火股份	4,800	45,360.00	0.18
224	002152	广电运通	3,477	45,305.31	0.18
225	600598	北大荒	3,000	44,880.00	0.17
226	002191	劲嘉股份	4,212	44,815.68	0.17
227	600835	上海机电	2,756	44,785.00	0.17
228	601611	中国核建	6,200	44,764.00	0.17
229	002128	露天煤业	4,300	44,763.00	0.17
230	600597	光明乳业	3,104	44,728.64	0.17
231	002032	苏泊尔	700	44,653.00	0.17
232	002242	九阳股份	1,372	44,576.28	0.17
233	000877	天山股份	3,414	44,484.42	0.17
234	600737	中粮糖业	4,431	44,354.31	0.17
235	002745	木林森	3,300	44,220.00	0.17
236	002936	郑州银行	12,010	44,076.70	0.17
237	600569	安阳钢铁	14,400	44,064.00	0.17
238	600580	卧龙电驱	3,300	43,890.00	0.17
239	603369	今世缘	800	43,328.00	0.17
240	600682	南京新百	4,300	43,258.00	0.17
241	002555	三七互娱	1,800	43,236.00	0.17
242	600959	江苏有线	14,160	43,188.00	0.17
243	000717	韶钢松山	9,400	43,146.00	0.17
244	000750	国海证券	10,128	42,942.72	0.17
245	600064	南京高科	4,605	42,780.45	0.17
246	002440	闰土股份	4,819	42,648.15	0.17
247	601878	浙商证券	3,200	41,856.00	0.16
248	600420	国药现代	4,200	41,370.00	0.16
249	600977	中国电影	3,300	41,349.00	0.16
250	600037	歌华有线	4,301	41,332.61	0.16
251	000600	建投能源	8,400	41,244.00	0.16
252	600971	恒源煤电	6,200	41,230.00	0.16
253	600787	中储股份	7,687	40,971.71	0.16

254	600373	中文传媒	4,147	40,889.42	0.16
255	300741	华宝股份	800	40,576.00	0.16
256	000975	银泰黄金	4,240	40,322.40	0.16
257	000559	万向钱潮	7,581	40,255.11	0.16
258	601808	中海油服	2,800	40,208.00	0.16
259	000598	兴蓉环境	7,717	40,205.57	0.16
260	601098	中南传媒	4,528	39,936.96	0.16
261	600863	内蒙华电	17,100	39,843.00	0.15
262	600415	小商品城	7,700	39,655.00	0.15
263	002673	西部证券	4,800	39,600.00	0.15
264	002624	完美世界	1,650	39,451.50	0.15
265	002013	中航机电	3,903	39,303.21	0.15
266	600648	外高桥	2,651	39,181.78	0.15
267	600273	嘉化能源	4,500	39,150.00	0.15
268	601928	凤凰传媒	5,412	38,641.68	0.15
269	600073	上海梅林	4,700	38,493.00	0.15
270	000543	皖能电力	10,125	38,373.75	0.15
271	002372	伟星新材	1,844	38,115.48	0.15
272	000729	燕京啤酒	5,200	37,648.00	0.15
273	603766	隆鑫通用	10,335	37,516.05	0.15
274	600811	东方集团	12,300	37,515.00	0.15
275	600062	华润双鹤	3,140	37,397.40	0.15
276	000789	万年青	3,248	37,157.12	0.14
277	002926	华西证券	3,800	36,594.00	0.14
278	601179	中国西电	8,800	36,256.00	0.14
279	600395	盘江股份	5,100	36,210.00	0.14
280	002065	东华软件	4,520	35,843.60	0.14
281	600566	济川药业	2,000	35,800.00	0.14
282	002237	恒邦股份	3,112	35,756.88	0.14
283	600312	平高电气	6,100	35,624.00	0.14
284	000723	美锦能源	4,700	35,532.00	0.14
285	600968	海油发展	13,600	35,224.00	0.14
286	600026	中远海能	5,700	35,112.00	0.14
287	002042	华孚时尚	7,200	34,776.00	0.14
288	600909	华安证券	6,200	34,534.00	0.13
289	600546	山煤国际	4,800	34,464.00	0.13
290	300033	同花顺	300	33,834.00	0.13
291	603899	晨光文具	400	33,824.00	0.13
292	600973	宝胜股份	8,200	33,784.00	0.13
293	002061	浙江交科	6,300	33,390.00	0.13
294	000046	泛海控股	14,500	33,350.00	0.13
295	601231	环旭电子	1,982	33,317.42	0.13

296	000021	深科技	1,739	33,284.46	0.13
297	002302	西部建设	4,200	33,180.00	0.13
298	000826	启迪环境	6,185	33,089.75	0.13
299	600803	新奥股份	2,000	33,020.00	0.13
300	002217	合力泰	9,100	32,487.00	0.13
301	603328	依顿电子	4,300	32,035.00	0.12
302	603885	吉祥航空	2,080	31,740.80	0.12
303	002251	步步高	4,311	31,728.96	0.12
304	002948	青岛银行	6,300	31,311.00	0.12
305	603833	欧派家居	220	31,231.20	0.12
306	002419	天虹股份	4,750	31,160.00	0.12
307	603198	迎驾贡酒	700	31,010.00	0.12
308	600748	上实发展	6,700	30,820.00	0.12
309	601212	白银有色	11,800	30,798.00	0.12
310	000030	富奥股份	4,800	30,576.00	0.12
311	601163	三角轮胎	2,100	30,492.00	0.12
312	600928	西安银行	6,500	30,290.00	0.12
313	600094	大名城	8,000	30,160.00	0.12
314	601958	金钼股份	4,600	29,808.00	0.12
315	600120	浙江东方	6,964	29,805.92	0.12
316	601298	青岛港	4,700	29,046.00	0.11
317	000031	大悦城	7,872	28,339.20	0.11
318	601860	紫金银行	7,800	28,314.00	0.11
319	000990	诚志股份	2,200	28,006.00	0.11
320	000987	越秀金控	2,200	27,852.00	0.11
321	000537	广宇发展	5,300	27,719.00	0.11
322	601139	深圳燃气	4,200	27,552.00	0.11
323	000967	盈峰环境	4,000	27,480.00	0.11
324	600901	江苏租赁	5,000	26,000.00	0.10
325	002939	长城证券	2,300	25,599.00	0.10
326	000950	重药控股	5,000	25,150.00	0.10
327	000800	一汽解放	2,300	24,886.00	0.10
328	600093	*ST 易见	4,100	24,313.00	0.09
329	603056	德邦股份	2,200	24,178.00	0.09
330	000596	古井贡酒	100	23,950.00	0.09
331	000156	华数传媒	3,100	23,901.00	0.09
332	603260	合盛硅业	300	23,073.00	0.09
333	002468	申通快递	3,000	22,860.00	0.09
334	600299	安迪苏	1,600	19,136.00	0.07
335	002607	中公教育	800	16,712.00	0.06
336	603609	禾丰股份	1,600	16,672.00	0.06
337	000958	东方能源	2,100	9,219.00	0.04

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	601377	兴业证券	17,500	169,050.00	0.66
2	600703	三安光电	3,900	124,995.00	0.49
3	600637	东方明珠	14,700	120,393.00	0.47
4	600500	中化国际	15,000	117,900.00	0.46
5	600332	白云山	3,400	115,090.00	0.45
6	600271	航天信息	8,200	106,846.00	0.42
7	000783	长江证券	13,700	100,284.00	0.39
8	600507	方大特钢	12,300	83,394.00	0.32
9	002131	利欧股份	32,000	74,880.00	0.29
10	300274	阳光电源	600	69,036.00	0.27
11	600021	上海电力	9,300	64,263.00	0.25
12	300677	英科医疗	500	62,400.00	0.24
13	600663	陆家嘴	4,600	61,272.00	0.24
14	600578	京能电力	20,500	61,090.00	0.24
15	000883	湖北能源	13,300	61,047.00	0.24
16	000027	深圳能源	6,200	56,854.00	0.22
17	600320	振华重工	14,800	50,172.00	0.19
18	600885	宏发股份	800	50,160.00	0.19
19	600720	祁连山	4,700	49,538.00	0.19
20	600216	浙江医药	3,000	48,030.00	0.19
21	000685	中山公用	5,800	47,328.00	0.18
22	000718	苏宁环球	5,700	47,253.00	0.18
23	600436	片仔癀	100	44,830.00	0.17
24	000937	冀中能源	11,000	43,230.00	0.17
25	688036	传音控股	200	41,900.00	0.16
26	600657	信达地产	11,600	40,368.00	0.16
27	600643	爱建集团	5,600	39,088.00	0.15
28	601615	明阳智能	2,400	38,856.00	0.15
29	002558	巨人网络	2,900	38,570.00	0.15
30	000301	东方盛虹	1,800	37,620.00	0.15
31	002252	上海莱士	5,000	37,450.00	0.15
32	002648	卫星石化	900	35,271.00	0.14
33	601828	美凯龙	2,800	33,600.00	0.13
34	000672	上峰水泥	1,900	33,212.00	0.13
35	000582	北部湾港	4,000	33,200.00	0.13
36	601001	晋控煤业	4,500	32,670.00	0.13
37	600167	联美控股	3,100	27,683.00	0.11
38	000828	东莞控股	2,300	27,393.00	0.11
39	002429	兆驰股份	4,500	27,315.00	0.11

40	600231	凌钢股份	9,000	25,650.00	0.10
41	600510	黑牡丹	3,800	25,346.00	0.10
42	603866	桃李面包	800	24,960.00	0.10
43	600760	中航沈飞	400	24,120.00	0.09
44	002705	新宝股份	900	23,625.00	0.09
45	601801	皖新传媒	5,000	23,600.00	0.09
46	601528	瑞丰银行	855	13,312.35	0.05
47	001208	华菱线缆	736	5,689.28	0.02

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	601377	兴业证券	167,300.00	0.55
2	600703	三安光电	124,176.00	0.41
3	600637	东方明珠	120,323.00	0.40
4	600500	中化国际	119,076.00	0.39
5	600332	白云山	116,216.00	0.38
6	600271	航天信息	106,928.00	0.35
7	601233	桐昆股份	101,478.00	0.33
8	000783	长江证券	100,010.00	0.33
9	600325	华发股份	84,576.00	0.28
10	600507	方大特钢	83,517.00	0.27
11	000034	神州数码	81,490.00	0.27
12	000401	冀东水泥	77,490.00	0.25
13	002131	利欧股份	75,200.00	0.25
14	300274	阳光电源	69,060.00	0.23
15	002966	苏州银行	64,119.00	0.21
16	002456	欧菲光	64,008.00	0.21
17	600021	上海电力	63,891.00	0.21
18	600522	中天科技	62,874.00	0.21
19	300677	英科医疗	62,046.00	0.20
20	600578	京能电力	61,090.00	0.20

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	601012	隆基股份	526,486.46	1.73
2	600438	通威股份	313,059.00	1.03
3	000830	鲁西化工	167,985.00	0.55

4	000039	中集集团	145,155.00	0.48
5	002475	立讯精密	142,459.62	0.47
6	601233	桐昆股份	136,117.00	0.45
7	300124	汇川技术	130,118.50	0.43
8	000488	晨鸣纸业	110,807.00	0.36
9	600426	华鲁恒升	108,067.00	0.35
10	600827	百联股份	102,795.00	0.34
11	600409	三友化工	102,474.00	0.34
12	600315	上海家化	101,517.52	0.33
13	601636	旗滨集团	101,220.00	0.33
14	300433	蓝思科技	98,100.00	0.32
15	002714	牧原股份	95,537.16	0.31
16	000012	南玻 A	94,254.46	0.31
17	000683	远兴能源	94,117.72	0.31
18	601168	西部矿业	93,219.00	0.31
19	000963	华东医药	93,061.00	0.31
20	300122	智飞生物	92,645.00	0.30

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	5,282,359.23
卖出股票收入（成交）总额	11,712,994.00

注：“买入股票的成本”和“卖出股票的收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	3,227.55
2	应收证券清算款	175,847.96
3	应收股利	-
4	应收利息	415.22
5	应收申购款	1,153.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	180,644.15

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
2,315	5,989.54	496,274.79	3.58	13,369,516.23	96.42

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	111,120.66	0.80

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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	0~10
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 (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	17,265,170.27
本报告期基金总申购份额	407,062.98
减：本报告期基金总赎回份额	3,806,442.23
本报告期基金拆分变动份额 (份额减 少以“-”填列)	-
本报告期末基金份额总额	13,865,791.02

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、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	
海通证券	2	16,841,837.93	100.00%	15,685.48	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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

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	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	规定网站	2021 年 01 月 22 日
2	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同的公告	报刊及规定网站	2021 年 03 月 31 日
3	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同	规定网站	2021 年 03 月 31 日
4	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2020 年年度报告	规定网站	2021 年 03 月 31 日
5	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（更新）2021 年第 1 号	规定网站	2021 年 04 月 01 日
6	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2021 年 04 月 01 日
7	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定网站	2021 年 04 月 22 日

8	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金调整基金投资范围及（或）引入侧袋机制并相应修改法律文件的公告	报刊及规定网站	2021 年 06 月 24 日
9	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2021 年 06 月 24 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（更新）2021 年第 2 号	规定网站	2021 年 06 月 24 日
11	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金托管协议	规定网站	2021 年 06 月 24 日
12	浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金合同	规定网站	2021 年 06 月 24 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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锐联基本面 400 指数证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数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规定媒介上披露的各项公告
- 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

2021 年 8 月 31 日