

浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----------|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 10 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 10 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 13 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 13 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 14 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 15 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 15 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 16 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 16 |
| § 5 托管人报告 | 16 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 16 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 16 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 16 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 6.1 资产负债表 | 16 |
| 6.2 利润表 | 18 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 19 |
| 6.4 报表附注 | 22 |
| § 7 投资组合报告 | 49 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 49 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 49 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 50 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 53 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 56 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 56 |

| | |
|--|-----------|
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... | 56 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细..... | 56 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细..... | 56 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策..... | 56 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 56 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 56 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 57 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 58 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 58 |
| § 10 重大事件揭示 | 58 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 58 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 58 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 59 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 59 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 59 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 59 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 59 |
| 10.8 其他重大事件..... | 61 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 61 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 | 61 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 61 |
| § 12 备查文件目录 | 62 |
| 12.1 备查文件目录..... | 62 |
| 12.2 存放地点..... | 62 |
| 12.3 查阅方式..... | 62 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|--------------|
| 基金名称 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 浦银安盛价值成长混合 | |
| 基金主代码 | 519110 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2008 年 4 月 16 日 | |
| 基金管理人 | 浦银安盛基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 511,745,702.49 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 浦银安盛价值成长混合 A | 浦银安盛价值成长混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 519110 | 014011 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 511,530,263.19 份 | 215,439.30 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 以追求长期资本增值为目的，通过投资于被市场低估的具有价值属性或可预期的具有持续成长属性的股票，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速增长的成果，进而实现基金资产的长期稳定增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金坚持自上而下与自下而上相结合的投资策略，在投资策略上充分体现“价值”、“成长”和“精选”的主导思想。</p> <p>“价值”是指甄别公司的核心价值，从公司治理、公司战略、比较优势等方面来把握公司核心竞争优势，通过自下而上的研究，以基本面研究为核心，力求卓有远见地挖掘出具有核心竞争力的被市场忽视的价值低估型公司。价值因素主要表现在相对市场股价比较高的自由现金流，比较高的每股收益和净资产，并能给上市公司股东带来实际收益的增长，而非粗放的规模增长。</p> <p>“成长”主要表现在可持续性、可预见性的增长。寻找成长型公司重点在于对公司成长性的客观评价和比较上，不仅仅需要关注成长的数量，同时还要关注成长的质量以及这种较高质量的成长预期可持续性，通过深度研究，精选个股投资。</p> <p>“精选”是指借鉴国外先进的公司财务研究模型 FFM，一方面通过关注上市公司现金流的形成，排除噪音数据，进行上市公司“被低估的价值”的判断；另一方面通过对上市公司过往财务数据的分析判断修正以及对其未来变化的预测，通过严格的逐项分析流程，实现对上市公司“可持续的、可预见的成长”的判断。在基本面分析的基础上，结合深入的实地调研和估值研究，对于符合本基金理念的标的股票进行精选投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数×75%+中证全债指数×25%。 |

| | |
|--------|--|
| 风险收益特征 | 本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。 |
|--------|--|

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 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 薛香 | 郭明 |
| | 联系电话 | 021-23212888 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | compliance@py-axa.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 021-33079999 或 400-8828-999 | 95588 |
| 传真 | | 021-23212985 | 010-66105798 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 200020 | 100140 |
| 法定代表人 | | 谢伟 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022年01月01日-2022年06月30日) | |
|---------------|------------------------------|--------------|
| | 浦银安盛价值成长混合 A | 浦银安盛价值成长混合 C |
| 本期已实现收益 | -234,046,423.76 | -62,571.41 |
| 本期利润 | -110,012,207.13 | -7,377.83 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.2173 | -0.0479 |

| | | |
|---------------|------------------|------------|
| 本期加权平均净值利润率 | -13.19% | -3.00% |
| 本期基金份额净值增长率 | -10.50% | -10.69% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| 期末可供分配利润 | 166,512,185.01 | 69,217.58 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.3255 | 0.3213 |
| 期末基金资产净值 | 903,303,363.24 | 379,390.53 |
| 期末基金份额净值 | 1.7659 | 1.7610 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022年6月30日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | 175.57% | -9.53% |

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

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、自 2021 年 11 月 04 日起，本基金增加 C 级基金份额类别。

6、本基金增加 C 类基金份额类别后，本基金分设 A 类和 C 类两类基金份额，分别设置对应的基金代码并分别计算基金份额净值。原有的基金份额全部自动转换为浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 A 类基金份额。

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

浦银安盛价值成长混合 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 |
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|
|----|----------|-------------|------------|---------------|-----|-----|

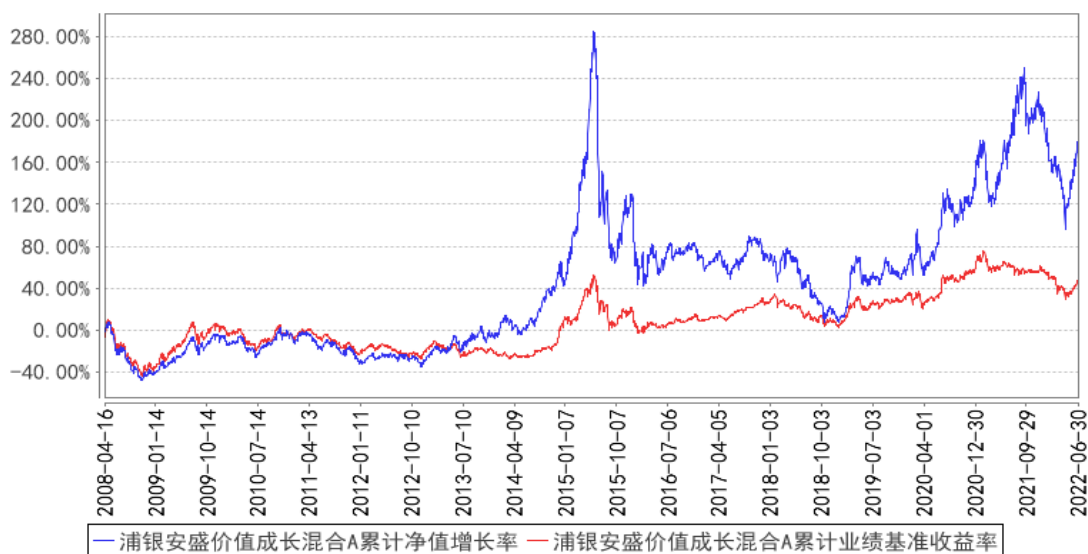
| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|--------|-------|-------------|-------|
| 过去一个月 | 13.24% | 2.06% | 7.15% | 0.80% | 6.09% | 1.26% |
| 过去三个月 | 12.82% | 2.14% | 5.04% | 1.07% | 7.78% | 1.07% |
| 过去六个月 | -10.50% | 1.97% | -6.34% | 1.09% | -4.16% | 0.88% |
| 过去一年 | -2.45% | 2.01% | -9.34% | 0.93% | 6.89% | 1.08% |
| 过去三年 | 82.97% | 1.90% | 17.77% | 0.95% | 65.20% | 0.95% |
| 自基金合同生效起 至今 | 175.57% | 1.81% | 47.99% | 1.20% | 127.58 % | 0.61% |

浦银安盛价值成长混合 C

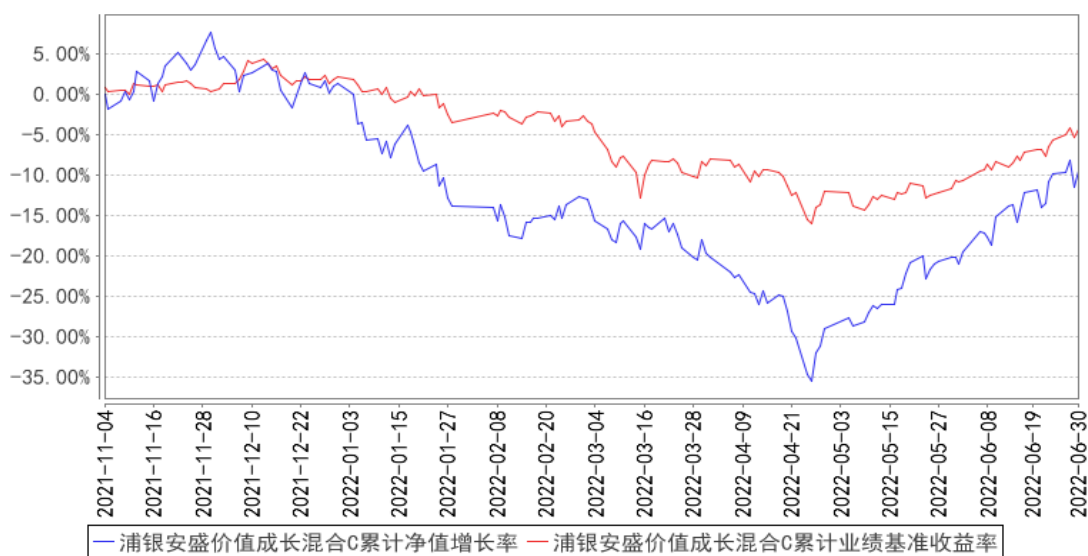
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 13.20% | 2.06% | 7.15% | 0.80% | 6.05% | 1.26% |
| 过去三个月 | 12.70% | 2.13% | 5.04% | 1.07% | 7.66% | 1.06% |
| 过去六个月 | -10.69% | 1.97% | -6.34% | 1.09% | -4.35% | 0.88% |
| 自基金合同生效起 至今 | -9.53% | 1.84% | -4.29% | 0.98% | -5.24% | 0.86% |

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

浦银安盛价值成长混合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



浦银安盛价值成长混合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、自 2015 年 8 月 4 日起，本基金类型由股票型证券投资基金变更为混合型证券投资基金，本基金的基金名称变更为“浦银安盛价值成长混合型证券投资基金”。具体内容详见基金管理人于 2015 年 8 月 4 日发布的《关于浦银安盛价值成长股票型证券投资基金变更基金名称、基金类型及业绩比较基准并相应修订基金合同部分条款的公告》。

2、本基金于 2021 年 11 月 4 日增加 C 类份额，详见本基金管理人于 2021 年 11 月 4 日发布的《关于浦银安盛价值成长混合型证券投资基金增加 C 类基金份额、提高估值精度并修订基金合同相应条款的公告》。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 100 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、浦银安盛盛鑫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 年国开债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基金中基金（FOF）、浦银安盛价值精选混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、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基金中基金（FOF）、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基金中基金（FOF）、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、浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛安弘回报一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银安盛普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴耀优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）

金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳鑫 120 天滚动持有中短债券型证券投资基金、浦银安盛盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统也主要是采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--------------------------|-----------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 吴勇 | 公司首席投资官、权益投资部总监，本基金的基金经理 | 2020年7月13日 | - | 14年 | 吴勇先生，上海交通大学材料工程系学士，上海交通大学工商管理硕士，CPA，CFA，中国注册造价师。1993年8月至2007年8月先后就职于上海电力建设有限责任公司任预算主管、国家开发银行上海市分行任评审经理。2007年9月起加盟浦银安盛基金管理有限公司先后担任行业研究员、基金经理助理。2012年11月起担任本公司权益投资部总监。2016年4月起担任本公司首席投资官。2010年4月至2016年1月起担任浦银安盛红利精选混合型证券投资基金的基金经理。2013年12月至2018年1月担任浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2016年2月至2018年1月担任浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2011年5月起担任浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 2013 年 3 月起，担任浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月起，担任浦银安盛价值成长混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起担任浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

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、证券从业含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。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。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日、10日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

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 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

上半年，全球宏观预期处于较大不确定中，这深刻影响市场走势和投资者认知。我们将其归纳为四个方面：第一，稳增长政策和货币政策的落实见效需要一定的时间。中央经济工作会议之后，各类政策相继推出，总体以稳为住，对基本面的影响相对温和。第二，疫情对国内生产生活的秩序带来扰动。奥密克戎的强大传染性需要采取严格的管控措施限制流动，使得相关地区的供应链受到较大冲击，以汽车和半导体为代表的工业出现供应链阶段性紧张问题。第三，美联储周期性收紧所导致的估值压力。海外货币政策之所以出现了趋势性的收紧，本质上是对 2020 年疫情之后无限量化宽松的修正。美联储在 1 月份修改了“通胀是暂时的”观点，开始大幅收紧，试图抑制通胀，美债收益率从 1.4% 迅速攀升至 3% 以上，海外流动性的变化对全球股票市场的估值形成压制，国内市场也深受波及。第四，俄乌冲突对长期通胀中枢在供给层面产生影响。全球需求在疫情影响下虽然在回落，但对供给的冲击也同样剧烈，叠加俄乌冲突推动油价大幅上涨，成本的大幅上升导致制造业企业的利润遭受大幅挤压，市场开始下调相关公司的盈利预测。

宏观上的巨大变化主导了上半年的市场走势，震荡下跌成为主趋势。四月末开始，市场在绝望中迎来疫情缓解后的反弹行情，拥有高景气且边际变化最明显的新能源板块（光伏、风电、电动车、储能）成为市场最强主线，汽车、部分化工品、先进制造、军工等也有不错表现。市场一度淡化了估值因子，给予景气以更高的权重。

上半年，基金保持了较高的权益仓位，面对市场的大幅波动，基金立足于自下而上的选择个股。考虑到经济基本面相对较弱，基金低配了与经济相关的周期类资产的配置。基金沿着景气度的主线，关注了“双碳”主题下的投资机会。此外国产替代、自主可控、消费医药也是关注的方向。基金在光伏、新能源汽车、半导体、部分景气化工品上的配置对净值有较好的贡献。

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价值成长混合 A 的基金份额净值为 1.7659，本报告期基金份额净值增长率为-10.50%，同期业绩比较基准收益率为-6.34%；截至本报告期末浦银安盛价值成长混合 C 的基金份额净值为 1.7610，本报告期基金份额净值增长率为-10.69%，同期业绩比较基准收益率为-6.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们预计主导市场的部分宏观因素将发生边际变化。首先，国内经济复苏仍在继续，通胀预期可能缓慢抬升，推动需求的消费、投资“两架马车”面临“需求收缩，预期转弱”的压力，由此引致的宏观流动性保持合理充裕；同时通胀和汇率压力整体不大，货币政策整体不具备立刻收紧的基础。这些变化将通过影响贴现模型的分母端为估值切换提供空间。其次，海外市场从关注通胀逐渐转为关注基本面会否走向衰退，预计美联储改变过于鹰派的表态，本质原因在于不断提高政策利率可能反噬需求，导致美国经济在不久的将来出现衰退迹象，而美国通胀也会伴随需求回落开始下行，因此，海外流动性最紧张的时刻可能已经过去。

我们认为，在全球共同迈向清洁能源的背景下，“双碳”成为各方认可的方向。中国出口和相关制造业在全球产业链中凭借其强大的成本竞争优势获得了更多的份额和认可度，是全球经济预期向下背景下一条较为清晰的景气主线，出口持续超预期的高增速便是例证。因此，新能源（光伏、风电、电动车、储能）、高端制造业、消费升级等将是基金长期看好的方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司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》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十五部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，全年分配比例不得低于年度可供分配收益的 30%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；基金收益分配后基金份额净值不能低于面值。

本基金本报告期内进行了 1 次收益分配：实际分配收益：164,409,594.20 元，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对浦银安盛价值成长混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，浦银安盛价值成长混合型证券投资基金的管理人——浦银安盛基金管理有限公司在浦银安盛价值成长混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，本基金利润分配符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对浦银安盛基金管理有限公司编制和披露的浦银安盛价值成长混合型证券投资基金在本报告期财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 78,514,630.15 | 85,306,810.39 |
| 结算备付金 | | 3,548,345.61 | 9,717,728.41 |
| 存出保证金 | | 396,780.47 | 330,799.39 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 827,088,314.23 | 993,595,342.54 |
| 其中：股票投资 | | 827,088,314.23 | 993,595,342.54 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 335,063.22 | 132,991.47 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | 11,964.70 |
| 资产总计 | | 909,883,133.68 | 1,089,095,636.90 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | 7,848,816.83 |
| 应付赎回款 | | 1,824,367.41 | 797,170.46 |
| 应付管理人报酬 | | 1,055,192.97 | 1,403,347.02 |
| 应付托管费 | | 175,865.46 | 233,891.18 |
| 应付销售服务费 | | 104.17 | 30.75 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |

| | | | |
|-------------|----------|----------------|------------------|
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 3,144,849.90 | 4,909,787.30 |
| 负债合计 | | 6,200,379.91 | 15,193,043.54 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 511,745,702.49 | 456,545,552.11 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | 391,937,051.28 | 617,357,041.25 |
| 净资产合计 | | 903,682,753.77 | 1,073,902,593.36 |
| 负债和净资产总计 | | 909,883,133.68 | 1,089,095,636.90 |

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 511,745,702.49 份，其中 A 类基金份额净值 1.7659 元，份额总额 511,530,263.19 份；C 类基金份额净值 1.7610 元，份额总额 215,439.30 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 | 上年度可比期间 |
|---------------------|----------|---------------------------------|---------------------------------|
| | | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | -102,642,196.77 | 201,496,163.74 |
| 1. 利息收入 | | 186,213.80 | 259,030.52 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 186,213.80 | 259,030.52 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | -226,944,205.03 | 196,649,486.53 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -233,846,961.46 | 192,719,160.46 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 资产支持证券投资 | 6.4.7.16 | - | - |
| 收益 | | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 6,902,756.43 | 3,930,326.07 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的 | | - | - |

| | | | |
|----------------------------|------------|-----------------|----------------|
| 收益 | | | |
| 其他投资收益 | | | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | 124,089,410.21 | 4,447,036.16 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 26,384.25 | 140,610.53 |
| 减：二、营业总支出 | | 7,377,388.19 | 32,069,859.98 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 6,205,114.45 | 8,031,729.53 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 1,034,185.76 | 1,338,621.59 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 485.67 | - |
| 4. 投资顾问费 | | | - |
| 5. 利息支出 | | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.22 | | - |
| 7. 税金及附加 | | | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 137,602.31 | 22,699,508.86 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -110,019,584.96 | 169,426,303.76 |
| 减：所得税费用 | | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -110,019,584.96 | 169,426,303.76 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | | - |
| 六、综合收益总额 | | -110,019,584.96 | 169,426,303.76 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛价值成长混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|-----------------|---------------------------------------|--------|----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 456,545,552.11 | - | 617,357,041.25 | 1,073,902,593.36 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错 | - | - | - | - |

| | | | | |
|--|----------------|---|-----------------|------------------|
| 更正 | | | | |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本 期初 净 资 产 (基 金 净 值) | 456,545,552.11 | - | 617,357,041.25 | 1,073,902,593.36 |
| 三、本 期 增 减 变 动 额 (减 少 以 “-” 号 填 列) | 55,200,150.38 | - | -225,419,989.97 | -170,219,839.59 |
| (一)、 综 合 收 益 总 额 | - | - | -110,019,584.96 | -110,019,584.96 |
| (二)、 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) | 55,200,150.38 | - | 49,009,189.19 | 104,209,339.57 |
| 其中：1. 基 金 申 购 款 | 78,994,490.63 | - | 64,376,821.54 | 143,371,312.17 |
| 2. 基 金 赎 回 款 | -23,794,340.25 | - | -15,367,632.35 | -39,161,972.60 |
| (三)、 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) | - | - | -164,409,594.20 | -164,409,594.20 |

| | | | | |
|------------------------|---------------------------------|--------|----------------|------------------|
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 511,745,702.49 | - | 391,937,051.28 | 903,682,753.77 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 600,898,445.46 | - | 634,002,872.94 | 1,234,901,318.40 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 600,898,445.46 | - | 634,002,872.94 | 1,234,901,318.40 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -81,101,024.21 | - | -32,256,453.25 | -113,357,477.46 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 169,426,303.76 | 169,426,303.76 |
| （二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | -81,101,024.21 | - | -85,386,270.24 | -166,487,294.45 |

| | | | | |
|--|-----------------|---|-----------------|------------------|
| （净值减少以“-”号填列） | | | | |
| 其中 1. 基金申购款 | 67,591,461.63 | - | 66,337,850.88 | 133,929,312.51 |
| 2. 基金赎回款 | -148,692,485.84 | - | -151,724,121.12 | -300,416,606.96 |
| （三）、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） | - | - | -116,296,486.77 | -116,296,486.77 |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期末净资产（基金净值） | 519,797,421.25 | - | 601,746,419.69 | 1,121,543,840.94 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

郁蓓华

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛价值成长混合型证券投资基金(原名为“浦银安盛价值成长股票型证券投资基金”，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”)证监许可字[2008]

第 263 号《关于同意浦银安盛价值成长股票型证券投资基金募集的批复》核准，由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛价值成长股票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 1,731,976,982.82 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 41 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛价值成长股票型证券投资基金基金合同》于 2008 年 4 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,733,163,625.10 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,186,642.28 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金基金管理人 2015 年 11 月 2 日发布的《关于浦银安盛价值成长混合型证券投资基金增加 H 类份额并相应修订基金合同部分条款的公告》，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2015 年 11 月 2 日起本基金增加 H 类份额并相应修改基金合同；根据基金管理人 2021 年 11 月 4 日发布的《关于浦银安盛价值成长混合型证券投资基金增加 C 类基金份额、提高基金份额净值估值精度并修订基金合同相应条款的公告》，经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，自 2021 年 11 月 4 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。本基金根据基金销售地、认购费、申购赎回费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。仅在中国大陆地区销售，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，称为 A 类基金份额；仅在中国香港地区销售，并收取申购和赎回费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 H 类基金份额；仅在中国大陆地区销售，在投资者申购基金份额时不收取申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为 C 类基金份额。三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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛价值成长混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%；保持现金或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；投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0%-3%。本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数×75%+中证全债指数×25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明中所述以外, 其余会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”), 财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》, 公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外, 中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》, 本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表, 对本基金财务报表的影响列示如下:

新金融工具准则:

金融资产和金融负债的分类:

金融工具, 是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时, 确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为: 以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入

其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代

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投资收益。

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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

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。

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。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 85,306,810.39 元、9,717,728.41 元、330,799.39 元、11,964.70 元和 132,991.47 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 85,314,253.29 元、9,722,101.31 元、330,948.29 元、0.00 元和 132,991.47 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 993,595,342.54 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 993,595,342.54 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 7,848,816.83 元、797,170.46 元、1,403,347.02 元、233,891.18 元、30.75 元、4,178,631.59 元和 501,155.71 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 7,848,816.83 元、797,170.46 元、1,403,347.02 元、233,891.18 元、30.75 元、4,178,631.59 元和 501,155.71 元。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125号《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让

2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 对于内地投资者持有的基金类别，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。

对于香港市场投资者通过基金互认持有的基金类别，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该内地基金分配利息时按照 7% 的税率代扣代缴所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，应由内地上市公司向该内地基金分配股息红利时按照 10% 的税率代扣代缴所得税。

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 78,514,630.15 |
| 等于：本金 | 78,507,846.07 |
| 加：应计利息 | 6,784.08 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 78,514,630.15 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 660,961,090.45 | - | 827,088,314.23 | 166,127,223.78 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - | - |
| | 银行间市场 | - | - | - |
| | 合计 | - | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - | - |
| 基金 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 660,961,090.45 | - | 827,088,314.23 | 166,127,223.78 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金在本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末不存在债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期期末不存在其他债权投资减值准备计提情况。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期不存在其他权益工具投资情况。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期期末不存在其他权益工具投资情况。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|-------------|-------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | 500,000.00 |
| 应付赎回费 | 5,325.97 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 2,521,127.99 |
| 其中：交易所市场 | 2,521,127.99 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 118,395.94 |
| 合计 | 3,144,849.90 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浦银安盛价值成长混合 A

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----|----------------------------|
| | |

| | 基金份额（份） | 账面金额 |
|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | 456,488,665.23 | 456,488,665.23 |
| 本期申购 | 78,710,530.10 | 78,710,530.10 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -23,668,932.14 | -23,668,932.14 |
| 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 | 511,530,263.19 | 511,530,263.19 |

浦银安盛价值成长混合 C

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|-------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 56,886.88 | 56,886.88 |
| 本期申购 | 283,960.53 | 283,960.53 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -125,408.11 | -125,408.11 |
| 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 | 215,439.30 | 215,439.30 |

注：1、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2、根据基金管理人 2021 年 11 月 4 日发布的《关于浦银安盛价值成长混合型证券投资基金增加 C 类基金份额、提高基金份额净值估值精度并修订基金合同相应条款的公告》，浦银安盛价值成长混合型证券投资基金自 2021 年 11 月 4 日起对本基金增加 C 类份额并相应修改基金合同。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末不存在其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

浦银安盛价值成长混合 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 本期期初 | 520,837,863.41 | 96,442,336.23 | 617,280,199.64 |
| 本期利润 | -234,046,423.76 | 124,034,216.63 | -110,012,207.13 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 44,105,065.47 | 4,784,362.18 | 48,889,427.65 |
| 其中：基金申购款 | 55,746,676.70 | 8,432,812.47 | 64,179,489.17 |
| 基金赎回款 | -11,641,611.23 | -3,648,450.29 | -15,290,061.52 |
| 本期已分配利润 | -164,384,320.11 | - | -164,384,320.11 |
| 本期末 | 166,512,185.01 | 225,260,915.04 | 391,773,100.05 |

浦银安盛价值成长混合 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|------------|------------|------------|
| 本期期初 | 64,814.50 | 12,027.11 | 76,841.61 |
| 本期利润 | -62,571.41 | 55,193.58 | -7,377.83 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 92,248.58 | 27,512.96 | 119,761.54 |
| 其中：基金申购款 | 150,049.41 | 47,282.96 | 197,332.37 |
| 基金赎回款 | -57,800.83 | -19,770.00 | -77,570.83 |
| 本期已分配利润 | -25,274.09 | - | -25,274.09 |
| 本期末 | 69,217.58 | 94,733.65 | 163,951.23 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 141,337.48 |
| 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 | 41,113.44 |
| 其他 | 3,762.88 |
| 合计 | 186,213.80 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -233,846,961.46 |
| 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 | -233,846,961.46 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 3,315,166,735.05 |
| 减：卖出股票成本总额 | 3,539,004,930.98 |
| 减：交易费用 | 10,008,765.53 |
| 买卖股票差价收入 | -233,846,961.46 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 6,902,756.43 |
| 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 | 6,902,756.43 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | 124,089,410.21 |
| 股票投资 | 124,089,410.21 |
| 债券投资 | - |
| 资产支持证券投资 | - |
| 基金投资 | - |
| 贵金属投资 | - |
| 其他 | - |
| 2. 衍生工具 | - |
| 权证投资 | - |
| 3. 其他 | - |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 124,089,410.21 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 26,160.83 |
| 基金转换费收入 | 223.42 |
| 合计 | 26,384.25 |

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

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|---------------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 审计费用 | 49,588.57 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 606.37 |
| 账户维护费 | 27,900.00 |
| 合计 | 137,602.31 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------------|-----------------|
| 浦银安盛基金管理有限公司(“浦银安盛”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |
| 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 |

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 6,205,114.45 | 8,031,729.53 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 2,220,892.52 | 2,887,521.30 |

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 1.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 | 上年度可比期间 |
|----------------|----------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | 2021年1月1日至2021年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,034,185.76 | 1,338,621.59 |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 | | |
|----------------|----------------------|------------|-------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 浦银安盛价值成长混合 | 浦银安盛价值成长混合 | 合计 |
| | A | C | |
| 浦银安盛基金管理有限公司 | 0.00 | 80.60 | 80.60 |
| 合计 | 0.00 | 80.60 | 80.60 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 | | |

| 方名称 | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | | |
|-----|---------------------------------|-----------------|----|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 浦银安盛价值成长混合 A | 浦银安盛价值成长混合 C | 合计 |
| 合计 | - | - | - |

注：1、本基金 A 类、H 类基金份额不收取销售服务费，本基金 C 类基金份额的销售服务费每日按前一日 C 类基金份额基金资产净值的 0.40% 的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

2、本基金于 2021 年 11 月 4 日增加 C 类份额，无上年度可比区间。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期内与上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 | |
|--------|---------------------------------------|------------|--|------------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中国工商银行 | 78,514,630.15 | 141,337.48 | 74,992,338.17 | 146,631.40 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 浦银安盛价值成长混合 A | | | | | | | | |
|--------------|--------------------|-----|--------------------|-----------------------|-------------------|-------------------|--------------------|----|
| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每 10 份基 金份额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润 分配合计 | 备注 |
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2022 年 1 月 20 日 | - | 2022 年 1 月 20 日 | 3.5000 | 95,310,8 49.73 | 69,073,470 .38 | 164,384, 320.11 | - |
| 合计 | - | - | - | 3.5000 | 95,310,8 49.73 | 69,073,470 .38 | 164,384, 320.11 | - |
| 浦银安盛价值成长混合 C | | | | | | | | |
| 序号 | 权益 登记日 | 除息日 | | 每 10 份基 金份额分红 数 | 现金形式 发放总额 | 再投资形式 发放总额 | 本期利润 分配合计 | 备注 |
| | | 场内 | 场外 | | | | | |
| 1 | 2022 年 1 月 20 日 | - | 2022 年 1 月 20 日 | 3.5000 | 25,125.5 9 | 148.50 | 25,274.0 9 | - |
| 合计 | - | - | - | 3.5000 | 25,125.5 9 | 148.50 | 25,274.0 9 | - |

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|----------|-----------------------|---------|------------|----------|------------|-----------------|------------|-----------|----|
| 证券 代码 | 证券 名称 | 成功 认购日 | 受限 期 | 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 |
| 300834 | 星辉 环材 | 2022 年 1 月 6 日 | 6 个月 | 新股锁 定 | 55.57 | 30.03 | 635 | 35,286.95 | 19,069.05 | - |
| 301102 | 兆讯 传媒 | 2022 年 3 月 15 日 | 6 个月 | 新股锁 定 | 39.88 | 31.09 | 559 | 22,292.92 | 17,379.31 | - |
| 301103 | 何氏 眼科 | 2022 年 3 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁 定 | 42.50 | 32.02 | 507 | 16,575.00 | 16,234.14 | - |
| 301109 | 军信 股份 | 2022 年 4 月 6 日 | 6 个月 | 新股锁 定 | 34.81 | 16.14 | 1,176 | 27,291.04 | 18,980.64 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|------|--------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 301110 | 青木股份 | 2022年3月4日 | 6个月 | 新股锁定 | 63.10 | 39.85 | 202 | 12,746.20 | 8,049.70 | - |
| 301116 | 益客食品 | 2022年1月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 11.40 | 20.46 | 577 | 6,577.80 | 11,805.42 | - |
| 301151 | 冠龙节能 | 2022年3月30日 | 6个月 | 新股锁定 | 30.82 | 21.46 | 703 | 21,666.46 | 15,086.38 | - |
| 301158 | 德石股份 | 2022年1月7日 | 6个月 | 新股锁定 | 15.64 | 20.38 | 379 | 5,927.56 | 7,724.02 | - |
| 301160 | 翔楼新材 | 2022年5月25日 | 6个月 | 新股锁定 | 31.56 | 37.66 | 392 | 12,371.52 | 14,762.72 | - |
| 301201 | 诚达药业 | 2022年1月12日 | 6个月 | 新股锁定 | 72.69 | 71.54 | 353 | 25,659.57 | 25,253.62 | - |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022年2月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 56.88 | 56.42 | 339 | 19,282.32 | 19,126.38 | - |
| 301216 | 万凯新材 | 2022年3月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 35.68 | 29.84 | 817 | 29,150.56 | 24,379.28 | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022年3月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 173.98 | 87.82 | 158 | 15,310.24 | 13,875.56 | - |
| 301228 | 实朴检测 | 2022年1月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 20.08 | 20.34 | 373 | 7,489.84 | 7,586.82 | - |
| 301235 | 华康医疗 | 2022年1月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 39.30 | 37.93 | 418 | 16,427.40 | 15,854.74 | - |
| 301236 | 软通动力 | 2022年3月8日 | 6个月 | 新股锁定 | 72.88 | 31.38 | 696 | 33,816.32 | 21,840.48 | - |
| 301237 | 和顺科技 | 2022年3月16日 | 6个月 | 新股锁定 | 56.69 | 41.86 | 261 | 14,796.09 | 10,925.46 | - |
| 301258 | 富士莱 | 2022年3月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 48.30 | 41.68 | 295 | 14,248.50 | 12,295.60 | - |
| 301268 | 铭利达 | 2022年3月 | 6个月 | 新股锁定 | 28.50 | 34.87 | 641 | 18,268.50 | 22,351.67 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------------|------|------|-------|-------|--------|--------------|--------------|---|
| | | 29 日 | | | | | | | | |
| 600941 | 中国移动 | 2021 年 12 月 24 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 57.58 | 60.26 | 43,681 | 2,515,151.98 | 2,632,217.06 | - |

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末及上年度末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为混合型基金产品，基金资产整体的预期收益和预期风险均较高，属于较高风险、较高收益的基金品种。本基金力争在科学的风险管理的前提下，谋求实现基金财产的安全和增值。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资组合范围为：股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%，其中现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。投资于权证的比例

范围占基金资产净值的 0%—3%。本基金投资于资产支持证券以及衍生工具的比例遵从法律法规及监管机构的规定。

对于中国证监会允许投资的创新类金融产品或者衍生工具，将依据有关法律法规进行投资管理。法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如果法律法规对上述比例要求有变更的，本基金投资范围将及时做出相应调整，以调整变更后的比例为准。

本基金将通过定性与定量的方法筛选出基本面健康的、具有价值属性或成长属性或两种属性兼具的股票作为本基金的核心投资目标，本基金将有百分之八十以上的股票基金资产投资于这些股票。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部、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、督察长和审计。

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常设的议事决策机构和公司经营层面的最高风险管理机构，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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券和资产支持证券投资 (2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2022 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-----------------------------|---------------|-------------|-------------|-----------------|------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 78,514,630.15 | - | - | - | 78,514,630.15 |
| 结算备付金 | 3,548,345.61 | - | - | - | 3,548,345.61 |
| 存出保证金 | 396,780.47 | - | - | - | 396,780.47 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -827,088,314.23 | 827,088,314.23 |
| 应收申购款 | - | - | - | 335,063.22 | 335,063.22 |
| 资产总计 | 82,459,756.23 | - | - | -827,423,377.45 | 909,883,133.68 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,824,367.41 | 1,824,367.41 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,055,192.97 | 1,055,192.97 |
| 应付托管费 | - | - | - | 175,865.46 | 175,865.46 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 104.17 | 104.17 |
| 其他负债 | - | - | - | 3,144,849.90 | 3,144,849.90 |
| 负债总计 | - | - | - | 6,200,379.91 | 6,200,379.91 |
| 利率敏感度缺口 | 82,459,756.23 | - | - | -821,222,997.54 | 903,682,753.77 |
| 上年度末 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 | 85,306,810.39 | - | - | - | 85,306,810.39 |
| 结算备付金 | 9,717,728.41 | - | - | - | 9,717,728.41 |
| 存出保证金 | 330,799.39 | - | - | - | 330,799.39 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | -993,595,342.54 | 993,595,342.54 |
| 应收利息 | - | - | - | 11,964.70 | 11,964.70 |
| 应收申购款 | - | - | - | 132,991.47 | 132,991.47 |
| 资产总计 | 95,355,338.19 | - | - | -993,740,298.71 | 1,089,095,636.90 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 797,170.46 | 797,170.46 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,403,347.02 | 1,403,347.02 |
| 应付托管费 | - | - | - | 233,891.18 | 233,891.18 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 7,848,816.83 | 7,848,816.83 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 30.75 | 30.75 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 4,178,631.59 | 4,178,631.59 |
| 其他负债 | - | - | - | 731,155.71 | 731,155.71 |
| 负债总计 | - | - | - | 15,193,043.54 | 15,193,043.54 |
| 利率敏感度缺口 | 95,355,338.19 | - | - | -978,547,255.17 | 1,073,902,593.36 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资(2021 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市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“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；同时采用“自下而上”的策略通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对股票资产占基金资产的比例为 60%-95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 5%-40%；保持现金或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；投资于权证的比例范围占基金资产净值的 0%-3%。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与控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 | |
|--------------|------------------------|---------------|--------------------------|---------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资 | 827,088,314.23 | 91.52 | 993,595,342.54 | 92.52 |

| | | | | |
|---------------|----------------|-------|----------------|-------|
| 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 | 827,088,314.23 | 91.52 | 993,595,342.54 | 92.52 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准（附注 6.4.1）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（2022年6月30日） | 上年度末（2021年12月31日） |
| 分析 | 业绩比较基准上升 500 基点 | 58,065,751.64 | 37,810,346.72 |
| | 业绩比较基准下降 500 基点 | -58,065,751.64 | -37,810,346.72 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022年6月30日 | 上年度末 2021年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 824,153,516.18 | 986,069,677.38 |
| 第二层次 | - | 3,598,554.07 |

| | | |
|------|----------------|----------------|
| 第三层次 | 2,934,798.05 | 3,927,111.09 |
| 合计 | 827,088,314.23 | 993,595,342.54 |

6.4.14.2.2 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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2021 年 12 月 31 日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 827,088,314.23 | 90.90 |
| | 其中：股票 | 827,088,314.23 | 90.90 |
| 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 | 82,062,975.76 | 9.02 |

| | | | |
|---|--------|----------------|--------|
| 8 | 其他各项资产 | 731,843.69 | 0.08 |
| 9 | 合计 | 909,883,133.68 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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 | 51,899,732.78 | 5.74 |
| C | 制造业 | 753,392,798.56 | 83.37 |
| 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 | 19,008,694.60 | 2.10 |
| 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 | 2,692,298.59 | 0.30 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 17,379.31 | 0.00 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 23,441.56 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 37,734.69 | 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 | 16,234.14 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 827,088,314.23 | 91.52 |

7.2.2 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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 | 002056 | 横店东磁 | 2,342,700 | 62,362,674.00 | 6.90 |
| 2 | 688390 | 固德威 | 146,768 | 45,939,851.68 | 5.08 |
| 3 | 300428 | 立中集团 | 1,102,700 | 36,444,235.00 | 4.03 |
| 4 | 002865 | 钧达股份 | 340,600 | 32,479,616.00 | 3.59 |
| 5 | 300035 | 中科电气 | 1,142,200 | 31,924,490.00 | 3.53 |
| 6 | 002335 | 科华数据 | 999,980 | 30,849,383.00 | 3.41 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 7 | 300373 | 扬杰科技 | 393,160 | 28,012,650.00 | 3.10 |
| 8 | 300610 | 晨化股份 | 1,400,000 | 26,082,000.00 | 2.89 |
| 9 | 600256 | 广汇能源 | 2,311,300 | 24,361,102.00 | 2.70 |
| 10 | 300820 | 英杰电气 | 320,250 | 20,672,137.50 | 2.29 |
| 11 | 603938 | 三孚股份 | 374,780 | 18,525,375.40 | 2.05 |
| 12 | 300073 | 当升科技 | 196,500 | 17,751,810.00 | 1.96 |
| 13 | 300390 | 天华超净 | 200,000 | 17,480,000.00 | 1.93 |
| 14 | 300360 | 炬华科技 | 1,300,000 | 17,342,000.00 | 1.92 |
| 15 | 301099 | 雅创电子 | 205,205 | 17,130,513.40 | 1.90 |
| 16 | 300305 | 裕兴股份 | 1,150,000 | 16,307,000.00 | 1.80 |
| 17 | 000707 | 双环科技 | 956,802 | 16,256,065.98 | 1.80 |
| 18 | 603185 | 上机数控 | 100,000 | 15,599,000.00 | 1.73 |
| 19 | 300861 | 美畅股份 | 154,600 | 14,329,874.00 | 1.59 |
| 20 | 601012 | 隆基绿能 | 209,860 | 13,982,971.80 | 1.55 |
| 21 | 002206 | 海利得 | 2,200,000 | 13,904,000.00 | 1.54 |
| 22 | 600123 | 兰花科创 | 764,700 | 12,579,315.00 | 1.39 |
| 23 | 002709 | 天赐材料 | 200,000 | 12,412,000.00 | 1.37 |
| 24 | 002139 | 拓邦股份 | 1,000,000 | 12,270,000.00 | 1.36 |
| 25 | 603612 | 索通发展 | 320,000 | 11,792,000.00 | 1.30 |
| 26 | 002132 | 恒星科技 | 1,445,000 | 10,490,700.00 | 1.16 |
| 27 | 300274 | 阳光电源 | 104,400 | 10,257,300.00 | 1.14 |
| 28 | 300393 | 中来股份 | 595,000 | 10,115,000.00 | 1.12 |
| 29 | 300769 | 德方纳米 | 24,660 | 10,078,048.80 | 1.12 |
| 30 | 600206 | 有研新材 | 499,900 | 9,668,066.00 | 1.07 |
| 31 | 603035 | 常熟汽饰 | 554,400 | 9,158,688.00 | 1.01 |
| 32 | 000887 | 中鼎股份 | 468,500 | 8,545,440.00 | 0.95 |
| 33 | 002960 | 青鸟消防 | 293,894 | 8,049,756.66 | 0.89 |
| 34 | 601699 | 潞安环能 | 549,919 | 8,039,815.78 | 0.89 |
| 35 | 002466 | 天齐锂业 | 60,000 | 7,488,000.00 | 0.83 |
| 36 | 002176 | 江特电机 | 267,800 | 6,705,712.00 | 0.74 |
| 37 | 688155 | 先惠技术 | 63,633 | 6,630,558.60 | 0.73 |
| 38 | 688077 | 大地熊 | 77,001 | 6,491,954.31 | 0.72 |
| 39 | 300835 | 龙磁科技 | 169,000 | 6,450,730.00 | 0.71 |
| 40 | 300260 | 新莱应材 | 116,100 | 5,906,007.00 | 0.65 |
| 41 | 603198 | 迎驾贡酒 | 88,500 | 5,764,890.00 | 0.64 |
| 42 | 002068 | 黑猫股份 | 400,000 | 5,580,000.00 | 0.62 |
| 43 | 603051 | 鹿山新材 | 70,000 | 5,530,000.00 | 0.61 |
| 44 | 300724 | 捷佳伟创 | 60,000 | 5,361,000.00 | 0.59 |
| 45 | 601702 | 华峰铝业 | 400,000 | 5,280,000.00 | 0.58 |
| 46 | 600985 | 淮北矿业 | 360,000 | 5,241,600.00 | 0.58 |
| 47 | 688005 | 容百科技 | 40,000 | 5,177,600.00 | 0.57 |
| 48 | 600328 | 中盐化工 | 200,900 | 4,731,195.00 | 0.52 |

| | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 49 | 603589 | 口子窖 | 80,000 | 4,688,800.00 | 0.52 |
| 50 | 002006 | 精功科技 | 140,000 | 4,162,200.00 | 0.46 |
| 51 | 000301 | 东方盛虹 | 239,400 | 4,048,254.00 | 0.45 |
| 52 | 688063 | 派能科技 | 12,468 | 3,892,509.60 | 0.43 |
| 53 | 300505 | 川金诺 | 120,000 | 3,715,200.00 | 0.41 |
| 54 | 002986 | 宇新股份 | 150,000 | 3,522,000.00 | 0.39 |
| 55 | 002518 | 科士达 | 114,500 | 3,503,700.00 | 0.39 |
| 56 | 688707 | 振华新材 | 45,000 | 3,405,150.00 | 0.38 |
| 57 | 603063 | 禾望电气 | 86,300 | 3,318,235.00 | 0.37 |
| 58 | 300745 | 欣锐科技 | 60,000 | 2,992,800.00 | 0.33 |
| 59 | 603369 | 今世缘 | 57,000 | 2,907,000.00 | 0.32 |
| 60 | 688667 | 菱电电控 | 20,000 | 2,888,600.00 | 0.32 |
| 61 | 603212 | 赛伍技术 | 100,000 | 2,661,000.00 | 0.29 |
| 62 | 600941 | 中国移动 | 43,681 | 2,632,217.06 | 0.29 |
| 63 | 603799 | 华友钴业 | 26,000 | 2,486,120.00 | 0.28 |
| 64 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 100,000 | 2,321,000.00 | 0.26 |
| 65 | 688556 | 高测股份 | 27,997 | 2,259,357.90 | 0.25 |
| 66 | 600096 | 云天化 | 70,000 | 2,203,600.00 | 0.24 |
| 67 | 300432 | 富临精工 | 100,000 | 2,200,000.00 | 0.24 |
| 68 | 300438 | 鹏辉能源 | 35,300 | 2,169,185.00 | 0.24 |
| 69 | 688345 | 博力威 | 33,485 | 2,058,322.95 | 0.23 |
| 70 | 600546 | 山煤国际 | 94,700 | 1,842,862.00 | 0.20 |
| 71 | 300821 | 东岳硅材 | 100,000 | 1,838,000.00 | 0.20 |
| 72 | 688559 | 海目星 | 25,008 | 1,818,081.60 | 0.20 |
| 73 | 002782 | 可立克 | 100,000 | 1,704,000.00 | 0.19 |
| 74 | 000762 | 西藏矿业 | 30,000 | 1,677,900.00 | 0.19 |
| 75 | 002623 | 亚玛顿 | 40,000 | 1,602,400.00 | 0.18 |
| 76 | 300750 | 宁德时代 | 3,000 | 1,602,000.00 | 0.18 |
| 77 | 002101 | 广东鸿图 | 70,000 | 1,596,000.00 | 0.18 |
| 78 | 603032 | 德新交运 | 20,000 | 1,580,000.00 | 0.17 |
| 79 | 002897 | 意华股份 | 30,000 | 1,323,000.00 | 0.15 |
| 80 | 603982 | 泉峰汽车 | 50,000 | 1,219,500.00 | 0.13 |
| 81 | 300041 | 回天新材 | 70,000 | 1,215,900.00 | 0.13 |
| 82 | 002240 | 盛新锂能 | 20,000 | 1,207,200.00 | 0.13 |
| 83 | 600438 | 通威股份 | 20,000 | 1,197,200.00 | 0.13 |
| 84 | 002258 | 利尔化学 | 50,000 | 1,181,000.00 | 0.13 |
| 85 | 002459 | 晶澳科技 | 14,000 | 1,104,600.00 | 0.12 |
| 86 | 300681 | 英搏尔 | 19,000 | 1,097,630.00 | 0.12 |
| 87 | 600089 | 特变电工 | 40,000 | 1,095,600.00 | 0.12 |
| 88 | 600732 | 爱旭股份 | 33,000 | 1,089,660.00 | 0.12 |
| 89 | 300415 | 伊之密 | 50,000 | 911,500.00 | 0.10 |
| 90 | 688349 | 三一重能 | 13,386 | 545,479.50 | 0.06 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|------------|------|
| 91 | 688120 | 华海清科 | 1,929 | 479,163.60 | 0.05 |
| 92 | 001270 | 铖昌科技 | 568 | 57,481.60 | 0.01 |
| 93 | 601089 | 福元医药 | 1,749 | 36,816.45 | 0.00 |
| 94 | 301177 | 迪阿股份 | 476 | 35,319.20 | 0.00 |
| 95 | 001323 | 慕思股份 | 573 | 28,111.38 | 0.00 |
| 96 | 301201 | 诚达药业 | 353 | 25,253.62 | 0.00 |
| 97 | 301216 | 万凯新材 | 817 | 24,379.28 | 0.00 |
| 98 | 301268 | 铭利达 | 641 | 22,351.67 | 0.00 |
| 99 | 301236 | 软通动力 | 696 | 21,840.48 | 0.00 |
| 100 | 301211 | 亨迪药业 | 967 | 20,964.56 | 0.00 |
| 101 | 301207 | 华兰疫苗 | 339 | 19,126.38 | 0.00 |
| 102 | 300834 | 星辉环材 | 635 | 19,069.05 | 0.00 |
| 103 | 301101 | 明月镜片 | 371 | 19,043.43 | 0.00 |
| 104 | 301109 | 军信股份 | 1,176 | 18,980.64 | 0.00 |
| 105 | 301127 | 天源环保 | 1,685 | 18,754.05 | 0.00 |
| 106 | 301221 | 光庭信息 | 280 | 18,152.40 | 0.00 |
| 107 | 301102 | 兆讯传媒 | 559 | 17,379.31 | 0.00 |
| 108 | 301103 | 何氏眼科 | 507 | 16,234.14 | 0.00 |
| 109 | 301235 | 华康医疗 | 418 | 15,854.74 | 0.00 |
| 110 | 301151 | 冠龙节能 | 703 | 15,086.38 | 0.00 |
| 111 | 301168 | 通灵股份 | 329 | 14,831.32 | 0.00 |
| 112 | 301160 | 翔楼新材 | 392 | 14,762.72 | 0.00 |
| 113 | 301219 | 腾远钴业 | 158 | 13,875.56 | 0.00 |
| 114 | 301258 | 富士莱 | 295 | 12,295.60 | 0.00 |
| 115 | 301179 | 泽宇智能 | 295 | 12,038.95 | 0.00 |
| 116 | 301116 | 益客食品 | 577 | 11,805.42 | 0.00 |
| 117 | 001268 | 联合精密 | 409 | 11,337.48 | 0.00 |
| 118 | 301237 | 和顺科技 | 261 | 10,925.46 | 0.00 |
| 119 | 301138 | 华研精机 | 285 | 8,763.75 | 0.00 |
| 120 | 301193 | 家联科技 | 297 | 8,063.55 | 0.00 |
| 121 | 301110 | 青木股份 | 202 | 8,049.70 | 0.00 |
| 122 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02 | 0.00 |
| 123 | 301228 | 实朴检测 | 373 | 7,586.82 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 600256 | 广汇能源 | 91,320,576.20 | 8.50 |
| 2 | 300373 | 扬杰科技 | 71,205,022.85 | 6.63 |
| 3 | 601677 | 明泰铝业 | 61,817,058.55 | 5.76 |
| 4 | 300393 | 中来股份 | 53,398,909.20 | 4.97 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 5 | 605111 | 新洁能 | 51,516,164.80 | 4.80 |
| 6 | 600456 | 宝钛股份 | 49,594,693.00 | 4.62 |
| 7 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 45,613,683.30 | 4.25 |
| 8 | 600129 | 太极集团 | 41,555,483.00 | 3.87 |
| 9 | 600346 | 恒力石化 | 40,509,062.75 | 3.77 |
| 10 | 300428 | 立中集团 | 37,268,884.00 | 3.47 |
| 11 | 603035 | 常熟汽饰 | 36,700,519.86 | 3.42 |
| 12 | 300035 | 中科电气 | 36,562,889.69 | 3.40 |
| 13 | 300390 | 天华超净 | 34,997,007.40 | 3.26 |
| 14 | 603589 | 口子窖 | 33,489,565.00 | 3.12 |
| 15 | 688390 | 固德威 | 33,100,178.51 | 3.08 |
| 16 | 300590 | 移为通信 | 33,032,349.40 | 3.08 |
| 17 | 002056 | 横店东磁 | 32,777,248.00 | 3.05 |
| 18 | 300088 | 长信科技 | 32,652,659.56 | 3.04 |
| 19 | 600587 | 新华医疗 | 32,579,262.00 | 3.03 |
| 20 | 300274 | 阳光电源 | 32,558,948.00 | 3.03 |
| 21 | 002459 | 晶澳科技 | 32,527,332.00 | 3.03 |
| 22 | 002865 | 钧达股份 | 32,369,286.86 | 3.01 |
| 23 | 002728 | 特一药业 | 31,896,420.75 | 2.97 |
| 24 | 603538 | 美诺华 | 31,651,027.00 | 2.95 |
| 25 | 300502 | 新易盛 | 30,646,631.84 | 2.85 |
| 26 | 605117 | 德业股份 | 28,637,536.00 | 2.67 |
| 27 | 002648 | 卫星化学 | 28,279,683.04 | 2.63 |
| 28 | 002013 | 中航机电 | 27,575,383.04 | 2.57 |
| 29 | 000887 | 中鼎股份 | 27,475,517.00 | 2.56 |
| 30 | 300505 | 川金诺 | 27,460,240.06 | 2.56 |
| 31 | 300821 | 东岳硅材 | 26,388,225.00 | 2.46 |
| 32 | 002335 | 科华数据 | 26,208,774.00 | 2.44 |
| 33 | 603369 | 今世缘 | 25,809,683.00 | 2.40 |
| 34 | 000739 | 普洛药业 | 24,455,928.60 | 2.28 |
| 35 | 002345 | 潮宏基 | 24,257,968.00 | 2.26 |
| 36 | 600096 | 云天化 | 24,223,125.56 | 2.26 |
| 37 | 300305 | 裕兴股份 | 23,555,291.65 | 2.19 |
| 38 | 300073 | 当升科技 | 23,421,014.45 | 2.18 |
| 39 | 300610 | 晨化股份 | 23,409,335.72 | 2.18 |
| 40 | 603198 | 迎驾贡酒 | 23,358,066.90 | 2.18 |
| 41 | 688599 | 天合光能 | 22,755,668.73 | 2.12 |
| 42 | 603456 | 九洲药业 | 22,435,369.96 | 2.09 |
| 43 | 600039 | 四川路桥 | 22,434,938.44 | 2.09 |
| 44 | 688680 | 海优新材 | 22,079,705.34 | 2.06 |

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

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1 | 600256 | 广汇能源 | 78,853,054.40 | 7.34 |
| 2 | 605111 | 新洁能 | 64,012,085.24 | 5.96 |
| 3 | 601677 | 明泰铝业 | 60,038,940.80 | 5.59 |
| 4 | 600456 | 宝钛股份 | 56,620,984.80 | 5.27 |
| 5 | 002935 | 天奥电子 | 49,961,814.60 | 4.65 |
| 6 | 603538 | 美诺华 | 47,982,247.36 | 4.47 |
| 7 | 603456 | 九洲药业 | 46,839,237.90 | 4.36 |
| 8 | 603589 | 口子窖 | 45,274,471.39 | 4.22 |
| 9 | 603369 | 今世缘 | 45,068,144.48 | 4.20 |
| 10 | 600587 | 新华医疗 | 44,713,575.00 | 4.16 |
| 11 | 300393 | 中来股份 | 44,208,202.00 | 4.12 |
| 12 | 300373 | 扬杰科技 | 43,680,291.78 | 4.07 |
| 13 | 000568 | 泸州老窖 | 42,747,423.00 | 3.98 |
| 14 | 002245 | 蔚蓝锂芯 | 40,423,850.00 | 3.76 |
| 15 | 600346 | 恒力石化 | 39,991,533.35 | 3.72 |
| 16 | 002960 | 青鸟消防 | 38,781,184.00 | 3.61 |
| 17 | 600021 | 上海电力 | 38,404,710.71 | 3.58 |
| 18 | 600129 | 太极集团 | 38,218,773.00 | 3.56 |
| 19 | 300394 | 天孚通信 | 36,572,260.20 | 3.41 |
| 20 | 002459 | 晶澳科技 | 35,426,477.00 | 3.30 |
| 21 | 002728 | 特一药业 | 34,943,605.44 | 3.25 |
| 22 | 300502 | 新易盛 | 30,084,025.01 | 2.80 |
| 23 | 300590 | 移为通信 | 30,073,271.00 | 2.80 |
| 24 | 002655 | 共达电声 | 29,794,314.00 | 2.77 |
| 25 | 002585 | 双星新材 | 29,517,381.10 | 2.75 |
| 26 | 601058 | 赛轮轮胎 | 28,887,037.30 | 2.69 |
| 27 | 600884 | 杉杉股份 | 28,208,665.57 | 2.63 |
| 28 | 002648 | 卫星化学 | 27,994,523.00 | 2.61 |
| 29 | 600460 | 士兰微 | 26,760,576.84 | 2.49 |
| 30 | 600702 | 舍得酒业 | 25,444,137.15 | 2.37 |
| 31 | 000739 | 普洛药业 | 24,989,076.60 | 2.33 |
| 32 | 603678 | 火炬电子 | 24,560,401.60 | 2.29 |
| 33 | 688599 | 天合光能 | 24,459,607.76 | 2.28 |
| 34 | 002345 | 潮宏基 | 23,828,583.00 | 2.22 |
| 35 | 605117 | 德业股份 | 23,766,883.60 | 2.21 |
| 36 | 600577 | 精达股份 | 23,721,431.00 | 2.21 |
| 37 | 603035 | 常熟汽饰 | 23,573,283.62 | 2.20 |
| 38 | 300088 | 长信科技 | 23,431,223.50 | 2.18 |
| 39 | 002013 | 中航机电 | 22,803,560.00 | 2.12 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 40 | 000887 | 中鼎股份 | 22,516,417.00 | 2.10 |
| 41 | 600197 | 伊力特 | 22,144,768.08 | 2.06 |
| 42 | 002675 | 东诚药业 | 21,811,610.00 | 2.03 |
| 43 | 300274 | 阳光电源 | 21,598,907.00 | 2.01 |
| 44 | 002216 | 三全食品 | 21,519,891.80 | 2.00 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 3,248,408,492.46 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 3,315,166,735.05 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 396,780.47 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 335,063.22 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 731,843.69 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末不存在前十名股票流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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(%) |
| 浦银安盛价值成长混合 A | 41,361 | 12,367.45 | 25,259,158.95 | 4.94 | 486,271,104.24 | 95.06 |
| 浦银安盛价值成长混合 C | 112 | 1,923.57 | 0.00 | 0.00 | 215,439.30 | 100.00 |
| 合计 | 41,473 | 12,339.25 | 25,259,158.95 | 4.94 | 486,486,543.54 | 95.06 |

8.2 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(%) |
|----|------|-----------|-------------|
|----|------|-----------|-------------|

| | | | |
|------------------|--------------|------------|------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 浦银安盛价值成长混合 A | 406,033.30 | 0.08 |
| | 浦银安盛价值成长混合 C | 4.31 | 0.00 |
| | 合计 | 406,037.61 | 0.08 |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 浦银安盛价值成长混合 A | 0 |
| | 浦银安盛价值成长混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 浦银安盛价值成长混合 A | 0 |
| | 浦银安盛价值成长混合 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 浦银安盛价值成长混合 A | 浦银安盛价值成长混合 C |
|-----------------------------------|------------------|--------------|
| 基金合同生效日 (2008年4月16日) 基金份额总额 | 1,733,163,625.10 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 456,488,665.23 | 56,886.88 |
| 本报告期基金总申购份额 | 78,710,530.10 | 283,960.53 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 23,668,932.14 | 125,408.11 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 511,530,263.19 | 215,439.30 |

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。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)，未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人、托管人及其高级管理人员未受到有权机关调查、司法纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、中国证监会稽查、中国证监会行政处罚、证券市场禁入、认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚及证券交易所公开谴责的情形。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------------|------------------|--------------|----------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 (%) | |
| 海通证券 | 1 | 2,848,479,37 5.28 | 43.46 | 2,652,789.02 | 43.46 | - |
| 中泰证券 | 1 | 1,874,111,79 3.76 | 28.59 | 1,745,356.68 | 28.59 | - |

| | | | | | | |
|--------|---|----------------|-------|------------|-------|---|
| 方正证券 | 3 | 909,645,277.05 | 13.88 | 847,149.16 | 13.88 | - |
| 民生证券 | 1 | 466,692,629.84 | 7.12 | 434,629.85 | 7.12 | - |
| 中金 | 1 | 455,764,313.18 | 6.95 | 424,461.20 | 6.95 | - |
| 安信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | 1 | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | 1 | - | - | - | - | - |

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|--------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 民生证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中金 | - | - | - | - | - | - |
| 安信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 德邦证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 光大证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国金证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安 | - | - | - | - | - | - |
| 国信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 华泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 申万宏源 | - | - | - | - | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 浙商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中国银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中银国际 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|--|---------|-----------------|
| 1 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告 | 报刊及规定网站 | 2022 年 1 月 18 日 |
| 2 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2021 年度分红公告 | 报刊及规定网站 | 2022 年 1 月 18 日 |
| 3 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2021 年第 4 季度报告 | 规定网站 | 2022 年 1 月 24 日 |
| 4 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2021 年年度报告 | 规定网站 | 2022 年 3 月 31 日 |
| 5 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金 2022 年第 1 季度报告 | 规定网站 | 2022 年 4 月 22 日 |
| 6 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基 | 规定网站 | 2022 年 5 月 27 日 |

| | | | |
|---|-----------------------------|------|-----------------|
| | 金招募说明书（更新）2022 年第 1 号 | | |
| 7 | 浦银安盛价值成长混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2022 年 5 月 27 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛价值成长混合型证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛价值成长混合型证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛价值成长混合型证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛价值成长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

12.2 存放地点

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日