

# 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 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。

本报告期自 2021 年 8 月 31 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

|   |           |
|---|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 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         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 错误!未定义书签。 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 9         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>9</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 9         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 14        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 15        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 15        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 16        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 17        |
| 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明        | 错误!未定义书签。 |
| 4.10 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      | 17        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>17</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 17        |
| 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 | 17        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 17        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>18</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 18        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 18        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>19</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 19        |
| 7.2 利润表                                 | 21        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 22        |
| 7.4 报表附注                                | 23        |

|                                       |           |
|---------------------------------------|-----------|
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                     | <b>49</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                        | 49        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                  | 49        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细     | 50        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动                   | 52        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                  | 53        |
| 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细    | 53        |
| 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 54        |
| 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 54        |
| 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细    | 54        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明             | 54        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明             | 54        |
| 8.12 投资组合报告附注                         | 54        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息</b>                  | <b>55</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构                 | 55        |
| 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况              | 55        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况      | 56        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动</b>                 | <b>56</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示</b>                    | <b>57</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议                      | 57        |
| 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动      | 57        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼           | 57        |
| 11.4 基金投资策略的改变                        | 57        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况                 | 57        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况         | 57        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况                | 57        |
| 11.8 其他重大事件                           | 58        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>            | <b>59</b> |
| 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况    | 59        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息                   | 59        |
| <b>§ 13 备查文件目录</b>                    | <b>60</b> |
| 13.1 备查文件目录                           | 60        |
| 13.2 存放地点                             | 60        |
| 13.3 查阅方式                             | 60        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|                 |                        |                   |
|-----------------|------------------------|-------------------|
| 基金名称            | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金 |                   |
| 基金简称            | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合        |                   |
| 基金主代码           | 012299                 |                   |
| 基金运作方式          | 契约型开放式                 |                   |
| 基金合同生效日         | 2021 年 8 月 31 日        |                   |
| 基金管理人           | 浦银安盛基金管理有限公司           |                   |
| 基金托管人           | 中国邮政储蓄银行股份有限公司         |                   |
| 报告期末基金份额总额      | 1,052,965,356.35 份     |                   |
| 基金合同存续期         | 不定期                    |                   |
| 下属分级基金的基金简称     | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A      | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码     | 012299                 | 012300            |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 1,030,286,888.05 份     | 22,678,468.30 份   |

### 2.2 基金产品说明

|        |   |
|--------|---|
| 投资目标   | 在严格控制投资风险的前提下，力争实现超过业绩比较基准的投资回报。  |
| 投资策略   | 本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置、久期管理、类属配置进行动态管理，寻找各类资产的潜在良好投资机会。整体投资通过对风险的严格控制，运用多种积极的资产管理增值策略，实现本基金的投资目标。    |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率×15%+中证全债指数收益率×80%+恒生指数收益率×5%   |
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金，其预期风险收益水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。<br>本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

### 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                    |
|         | 联系电话                           | 021-23212888          |
|         | 电子邮箱                           | compliance@py-axa.com |
| 客户服务电话  | 021-33079999 或<br>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                 | 北京市西城区金融大街 3 号        |

|       |                        |                    |
|-------|------------------------|--------------------|
|       | 东大道 981 号 3 幢 316 室    |                    |
| 办公地址  | 上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼 | 北京市西城区金融大街 3 号 A 座 |
| 邮政编码  | 200020                 | 100808             |
| 法定代表人 | 谢伟                     | 张金良                |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                  |
|---------------------|------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 《中国证券报》          |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网址 | www.py-axa.com   |
| 基金年度报告备置地点          | 基金管理人、基金托管人的办公场所 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称                       | 办公地址                        |
|--------|--------------------------|-----------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所<br>(特殊普通合伙) | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼 |
| 注册登记机构 | 浦银安盛基金管理有限公司             | 上海市淮海中路 381 号 38 楼          |

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 2021 年 8 月 31 日(基金合同生效日)-2021 年 12 月 31 日 |                   |
|---------------|---|-------------------|
|               | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A                         | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C |
| 本期已实现收益       | -5,869,592.29                             | -155,520.16       |
| 本期利润          | -4,973,776.31                             | -135,893.23       |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0048                                   | -0.0060           |
| 本期加权平均净值利润率   | -0.49%                                    | -0.60%            |
| 本期基金份额净值增长率   | -0.48%                                    | -0.60%            |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末                                   |                   |
| 期末可供分配利润      | -5,872,387.61                             | -155,589.92       |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0057                                   | -0.0069           |
| 期末基金资产净值      | 1,025,311,028.04                          | 22,542,552.16     |
| 期末基金份额净值      | 0.9952                                    | 0.9940            |
| 3.1.3 累计期     | 2021 年末                                   |                   |

|             |        |        |
|-------------|--------|--------|
| 末指标         |        |        |
| 基金份额累计净值增长率 | -0.48% | -0.60% |

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。

5、本基金《基金合同》2021年8月31日生效，至报告期末，合同成立未满一年。

### 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

浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A

| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.34%    | 0.17%       | 1.11%      | 0.15%         | -0.77% | 0.02% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.48%   | 0.16%       | 1.18%      | 0.16%         | -1.66% | 0.00% |

浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C

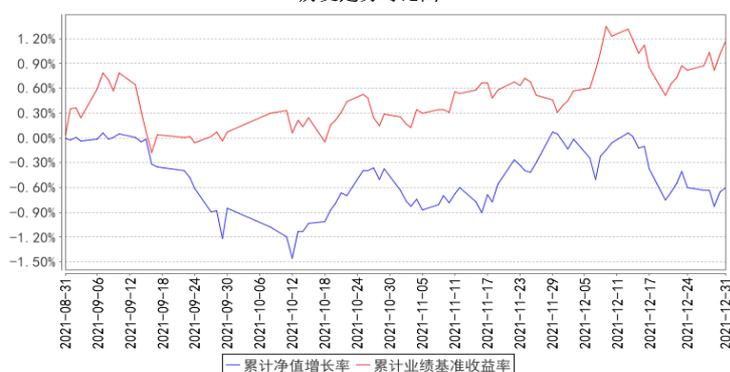
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④   |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去三个月      | 0.25%    | 0.16%       | 1.11%      | 0.15%         | -0.86% | 0.01% |
| 自基金合同生效起至今 | -0.60%   | 0.16%       | 1.18%      | 0.16%         | -1.78% | 0.00% |

### 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

浦银安盛安裕回报一年持有期混合A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



浦银安盛安裕回报一年持有期混合C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

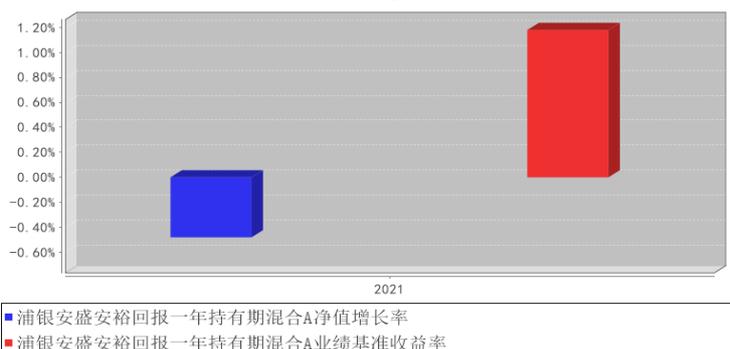


注：1、本基金合同生效日为 2021 年 8 月 31 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未 满 1 年。

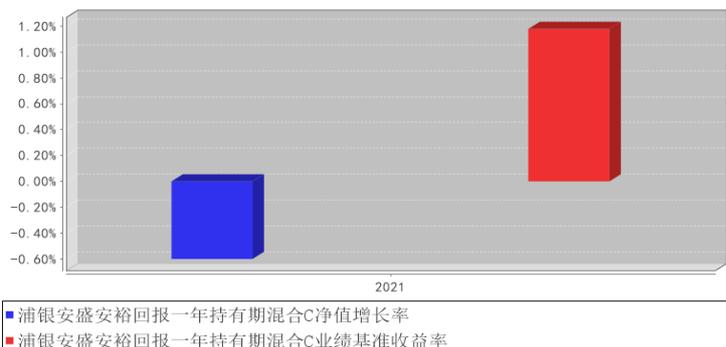
2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2021 年 8 月 31 日至 2022 年 2 月 28 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛安裕回报一年持有期混合A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



浦银安盛安裕回报一年持有期混合C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2021 年 8 月 31 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行过利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 89 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 三年持有期混合型发起式基金中基金 (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、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证

券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、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、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深游戏及文化传媒交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛 CFETS 0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银安盛颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛品质优选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联接基金、浦银安盛中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金。

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 |        |  |
| 褚艳辉 | 公司绝对收益部总经理，公司旗下部分基金基金 | 2021 年 8 月 31 日 | -    | 13 年   | 褚艳辉先生，南京理工大学经济学硕士。2004 年 8 月至 2008 年 4 月间曾在上海信息中心担任宏观经济、政策研究员。2008 年 5 月到 2010 年 9 月在爱建证券公司担任制造与消费大类行业高级研究员，后在上海汽车财务公司短暂担任投资经理助理之职。2011 年 4 月加盟本公司担任高级行业研究员。 |

|  |     |  |  |   |
|--|-----|--|--|---|
|  | 经理。 |  |  | <p>2013 年 2 月至 2014 年 6 月，担任本公司权益类基金基金经理助理，现任公司绝对收益部总经理。2014 年 6 月起，担任公司旗下浦银安盛盛世精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2014 年 7 月至 2018 年 11 月，担任公司旗下浦银安盛新经济结构灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2017 年 3 月至 2021 年 3 月，担任公司旗下浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。2019 年 7 月至 2021 年 8 月担任浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金基金经理。2017 年 2 月起，担任公司旗下浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2018 年 4 月起，担任浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。2018 年 8 月起，担任浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金基金经理。2020 年 6 月起，担任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基金经理。2020 年 7 月起，担任浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金基金经理。2020 年 12 月起，担任浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金基金经理。2021 年 8 月起担任浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|-----|--|--|---|

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期。

2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

管理人制定了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》，并进行了多次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交

易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节，预防和发现可能违反公平交易的异常情况，并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括：

- 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；
- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台；
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系；
- 要求同一基金经理管理的多个组合下达投资指令应尽量“同时同价”；
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；
- 执行投资交易系统中的公平交易程序；
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行，并对该分配过程进行监控；
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估；
- 对不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内、10 日内）管理人管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析。分析如发现有涉嫌不公平的交易，投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明，并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。
- 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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、债券交易情况进行分析，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投资标的的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。本报告期内，上述

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年，国内经济逐季回落，向中长期潜在增速回归。分解三大驱动因素，出口是拉动经济的主要动力，消费与投资力度偏弱，房地产新开工和固定资产投资下行。中央经济工作会议定调后，政策开始发力稳增长，货币政策降准降息保持流动性宽松，财政政策发力前置开展基建投资。反观海外，主要经济体面临问题更加复杂，疫情高发、经济失衡叠加通胀高企，央行意图收紧货币政策以控制通胀压力。

报告期内，A 股走势宽幅震荡，市场机会体现为阶段性与结构性，成长风格显著跑赢价值风格，沪深 300 指数下跌 5.20%，创业板指数上涨 12.02%。板块方面，“碳达峰、碳中和”政策推进，光伏装机增长、新能源汽车销量超预期等推动电力设备和新能源板块成为年度涨幅第一；部分工业品在供给受限、需求增长的背景下价格上涨，化工、有色金属、煤炭等周期板块涨幅较大。由于出行限制、疫情反复以及房地产政策调控等原因，休闲服务、家电、地产等板块跌幅较大，食品饮料、医药等整体表现一般。经济预期回落，货币政策宽松，国债收益率震荡下行，中证全债指数上涨 5.65%。

本基金于 8 月末成立，建仓期内，采取绝对收益的投资目标和稳健的投资策略。基金资产中权益占比总体不高，动态微调。总体看，2021 年权益市场发生了与往年较大的差异。面对市场风格变化与行业板块轮动加快的状况，基金保持“以稳为主、适度弹性”。投资方向主要在消费、医药、新能源、高端装备制造等。权益投资很大程度上体现出基金的风格特征，因此，基金在个股选择上既看重远期空间，也注重短期估值和盈利的匹配程度，尽量减少高波动个股对组合的影响。对于债券投资，基金选择投资高评级债券以规避信用风险可能带来的波动，采取中短久期。新股发行定价改革后，网下参与新股的收益率下行；流动性总体宽松，资金市场价格整体较低。

### 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安裕回报一年持有期混合 A 的基金份额净值为 0.9952 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.48%，同期业绩比较基准收益率为 1.18%，截至本报告期末浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C 的基金份额净值为 0.9940 元，本报告期基金份额净值增长率为-0.60%，

同期业绩比较基准收益率为 1.18%。

#### 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 2022 年，国内经济发展质量整体向好，经济有望运行在合理区间，虽然面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，但横向、纵向比较之后，我们并不悲观。国内政策“以稳为主”，消费平稳增长，政策发力适度提前，财政和货币政策更加积极有为，地方政府专项债与减税降费效果将发挥作用。海外市场复杂多变，面临着货币政策趋紧、地缘安全问题凸显、疫情高发等问题。

在新形势下，我国资本市场的内外部环境得到完善，权益资产的重要性日益凸显，全面注册制有望推出。经济结构转型带来产业趋势变化，权益资产投资逻辑也需要更新，更加聚焦于行业与赛道。金融市场开放，外资连续多年净流入，预计这一趋势有望延续。也要看到，影响证券市场的因素是复杂的，可能会阶段性导致市场的大幅回撤，因此，长期投资、价值投资、逆向投资就更显得难能可贵。

从行业比较的角度看，我们偏好依靠内需的大消费行业，大众消费品、消费升级等具备较大的空间。“双碳”背景下，光伏与电动车长期投资逻辑顺畅，部分公司具备全球竞争力。体现中国优势的高端装备制造、军工安全等行业有望延续较高的景气度。“稳增长”背景下，新老基建有望共同发力托底经济，也将是一条投资主线。我们关注行业供需格局与价格趋势，把握新兴产业的“微笑曲线”带来的投资机会。当然，最终的落脚点就是以合理的估值选出好的投资标的。在宏观环境保持积极稳定的情况下，权益和债券市场均具有结构性的机会，我们将发挥主动管理能力积极应对，力争为净值增长做出贡献。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，强化风险及合规管理，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金份额持有人的合法权益。

2021 年以来，公司进一步强化合规风险意识，增强风险防范能力，促进公司持续、健康、稳定地高质量发展，充分保护投资者的利益，维护公司股东的合法权益，依照法律法规及监管部门的要求，结合公司实际业务开展情况，制定和修订了一系列制度流程体系，进一步完善了全面合规和风险管理机制。今年以来，公司各项合规风控审计管理方面总体上得到了良好的控制，各项控制措施切实而有效，年内未发生重大违规及风险事件。

在公司董事会的指导、管理层的支持和各部门的密切配合下，合规风控审计工作紧紧围绕公司的经营目标和计划，以及公司的特点和现状，扎扎实实地开展。2021 年，合规风控工作内容涵

盖了制度内控、法律合规、信息披露、反洗钱、风险监控、绩效评估、内部审计等工作。

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

风险管理方面，对投资合规风险、信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险、信息科技风险、声誉风险和创新产品/业务风险等均建立了完善的二层风险监控机制，平时注重加强对基金经理的培训，提升前台人员风险意识，同时进一步开发并优化量化风险评估模型，前置化风险预警能力，智能化分析各项风险并向投研人员提供线上支持，努力提升风险化解及处置能力。

审计方面，按照审计计划完成了法规要求的常规审计项目和根据风险导向开展的重要业务领域的专项审计项目，配合会计师事务所开展了重要的外部审计工作，另外还协调公司各业务部门接受了股东方浦发银行对公司开展的常规审计工作。今后将继续秉持以风险为导向的重点业务领域专项审计，同时兼顾对公司所有业务循环的审计覆盖面。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司产品估值条线分管领导、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、产品估值部负责人以及所涉及投资品种的投研部门负责人（包括但不限于权益投资部、研究部、权益专户部、固定收益投资部、固定收益专户部、信用研究部等）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》。

#### 4.8 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 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同；

在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，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分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；A 类和 C 类基金份额持有人可分别选择不同的分红方式；

基金收益分配后各类别基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类别基金份额净值减去每单位该类别基金份额收益分配金额后不能低于面值；

本基金同一类别的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。

#### 4.9 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

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”）在浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |                         |
|------------|-------------------------|
| 财务报表是否经过审计 | 是                       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见                 |
| 审计报告编号     | 普华永道中天审字(2022)第 23824 号 |

### 6.2 审计报告的基本内容

|                 |  |
|-----------------|--|
| 审计报告标题          | 审计报告   |
| 审计报告收件人         | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金(以下简称“浦银安盛安裕回报一年持有期混合”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了浦银安盛安裕回报一年持有期混合 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于浦银安盛安裕回报一年持有期混合,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | <p>浦银安盛安裕回报一年持有期混合的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估浦银安盛安裕回报一年持有期混合的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算浦银安盛安裕回报一年持有期混合、终止运</p>  |

|                 |  |
|-----------------|--|
|                 | <p>营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛安裕回报一年持有期混合的财务报告过程。</p>   |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对浦银安盛安裕回报一年持有期混合持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致浦银安盛安裕回报一年持有期混合不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称       | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)   |
| 注册会计师的姓名        | 薛竞   赵钰  |
| 会计师事务所的地址       | 中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼  |
| 审计报告日期          | 2022 年 3 月 29 日  |

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 66,976,891.22                   |
| 结算备付金           |            | 1,088,127.86                    |
| 存出保证金           |            | 132,332.90                      |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 929,200,126.07                  |
| 其中：股票投资         |            | 134,429,126.07                  |
| 基金投资            |            | -                               |
| 债券投资            |            | 794,771,000.00                  |
| 资产支持证券投资        |            | -                               |
| 贵金属投资           |            | -                               |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | 20,000,000.00                   |
| 应收证券清算款         |            | 25,490,023.40                   |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 12,451,625.38                   |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | 34.00                           |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 1,055,339,160.83                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            |                                 |
| 短期借款            |            | -                               |
| 交易性金融负债         |            | -                               |
| 衍生金融负债          | 7.4.7.3    | -                               |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               |
| 应付证券清算款         |            | 5,597,964.36                    |
| 应付赎回款           |            | -                               |
| 应付管理人报酬         |            | 892,262.61                      |
| 应付托管费           |            | 178,452.52                      |
| 应付销售服务费         |            | 6,718.39                        |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 528,089.86                      |
| 应交税费            |            | 82,092.89                       |
| 应付利息            |            | -                               |
| 应付利润            |            | -                               |
| 递延所得税负债         |            | -                               |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 200,000.00                      |
| 负债合计            |            | 7,485,580.63                    |
| <b>所有者权益：</b>   |            |                                 |

|            |          |                  |
|------------|----------|------------------|
| 实收基金       | 7.4.7.9  | 1,052,965,356.35 |
| 未分配利润      | 7.4.7.10 | -5,111,776.15    |
| 所有者权益合计    |          | 1,047,853,580.20 |
| 负债和所有者权益总计 |          | 1,055,339,160.83 |

注：1. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额总额 1,052,965,356.35 份，其中 A 类基金份额净值 0.9952 元，A 类基金份额 1,030,286,888.05 份；C 类基金份额净值 0.9940 元，C 类基金份额 22,678,468.30 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                     | 附注号        | 本期<br>2021 年 8 月 31 日（基金合同<br>生效日）至 2021 年 12 月 31<br>日 |
|------------------------|------------|---|
| 一、收入                   |            | 404,752.58  |
| 1. 利息收入                |            | 8,502,927.80  |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 406,420.23  |
| 债券利息收入                 |            | 7,355,687.01  |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 740,820.56  |
| 证券出借利息收入               |            | -   |
| 其他利息收入                 |            | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -9,013,618.13   |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -9,079,408.13   |
| 基金投资收益                 | -          | -   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | 50,940.00   |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.5 | -   |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -   |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -   |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 14,850.00   |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 915,442.91  |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | -   |
| 减：二、费用                 |            | 5,514,422.12  |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 3,502,300.73  |
| 2. 托管费                 | 7.4.10.2.2 | 700,460.16  |

|                     |            |               |
|---------------------|------------|---------------|
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | 26,384.04     |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.19   | 1,059,322.95  |
| 5. 利息支出             |            | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -             |
| 6. 税金及附加            |            | 25,554.24     |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.20   | 200,400.00    |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |            | -5,109,669.54 |
| 减：所得税费用             |            | -             |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |            | -5,109,669.54 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |               |                  |
|--|---------------------------------------|---------------|------------------|
|  | 实收基金                                  | 未分配利润         | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 1,052,361,783.86                      | -             | 1,052,361,783.86 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -                                     | -5,109,669.54 | -5,109,669.54    |
| 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）      | 603,572.49                            | -2,106.61     | 601,465.88       |
| 其中：1. 基金申购款                            | 603,572.49                            | -2,106.61     | 601,465.88       |
| 2. 基金赎回款                               | -                                     | -             | -                |
| 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）                        | 1,052,965,356.35                      | -5,111,776.15 | 1,047,853,580.20 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

郁蓓华

基金管理人负责人

郁蓓华

主管会计工作负责人

钱琨

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金(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[2021]1307号《关于准予浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,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《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型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1,052,189,372.49元,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(2021)第0864号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年8月31日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,052,361,783.86份基金份额,其中认购资金利息折合172,411.37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《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据认购/申购费、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同类别:在投资者认购/申购基金份额时收取认购/申购费,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为A类基金份额,在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分设不同的基金代码,并分别计算和公布基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金对每笔有效认购或申购的份额设置1年的最短持有期,最短持有期内,投资者不能提出赎回申请,期满后(含到期日)投资者可以申请赎回。认、申购份额的最短持有期的起始日分别为基金合同生效日、申购申请确认日的1年对日,若1年后无对日的,则该月最后一个工作日为到期日,若该对日为非工作日,则到期日顺延至下一工作日。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资对象包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、

同业存单、货币市场工具、国债期货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)。本基金的投资组合比例为:股票投资占基金资产的比例为 0-30%,其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金保持现金及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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 15%+中证全债指数收益率 $\times$ 80%+恒生指数收益率 $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2022 年 3 月 29 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 8 月 31 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交

易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

- (1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时

的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票,根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明

确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021年12月31日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 66,976,891.22      |
| 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   | 66,976,891.22 |

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年12月31日 |                |                |
|---------------|--------------------|----------------|----------------|
|               | 成本                 | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            | 135,184,401.92     | 134,429,126.07 | -755,275.85    |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -              | -              |
| 债券            | 交易所市场              | 30,532,170.42  | 30,477,000.00  |
|               | 银行间市场              | 762,568,110.82 | 764,294,000.00 |
|               | 合计                 | 793,100,281.24 | 794,771,000.00 |
| 资产支持证券        | -                  | -              | -              |
| 基金            | -                  | -              | -              |
| 其他            | -                  | -              | -              |
| 合计            | 928,284,683.16     | 929,200,126.07 | 915,442.91     |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021年12月31日 |           |
|-------|--------------------|-----------|
|       | 账面余额               | 其中：买断式逆回购 |
| 交易所市场 | 20,000,000.00      | -         |
| 银行间市场 | -                  | -         |
| 合计    | 20,000,000.00      | -         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021年12月31日 |
|------------|--------------------|
| 应收活期存款利息   | 16,372.01          |
| 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  | 489.70             |
| 应收债券利息     | 12,415,243.83      |
| 应收资产支持证券利息 | -                  |

|            |               |
|------------|---------------|
| 应收买入返售证券利息 | 19,460.34     |
| 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         | 59.50         |
| 合计         | 12,451,625.38 |

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31日 |
|-------------|--------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 527,339.86         |
| 银行间市场应付交易费用 | 750.00             |
| 合计          | 528,089.86         |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021年12月31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        | 200,000.00         |
| 合计          | 200,000.00         |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A

| 项目            | 本期<br>2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |                  |
|---------------|---------------------------------------|------------------|
|               | 基金份额（份）                               | 账面金额             |
| 基金合同生效日       | 1,029,697,520.31                      | 1,029,697,520.31 |
| 本期申购          | 589,367.74                            | 589,367.74       |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                                     | -                |
| -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           | 1,030,286,888.05                      | 1,030,286,888.05 |

##### 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C

| 项目 | 本期<br>2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|                | 基金份额 (份)      | 账面金额          |
|----------------|---------------|---------------|
| 基金合同生效日        | 22,664,263.55 | 22,664,263.55 |
| 本期申购           | 14,204.75     | 14,204.75     |
| 本期赎回 (以“-”号填列) | -             | -             |
| 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            | 22,678,468.30 | 22,678,468.30 |

注：1. 申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2021 年 08 月 12 日至 2021 年 08 月 27 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 1,052,189,372.49 元，折合为 1,052,189,372.49 份基金份额 (其中 A 类基金份额 1,029,527,323.95 份，C 类基金份额 22,662,048.54 份)。根据《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 172,411.37 元在本基金成立后，折合为 172,411.37 份基金份额 (其中 A 类基金份额 170,196.36 份，C 类基金份额 2,215.01 份)，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同》、《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》及《浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2021 年 8 月 31 日 (基金合同生效日) 至 2021 年 11 月 29 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务自 2021 年 11 月 30 日起开始办理，赎回业务自 2022 年 8 月 31 日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分      | 未分配利润合计       |
|----------------|---------------|------------|---------------|
| 基金合同生效日        | -             | -          | -             |
| 本期利润           | -5,869,592.29 | 895,815.98 | -4,973,776.31 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -2,795.32     | 711.62     | -2,083.70     |
| 其中：基金申购款       | -2,795.32     | 711.62     | -2,083.70     |
| 基金赎回款          | -             | -          | -             |
| 本期已分配利润        | -             | -          | -             |
| 本期末            | -5,872,387.61 | 896,527.60 | -4,975,860.01 |

浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C

| 项目      | 已实现部分       | 未实现部分     | 未分配利润合计     |
|---------|-------------|-----------|-------------|
| 基金合同生效日 | -           | -         | -           |
| 本期利润    | -155,520.16 | 19,626.93 | -135,893.23 |

|                |             |           |             |
|----------------|-------------|-----------|-------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -69.76      | 46.85     | -22.91      |
| 其中：基金申购款       | -69.76      | 46.85     | -22.91      |
| 基金赎回款          | -           | -         | -           |
| 本期已分配利润        | -           | -         | -           |
| 本期末            | -155,589.92 | 19,673.78 | -135,916.14 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |            |
|-----------|---------------------------------|------------|
|           | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |            |
| 活期存款利息收入  |                                 | 397,744.44 |
| 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 |                                 | 8,321.34   |
| 其他        |                                 | 354.45     |
| 合计        |                                 | 406,420.23 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                              |               |
|------------------|---------------------------------|---------------|
|                  | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |               |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 |                                 | -9,079,408.13 |
| 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               |                                 | -9,079,408.13 |

##### 7.4.7.12.2 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8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |                |
| 卖出股票成交总额   |                                 | 294,459,524.83 |
| 减：卖出股票成本总额 |                                 | 303,538,932.96 |
| 买卖股票差价收入   |                                 | -9,079,408.13  |

##### 7.4.7.12.3 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。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                              |
|-------------------------------|---------------------------------|
|                               | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 50,940.00                       |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                               |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                               |
| 合计                            | 50,940.00                       |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                      | 本期                              |
|-------------------------|---------------------------------|
|                         | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 20,859,700.00                   |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 20,360,760.00                   |
| 减：应收利息总额                | 448,000.00                      |
| 买卖债券差价收入                | 50,940.00                       |

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

| 项目            | 本期                              |
|---------------|---------------------------------|
|               | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 14,850.00                       |
| 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            | 14,850.00                       |

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期                              |
|------------------------|---------------------------------|
|                        | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产             | 915,442.91                      |
| 股票投资                   | -755,275.85                     |
| 债券投资                   | 1,670,718.76                    |
| 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                     | 915,442.91                      |

**7.4.7.18 其他收入**

注：本基金本报告期内无其他收入。

**7.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期                              |
|-----------|---------------------------------|
|           | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 1,053,597.95                    |
| 银行间市场交易费用 | 5,725.00                        |
| 合计        | 1,059,322.95                    |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                              |
|---------|---------------------------------|
|         | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 审计费用    | 80,000.00                       |
| 信息披露费   | 120,000.00                      |
| 证券出借违约金 | -                               |
| 开户费     | 400.00                          |
| 合计      | 200,400.00                      |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

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

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

**7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金**

注：本基金本报告期内未有应支付关联方的佣金。

**7.4.10.2 关联方报酬****7.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目              | 本期                              |
|-----------------|---------------------------------|
|                 | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,502,300.73                    |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,748,494.95                    |

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数。}$$

**7.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期                              |
|----------------|---------------------------------|
|                | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 700,460.16                      |

注：支付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数。}$$

**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期                              |                   |           |
|----------------|---------------------------------|-------------------|-----------|
|                | 2021年8月31日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |                   |           |
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                |                   |           |
|                | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A               | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C | 合计        |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 0.00                            | 10,379.54         | 10,379.54 |
| 上海浦东发展银行股份有限公司 | 0.00                            | 9,712.34          | 9,712.34  |
| 浦银安盛基金管理有限公司   | 0.00                            | 291.79            | 291.79    |
| 合计             | 0.00                            | 20,383.67         | 20,383.67 |

注：1、本基金《基金合同》生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度可比期间。

2、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资

产净值的 0.35% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.35\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期内未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度可比期间。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2021 年 8 月 31 日，无上年度末可比期间。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称    | 本期<br>2021 年 8 月 31 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月<br>31 日 |            |
|----------|---|------------|
|          | 期末余额  | 当期利息收入     |
| 中国邮政储蓄银行 | 66,976,891.22                                       | 397,744.44 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

## 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

## 7.4.12.1.1 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 |
|--------|------|------------|------------|------------|-------|--------|----------|--------------|--------------|----|
| 600941 | 中国移动 | 2021-12-24 | 2022-01-05 | 新股未上市      | 57.58 | 57.58  | 18,720   | 1,077,897.60 | 1,077,897.60 | -  |
| 600941 | 中国移动 | 2021-12-24 | 2022-07-05 | 新股未上市及新股锁定 | 57.58 | 57.58  | 43,681   | 2,515,151.98 | 2,515,151.98 | -  |
| 001234 | 泰慕士  | 2021-12-31 | 2022-01-11 | 新股未上市      | 16.53 | 16.53  | 333      | 5,504.49     | 5,504.49     | -  |
| 688110 | 东芯股份 | 2021-12-03 | 2022-06-10 | 科创板锁定      | 30.18 | 40.37  | 13,623   | 411,142.14   | 549,960.51   | -  |
| 301101 | 明月镜片 | 2021-12-09 | 2022-06-16 | 创业板锁定      | 26.91 | 43.36  | 371      | 9,983.61     | 16,086.56    | -  |
| 301108 | 洁雅股份 | 2021-11-25 | 2022-06-06 | 创业板锁定      | 57.27 | 53.71  | 280      | 16,035.60    | 15,038.80    | -  |
| 301118 | 恒光股份 | 2021-11-09 | 2022-05-18 | 创业板锁定      | 22.70 | 49.02  | 315      | 7,150.50     | 15,441.30    | -  |
| 301127 | 天源环保 | 2021-12-23 | 2022-06-30 | 创业板锁定      | 12.03 | 17.12  | 1,685    | 20,270.55    | 28,847.20    | -  |
| 301133 | 金    | 2021-11-19 | 2022-05-26 | 创业         | 14.33 | 26.95  | 286      | 4,098.38     | 7,707.70     | -  |

|        |      |            |            |       |        |        |     |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|-------|--------|--------|-----|-----------|-----------|---|
|        | 钟股份  |            |            | 板锁定   |        |        |     |           |           |   |
| 301138 | 华研精机 | 2021-12-08 | 2022-06-15 | 创业板锁定 | 26.17  | 44.86  | 285 | 7,458.45  | 12,785.10 | - |
| 301168 | 通灵股份 | 2021-12-02 | 2022-06-10 | 创业板锁定 | 39.08  | 52.13  | 329 | 12,857.32 | 17,150.77 | - |
| 301177 | 迪阿股份 | 2021-12-08 | 2022-06-15 | 创业板锁定 | 116.88 | 116.08 | 449 | 52,479.12 | 52,119.92 | - |
| 301179 | 泽宇智能 | 2021-12-01 | 2022-06-08 | 创业板锁定 | 43.99  | 50.77  | 295 | 12,977.05 | 14,977.15 | - |
| 301180 | 万祥科技 | 2021-11-09 | 2022-05-16 | 创业板锁定 | 12.20  | 22.72  | 654 | 7,978.80  | 14,858.88 | - |
| 301185 | 鸥玛软件 | 2021-11-11 | 2022-05-19 | 创业板锁定 | 11.88  | 21.16  | 578 | 6,866.64  | 12,230.48 | - |
| 301193 | 家联科技 | 2021-12-02 | 2022-06-09 | 创业板锁定 | 30.73  | 29.14  | 297 | 9,126.81  | 8,654.58  | - |
| 301198 | 喜悦智行 | 2021-11-25 | 2022-06-02 | 创业板锁定 | 21.76  | 29.20  | 262 | 5,701.12  | 7,650.40  | - |
| 301211 | 亨迪药业 | 2021-12-14 | 2022-06-22 | 创业板锁定 | 25.80  | 33.65  | 967 | 24,948.60 | 32,539.55 | - |
| 301221 | 光庭信息 | 2021-12-15 | 2022-06-22 | 创业板锁定 | 69.89  | 88.72  | 280 | 19,569.20 | 24,841.60 | - |

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。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、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。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。

本基金的投资对象包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、港股通标的股票、股指期货、债券（包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券、短期融资券、超短期融资券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的比例为 0-30%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金及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。

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

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部、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、法律合规部监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，法律合规部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管人中国邮政储蓄银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|
| AAA    | 764,690,000.00          |
| AAA 以下 | -                       |
| 未评级    | 30,081,000.00           |
| 合计     | 794,771,000.00          |

注：于 2021 年 12 月 31 日，未评级部分为中期票据。债券信用评级取自第三方评级机构。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2021 年 12 月 31 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2021 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易

的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金、存出保证金和买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2021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               | 66,976,891.22 | -              | -    | -              | 66,976,891.22    |
| 结算备付金              | 1,088,127.86  | -              | -    | -              | 1,088,127.86     |
| 存出保证金              | 132,332.90    | -              | -    | -              | 132,332.90       |
| 交易性金融资产            | -             | 794,771,000.00 | -    | 134,429,126.07 | 929,200,126.07   |
| 买入返售金融资产           | 20,000,000.00 | -              | -    | -              | 20,000,000.00    |
| 应收利息               | -             | -              | -    | 12,451,625.38  | 12,451,625.38    |
| 应收申购款              | -             | -              | -    | 34.00          | 34.00            |
| 应收证券清算款            | -             | -              | -    | 25,490,023.40  | 25,490,023.40    |
| 资产总计               | 88,197,351.98 | 794,771,000.00 | -    | 172,370,808.85 | 1,055,339,160.83 |
| 负债                 |               |                |      |                |                  |
| 应付管理人报酬            | -             | -              | -    | 892,262.61     | 892,262.61       |
| 应付托管费              | -             | -              | -    | 178,452.52     | 178,452.52       |
| 应付证券清算款            | -             | -              | -    | 5,597,964.36   | 5,597,964.36     |
| 应付销售服务费            | -             | -              | -    | 6,718.39       | 6,718.39         |
| 应付交易费用             | -             | -              | -    | 528,089.86     | 528,089.86       |
| 应交税费               | -             | -              | -    | 82,092.89      | 82,092.89        |

|         |               |                |   |                 |                  |
|---------|---------------|----------------|---|-----------------|------------------|
| 其他负债    | -             | -              | - | 200,000.00      | 200,000.00       |
| 负债总计    | -             | -              | - | 7,485,580.63    | 7,485,580.63     |
| 利率敏感度缺口 | 88,197,351.98 | 794,771,000.00 | - | -164,885,228.22 | 1,047,853,580.20 |

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率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12月31日）            |
| 分析 | 市场利率上升 25 个基点      | -3,592,655.14               |
|    | 市场利率下降 25 个基点      | 3,618,442.71                |

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用浦银安盛资产配置模型，通过宏观经济、估值水平、流动性和市场政策等四个因素的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置，在严格控制投资风险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票投资比例为基金总资产的 0-30%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保持现金及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。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 134,429,126.07          | 12.83         |
| 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            | 134,429,126.07          | 12.83         |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 12.83% 因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 129,999,681.50 元，属于第二层次的余额为 798,369,554.07 元，属于第三层次的余额为 830,890.50 元。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具 830,890.50 元。本基金本年度购买第三层次的金融工具 628,643.89 元，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动或当期投资收益 202,246.61 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层级的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为 830,890.50 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 134,429,126.07   | 12.74         |
|    | 其中：股票             | 134,429,126.07   | 12.74         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 794,771,000.00   | 75.31         |
|    | 其中：债券             | 794,771,000.00   | 75.31         |
|    | 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          | 20,000,000.00    | 1.90          |
|    | 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      | 68,065,019.08    | 6.45          |
| 8  | 其他各项资产            | 38,074,015.68    | 3.61          |
| 9  | 合计                | 1,055,339,160.83 | 100.00        |

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末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  | 采矿业              | -             | -             |
| C  | 制造业              | 97,960,624.44 | 9.35          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,573,235.70 | 1.20          |
| E  | 建筑业              | -             | -             |
| F  | 批发和零售业           | 52,119.92     | 0.00          |
| 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  | 7,236,998.81  | 0.69          |
| J  | 金融业              | 8,654,100.00  | 0.83          |
| 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       | 7,923,200.00  | 0.76          |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 28,847.20     | 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        | 134,429,126.07 | 12.83 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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  | 600036 | 招商银行 | 110,000 | 5,358,100.00 | 0.51         |
| 2  | 603259 | 药明康德 | 40,000  | 4,743,200.00 | 0.45         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 2,000   | 4,100,000.00 | 0.39         |
| 4  | 600587 | 新华医疗 | 120,000 | 3,864,000.00 | 0.37         |
| 5  | 002025 | 航天电器 | 45,000  | 3,777,750.00 | 0.36         |
| 6  | 002459 | 晶澳科技 | 40,000  | 3,708,000.00 | 0.35         |
| 7  | 688187 | 时代电气 | 45,000  | 3,690,000.00 | 0.35         |
| 8  | 600941 | 中国移动 | 62,401  | 3,593,049.58 | 0.34         |
| 9  | 600702 | 舍得酒业 | 15,000  | 3,409,500.00 | 0.33         |
| 10 | 000001 | 平安银行 | 200,000 | 3,296,000.00 | 0.31         |
| 11 | 002048 | 宁波华翔 | 150,000 | 3,244,500.00 | 0.31         |
| 12 | 002508 | 老板电器 | 90,000  | 3,241,800.00 | 0.31         |
| 13 | 600111 | 北方稀土 | 70,000  | 3,206,000.00 | 0.31         |
| 14 | 688105 | 诺唯赞  | 30,000  | 3,180,000.00 | 0.30         |
| 15 | 002036 | 联创电子 | 130,000 | 3,153,800.00 | 0.30         |
| 16 | 000568 | 泸州老窖 | 12,000  | 3,046,440.00 | 0.29         |
| 17 | 603801 | 志邦家居 | 95,000  | 2,889,900.00 | 0.28         |
| 18 | 002434 | 万里扬  | 190,000 | 2,800,600.00 | 0.27         |
| 19 | 601778 | 晶科科技 | 320,000 | 2,729,600.00 | 0.26         |
| 20 | 300363 | 博腾股份 | 30,000  | 2,683,500.00 | 0.26         |
| 21 | 600821 | 金开新能 | 279,930 | 2,656,535.70 | 0.25         |
| 22 | 002271 | 东方雨虹 | 50,000  | 2,634,000.00 | 0.25         |
| 23 | 002597 | 金禾实业 | 51,000  | 2,618,850.00 | 0.25         |
| 24 | 600071 | 凤凰光学 | 50,000  | 2,573,000.00 | 0.25         |
| 25 | 300617 | 安靠智电 | 35,000  | 2,509,850.00 | 0.24         |
| 26 | 600764 | 中国海防 | 60,000  | 2,439,600.00 | 0.23         |
| 27 | 002216 | 三全食品 | 119,980 | 2,424,795.80 | 0.23         |
| 28 | 000519 | 中兵红箭 | 90,000  | 2,400,300.00 | 0.23         |
| 29 | 002935 | 天奥电子 | 60,000  | 2,208,600.00 | 0.21         |
| 30 | 600460 | 士兰微  | 40,000  | 2,168,000.00 | 0.21         |
| 31 | 002557 | 洽洽食品 | 35,000  | 2,147,600.00 | 0.20         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 32 | 002056 | 横店东磁 | 110,000 | 2,075,700.00 | 0.20 |
| 33 | 002139 | 拓邦股份 | 110,000 | 2,055,900.00 | 0.20 |
| 34 | 300171 | 东富龙  | 40,000  | 2,021,600.00 | 0.19 |
| 35 | 600406 | 国电南瑞 | 50,000  | 2,001,500.00 | 0.19 |
| 36 | 600025 | 华能水电 | 300,000 | 1,977,000.00 | 0.19 |
| 37 | 688518 | 联赢激光 | 38,000  | 1,872,260.00 | 0.18 |
| 38 | 002335 | 科华数据 | 50,000  | 1,818,000.00 | 0.17 |
| 39 | 002015 | 协鑫能科 | 110,000 | 1,810,600.00 | 0.17 |
| 40 | 600995 | 文山电力 | 90,000  | 1,788,300.00 | 0.17 |
| 41 | 688128 | 中国电研 | 60,000  | 1,773,600.00 | 0.17 |
| 42 | 300014 | 亿纬锂能 | 15,000  | 1,772,700.00 | 0.17 |
| 43 | 600416 | 湘电股份 | 80,000  | 1,751,200.00 | 0.17 |
| 44 | 300034 | 钢研高纳 | 30,000  | 1,728,000.00 | 0.16 |
| 45 | 601636 | 旗滨集团 | 100,000 | 1,710,000.00 | 0.16 |
| 46 | 300207 | 欣旺达  | 40,000  | 1,686,400.00 | 0.16 |
| 47 | 600452 | 涪陵电力 | 80,000  | 1,611,200.00 | 0.15 |
| 48 | 002063 | 远光软件 | 160,000 | 1,590,400.00 | 0.15 |
| 49 | 002991 | 甘源食品 | 20,000  | 1,526,000.00 | 0.15 |
| 50 | 300750 | 宁德时代 | 2,500   | 1,470,000.00 | 0.14 |
| 51 | 000786 | 北新建材 | 40,000  | 1,433,200.00 | 0.14 |
| 52 | 605111 | 新洁能  | 8,000   | 1,424,800.00 | 0.14 |
| 53 | 688110 | 东芯股份 | 13,623  | 549,960.51   | 0.05 |
| 54 | 300831 | 派瑞股份 | 10,000  | 197,500.00   | 0.02 |
| 55 | 301177 | 迪阿股份 | 449     | 52,119.92    | 0.00 |
| 56 | 301211 | 亨迪药业 | 967     | 32,539.55    | 0.00 |
| 57 | 301127 | 天源环保 | 1,685   | 28,847.20    | 0.00 |
| 58 | 301221 | 光庭信息 | 280     | 24,841.60    | 0.00 |
| 59 | 301168 | 通灵股份 | 329     | 17,150.77    | 0.00 |
| 60 | 301101 | 明月镜片 | 371     | 16,086.56    | 0.00 |
| 61 | 301118 | 恒光股份 | 315     | 15,441.30    | 0.00 |
| 62 | 301108 | 洁雅股份 | 280     | 15,038.80    | 0.00 |
| 63 | 301179 | 泽宇智能 | 295     | 14,977.15    | 0.00 |
| 64 | 301180 | 万祥科技 | 654     | 14,858.88    | 0.00 |
| 65 | 301138 | 华研精机 | 285     | 12,785.10    | 0.00 |
| 66 | 301185 | 鸥玛软件 | 578     | 12,230.48    | 0.00 |
| 67 | 301193 | 家联科技 | 297     | 8,654.58     | 0.00 |
| 68 | 301133 | 金钟股份 | 286     | 7,707.70     | 0.00 |
| 69 | 301198 | 喜悦智行 | 262     | 7,650.40     | 0.00 |
| 70 | 001234 | 泰慕士  | 333     | 5,504.49     | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 002459 | 晶澳科技 | 9,557,761.00 | 0.91            |
| 2  | 600111 | 北方稀土 | 5,652,682.00 | 0.54            |
| 3  | 603259 | 药明康德 | 5,631,687.60 | 0.54            |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 5,555,450.00 | 0.53            |
| 5  | 300171 | 东富龙  | 4,749,733.00 | 0.45            |
| 6  | 601166 | 兴业银行 | 4,419,336.00 | 0.42            |
| 7  | 603906 | 龙蟠科技 | 4,360,229.30 | 0.42            |
| 8  | 601636 | 旗滨集团 | 4,300,638.00 | 0.41            |
| 9  | 603185 | 上机数控 | 4,096,335.00 | 0.39            |
| 10 | 600702 | 舍得酒业 | 4,090,476.00 | 0.39            |
| 11 | 603979 | 金诚信  | 4,041,893.00 | 0.39            |
| 12 | 300763 | 锦浪科技 | 3,985,450.40 | 0.38            |
| 13 | 002088 | 鲁阳节能 | 3,983,542.20 | 0.38            |
| 14 | 600519 | 贵州茅台 | 3,876,257.00 | 0.37            |
| 15 | 000001 | 平安银行 | 3,859,347.40 | 0.37            |
| 16 | 002271 | 东方雨虹 | 3,815,620.00 | 0.36            |
| 17 | 002935 | 天奥电子 | 3,797,266.00 | 0.36            |
| 18 | 300347 | 泰格医药 | 3,791,222.00 | 0.36            |
| 19 | 300294 | 博雅生物 | 3,729,817.00 | 0.36            |
| 20 | 300260 | 新莱应材 | 3,670,525.00 | 0.35            |

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

## 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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     | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 002459 | 晶澳科技 | 6,609,305.00 | 0.63            |
| 2  | 603906 | 龙蟠科技 | 4,579,752.00 | 0.44            |
| 3  | 600436 | 片仔癀  | 4,322,585.00 | 0.41            |
| 4  | 601166 | 兴业银行 | 4,165,300.00 | 0.40            |
| 5  | 002088 | 鲁阳节能 | 3,966,234.00 | 0.38            |
| 6  | 300763 | 锦浪科技 | 3,948,125.57 | 0.38            |
| 7  | 300294 | 博雅生物 | 3,882,551.00 | 0.37            |
| 8  | 002541 | 鸿路钢构 | 3,845,864.60 | 0.37            |
| 9  | 300260 | 新莱应材 | 3,720,317.00 | 0.36            |
| 10 | 603185 | 上机数控 | 3,294,402.00 | 0.31            |
| 11 | 300286 | 安科瑞  | 3,260,908.00 | 0.31            |
| 12 | 601628 | 中国人寿 | 3,255,616.00 | 0.31            |
| 13 | 603979 | 金诚信  | 3,162,667.00 | 0.30            |

|    |        |      |              |      |
|----|--------|------|--------------|------|
| 14 | 300772 | 运达股份 | 3,118,563.90 | 0.30 |
| 15 | 603198 | 迎驾贡酒 | 3,091,308.00 | 0.30 |
| 16 | 600580 | 卧龙电驱 | 3,062,924.77 | 0.29 |
| 17 | 300769 | 德方纳米 | 2,994,194.00 | 0.29 |
| 18 | 300347 | 泰格医药 | 2,966,066.00 | 0.28 |
| 19 | 600131 | 国网信通 | 2,792,498.00 | 0.27 |
| 20 | 300500 | 启迪设计 | 2,729,359.00 | 0.26 |

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

|              |                |
|--------------|----------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 438,723,334.88 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 294,459,524.83 |

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -              | -            |
| 2  | 央行票据      | -              | -            |
| 3  | 金融债券      | 30,477,000.00  | 2.91         |
|    | 其中：政策性金融债 | -              | -            |
| 4  | 企业债券      | -              | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -              | -            |
| 6  | 中期票据      | 764,294,000.00 | 72.94        |
| 7  | 可转债（可交换债） | -              | -            |
| 8  | 同业存单      | -              | -            |
| 9  | 其他        | -              | -            |
| 10 | 合计        | 794,771,000.00 | 75.85        |

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码      | 债券名称        | 数量（张）   | 公允价值          | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|-------------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 101900066 | 19招商局MTN001 | 500,000 | 51,345,000.00 | 4.90         |
| 2  | 101801476 | 18浙能源MTN004 | 500,000 | 51,190,000.00 | 4.89         |
| 3  | 102100292 | 21南电MTN001  | 500,000 | 51,180,000.00 | 4.88         |
| 4  | 102100753 | 21中金集MTN001 | 500,000 | 50,885,000.00 | 4.86         |
| 5  | 101661029 | 16光大集团      | 500,000 | 50,640,000.00 | 4.83         |

|  |  |        |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|
|  |  | MTN001 |  |  |  |
|--|--|--------|--|--|--|

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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中，舍得酒业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 132,332.90    |
| 2  | 应收证券清算款 | 25,490,023.40 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 12,451,625.38 |
| 5  | 应收申购款   | 34.00         |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 38,074,015.68 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十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  | 600941 | 中国移动 | 3,593,049.58 | 0.34          | 新股锁定     |

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 份额级别              | 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 (%) |
| 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A | 19,098    | 53,947.37 | 0.00  | 0.00       | 1,030,286,888.05 | 100.00     |
| 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C | 1,211     | 18,727.06 | 0.00  | 0.00       | 22,678,468.30    | 100.00     |
| 合计                | 20,309    | 51,847.23 | 0.00  | 0.00       | 1,052,965,356.35 | 100.00     |

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目     | 份额级别              | 持有份额总数 (份) | 占基金总份额比例 (%) |
|--------|-------------------|------------|--------------|
| 基金管理人所 | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A | 1,032.14   | 0.00         |

|            |                   |            |      |
|------------|-------------------|------------|------|
| 有从业人员持有本基金 | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C | 101,000.36 | 0.45 |
|            | 合计                | 102,032.50 | 0.01 |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目                           | 份额级别              | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------|-------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A | 0                 |
|                              | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C | 0                 |
|                              | 合计                | 0                 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金              | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A | 0                 |
|                              | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C | 0                 |
|                              | 合计                | 0                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目   | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 A | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合 C |
|--|-------------------|-------------------|
| 基金合同生效日<br>(2021年8月31日)<br>基金份额总额              | 1,029,697,520.31  | 22,664,263.55     |
| 基金合同生效日起至<br>报告期期末基金总申<br>购份额                  | 589,367.74        | 14,204.75         |
| 减：基金合同生效日<br>起至报告期期末基金<br>总赎回份额                | -                 | -                 |
| 基金合同生效日起至<br>报告期期末基金拆分<br>变动份额（份额减少<br>以“-”填列） | -                 | -                 |
| 本报告期末基金份<br>额总额                                | 1,030,286,888.05  | 22,678,468.30     |

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2021 年 11 月 24 日，本基金管理人发布了《浦银安盛基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，经本基金管理人董事会审议通过，聘任邓列军先生担任本基金管理人副总经理兼首席信息官。

报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人重大人事变动如下：

2022 年 2 月 19 日，本基金管理人发布了《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》，经本基金管理人董事会审议通过，聘任陈阳先生担任本基金管理人副总经理。

报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。本报告期内应支付给会计师事务所的报酬为 80,000 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 | 股票交易 | 应支付该券商的佣金 | 备注 |
|------|------|------|-----------|----|
|------|------|------|-----------|----|

|      | 数量 | 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  | 722,990,207.55 | 100.00%      | 673,321.66 | 100.00%    | - |
| 国盛证券 | 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：

本基金本报告期新增海通证券、国盛证券交易单元。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易          |              | 债券回购交易           |                | 权证交易 |              |
|------|---------------|--------------|------------------|----------------|------|--------------|
|      | 成交金额          | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额             | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 海通证券 | 30,532,170.42 | 100.00%      | 1,024,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 国盛证券 | -             | -            | -                | -              | -    | -            |

### 11.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项                           | 法定披露方式  | 法定披露日期     |
|----|--------------------------------|---------|------------|
| 1  | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书    | 规定网站    | 2021年7月30日 |
| 2  | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告 | 报刊及规定网站 | 2021年7月30日 |
| 3  | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议     | 规定网站    | 2021年7月30日 |
| 4  | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同     | 规定网站    | 2021年7月30日 |
| 5  | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资           | 规定网站    | 2021年7月30日 |

|    |  |         |                  |
|----|--|---------|------------------|
|    | 资基金基金产品资料概要  |         |                  |
| 6  | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金参与科创板股票投资及相关风险提示的公告                          | 报刊及规定网站 | 2021 年 9 月 1 日   |
| 7  | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告                                   | 报刊及规定网站 | 2021 年 9 月 1 日   |
| 8  | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为代销机构并参加其费率优惠活动的公告             | 报刊及规定网站 | 2021 年 10 月 18 日 |
| 9  | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在长江证券新增代销、开通基金定投及参加其费率优惠活动的公告                | 报刊及规定网站 | 2021 年 11 月 19 日 |
| 10 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金在交通银行开通基金转换业务及参加其费率优惠活动的公告                   | 报刊及规定网站 | 2021 年 11 月 26 日 |
| 11 | 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告                             | 报刊及规定网站 | 2021 年 11 月 27 日 |
| 12 | 关于浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金在部分代销机构及电子直销平台开通基金定投业务并参加其费率优惠活动的公告      | 报刊及规定网站 | 2021 年 11 月 30 日 |
| 13 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海利得基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告      | 报刊及规定网站 | 2021 年 12 月 15 日 |
| 14 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务及参加其费率优惠活动的公告      | 报刊及规定网站 | 2021 年 12 月 16 日 |
| 15 | 浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为代销机构并开通基金定投、转换业务及参加其费率优惠活动的公告 | 报刊及规定网站 | 2021 年 12 月 16 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准基金募集的文件
- 2、 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金托管协议
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会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

### 13.2 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。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日