

浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式
指数证券投资基金
2021 年第 3 季度报告

2021 年 9 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：华夏银行股份有限公司

报告送出日期：2021 年 10 月 26 日

§ 1 重要提示

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

基金托管人华夏银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 7 月 22 日起至 2021 年 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛中证 ESG 120 策略 ETF
场内简称	ESGETF
基金主代码	516720
前端交易代码	516720
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 22 日
报告期末基金份额总额	234,337,807.00 份
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	中证 ESG 120 策略指数收益率
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。本基金为指数型基金，主要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。
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	华夏银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2021 年 7 月 22 日-2021 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	-2, 898, 302. 52
2. 本期利润	-8, 585, 253. 11
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0234
4. 期末基金资产净值	228, 286, 519. 27
5. 期末基金份额净值	0. 9742

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、本基金《基金合同》2021 年 7 月 22 日生效。以上财务指标中“本期”指 2021 年 7 月 22 日（基金合同生效日）至 2021 年 9 月 30 日。

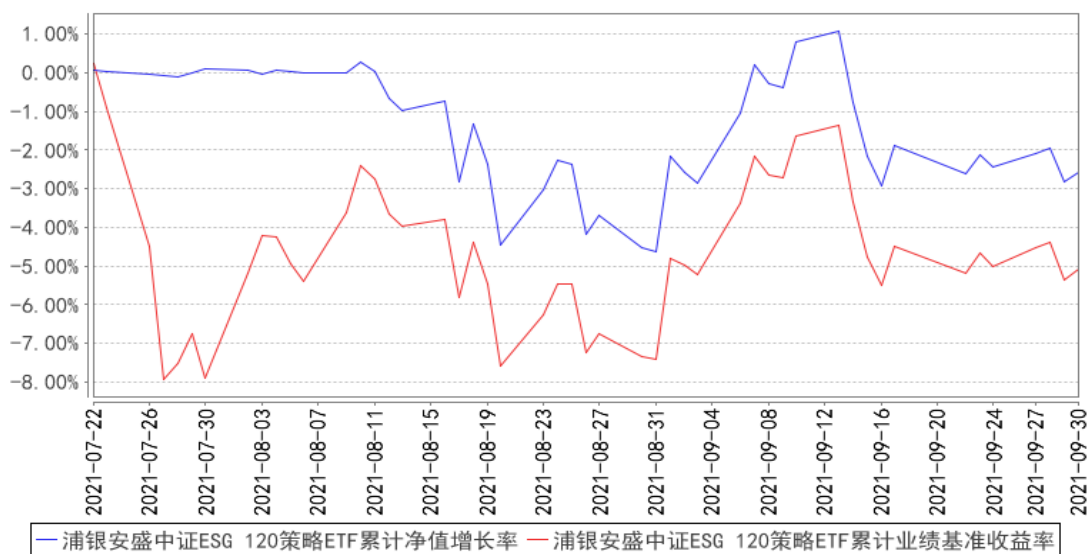
3.2 基金净值表现

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	净值增长率 ①	净值增长率 标准差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①-③	②-④
自基金合同 生效起至今	-2.58%	0.95%	-5.08%	1.38%	2.50%	-0.43%

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

浦银安盛中证 ESG 120 策略 ETF 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2021 年 7 月 22 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满 1 年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2021 年 7 月 22 日至 2022 年 1 月 21 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高钢杰	本基金的基金经理	2021 年 7 月 22 日	-	11 年	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。2020 年 7 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 7 月起担任浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起担任浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
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。	2021 年 7 月 22 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。2021 年 7 月起担任浦银安盛中证 ESG 120 策略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，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内未有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日，3日，5日和10日）发生的不同组合对同一股票与债券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；另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，A股市场窄幅震荡，结构分化明显，小盘风格优于大盘风格，价值风格优于成长风格。报告期末，上证指数下跌 0.64%，沪深 300 指数下跌 6.85%，创业板指数下跌 6.69%，中证 1000 上涨 4.54%。跟踪标的 ESG120 策略指数下跌 8.16%。期间，市场行情分化，采掘、公共事业、有色金属等行业涨幅较大，医药生物、休闲服务、食品饮料等行业跌幅较大。基本上，供需紧张是 A 股三季度的主线。由于全球大宗商品价格的上涨，加上国内双碳政策对产业结构和能源结构

的调整等原因，国内许多产业的供需结构持续偏紧张。因此，市场风格向上游资源和低估值行业切换，使得医药、消费等成长行业在三季度出现了较大幅度的调整。虽然前期政策对基本面产生了压制，但是我们也看到近期政策面正发生积极的变化。货币政策方面，7月15日央行已经全面降准，未来不排除进一步降准的可能性。财政政策方面，近两个月国债和地方债发行也明显加速。730 中央政治局会议后各项稳增长措施在逐步落地。四季度，我们认为国内政策偏向宽松，稳增长成为主基调，预计 A 股市场仍将延续结构性行情。

在投资策略方面，作为投资于中证 ESG120 策略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。本基金以获取沪深 300 指数中 ESG 评分以及估值、股息、质量、市场因子综合得分较高组合的长期收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的条件下，构建紧密跟踪标的指数的投资组合。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛中证 ESG 120 策略 ETF 基金份额净值为 0.9742 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.58%；同期业绩比较基准收益率为-5.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	221,716,422.21	95.85
	其中：股票	221,716,422.21	95.85
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	9,252,190.18	4.00

8	其他资产	340,494.90	0.15
9	合计	231,309,107.29	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,243,502.00	0.54
C	制造业	115,818,940.00	50.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,843,400.00	1.68
E	建筑业	11,297,950.00	4.95
F	批发和零售业	1,351,464.00	0.59
G	交通运输、仓储和邮政业	7,009,979.00	3.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,410,773.00	3.25
J	金融业	57,167,748.00	25.04
K	房地产业	6,039,144.00	2.65
L	租赁和商务服务业	4,247,180.00	1.86
M	科学研究和技术服务业	840,096.00	0.37
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	4,500,510.00	1.97
R	文化、体育和娱乐业	697,440.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	221,468,126.00	97.01

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	189,730.22	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	51,276.58	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	3,944.29	0.00
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	248,296.21	0.11

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	274,000	13,823,300.00	6.06
2	600519	贵州茅台	4,800	8,784,000.00	3.85
3	000858	五粮液	38,700	8,490,393.00	3.72
4	601601	中国太保	276,600	7,506,924.00	3.29
5	000333	美的集团	85,900	5,978,640.00	2.62
6	002415	海康威视	104,000	5,720,000.00	2.51
7	600309	万华化学	52,900	5,647,075.00	2.47
8	601919	中远海控	320,200	5,533,056.00	2.42
9	600030	中信证券	205,400	5,192,512.00	2.27
10	600276	恒瑞医药	99,400	4,992,862.00	2.19

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688697	纽威数控	5,837	71,328.14	0.03
2	688772	珠海冠宇	3,686	53,188.98	0.02
3	301078	孩子王	7,551	43,569.27	0.02
4	001217	华尔泰	1,239	20,530.23	0.01
5	301069	凯盛新材	539	12,413.17	0.01

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

注：本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

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

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	337,868.58
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,626.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	340,494.90

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末不存在指数投资前十名股票中存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688697	纽威数控	71,328.14	0.03	新股锁定
2	688772	珠海冠宇	53,188.98	0.02	新股流通受限
3	301078	孩子王	43,569.27	0.02	新股流通受限
4	301069	凯盛新材	12,413.17	0.01	新股锁定

§6 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年7月22日)基金份额总额	504,337,807.00
---------------------------	----------------

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	43,500,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	313,500,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	234,337,807.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛中证 ESG 120 策略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 ESG 120 策略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 ESG 120 策略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 ESG 120 策略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

9.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（www.py-axa.com）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 10 月 26 日