

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  
2022 年年度报告

2022 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：海通证券股份有限公司

送出日期：2023 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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务出具了带强调事项段的无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 3 月 8 日起至 2022 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 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
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	16
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>16</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
<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	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
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 .....	50
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 .....	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	68
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 .....	68
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 .....	69
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 .....	69
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 .....	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	69
8.12 投资组合报告附注 .....	69
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>70</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	70
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	70
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	71
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	71
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>71</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>71</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	71
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 .....	71
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
11.4 基金投资策略的改变 .....	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
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 .....	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	72
11.8 其他重大事件 .....	73
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>75</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 .....	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	76
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>77</b>
13.1 备查文件目录 .....	77
13.2 存放地点 .....	77
13.3 查阅方式 .....	77

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF
场内简称	红 300（扩位证券简称：红 300ETF）
基金主代码	517780
前端交易代码	517780
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 3 月 8 日
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人	海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	12,451,060.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2022 年 3 月 18 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金以紧密跟踪标的指数，获取指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的前提下，构建指数化的投资组合。
业绩比较基准	中华交易服务沪深港 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票时，会面临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	海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	薛香	邓来承
	联系电话	021-23212888	021-23185481
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	dlc11913@haitong.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95553
传真		021-23212985	021-23187700
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	上海市广东路 689 号
办公地址		上海市浦东新区滨江大道 5189 号	上海市黄浦区中山南路 888 号海

	S2 座 1-7 层	通外滩金融广场
邮政编码	200127	200011
法定代表人	谢伟	周杰

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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 (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	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、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	2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 日
本期已实现收益	10,007,721.83
本期利润	10,203,713.56
加权平均基金份额本期利润	0.2752
本期加权平均净值利润率	27.11%
本期基金份额净值增长率	0.55%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末
期末可供分配利润	68,993.68
期末可供分配基金份额利润	0.0055
期末基金资产净值	12,520,053.68
期末基金份额净值	1.0055
3.1.3 累计期末指标	2022 年末
基金份额累计净值增长率	0.55%

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、本基金《基金合同》2022 年 3 月 8 日生效，至报告期末，合同成立未满一年。

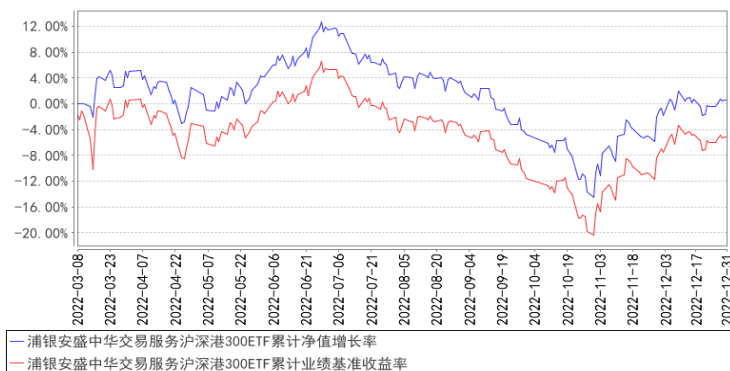
## 3.2 基金净值表现

### 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

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	5.52%	1.58%	7.29%	1.57%	-1.77%	0.01%
过去六个月	-10.07%	1.28%	-10.04%	1.28%	-0.03%	0.00%
自基金合同生效起至今	0.55%	1.30%	-5.17%	1.45%	5.72%	-0.15%

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

浦银安盛中华交易服务沪深港300ETF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

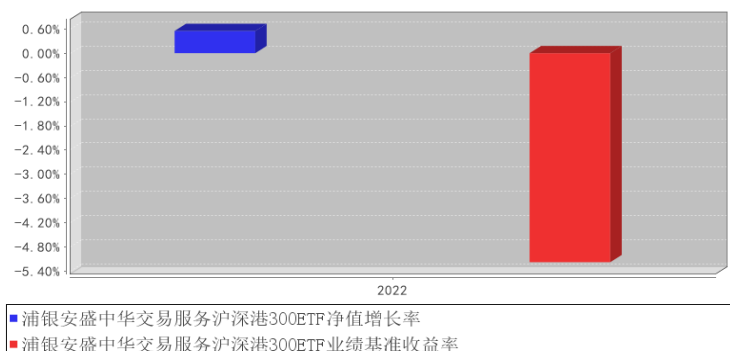


注：1、本基金合同生效日为2022年3月8日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满1年。

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2022年3月8日至2022年9月7日。建仓期结束时符合相关规定。

### 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

浦银安盛中华交易服务沪深港300ETF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 2022 年 3 月 8 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管理有限公司，公司总部设在上海，注册资本为 120,000 万元人民币，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 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 101 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、浦银安盛盛焯 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、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证券投资基金、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证券投资基金、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、浦银安盛普诚纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银安盛季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。当前公司顺利完成上交所金桥机房搬迁，新职场大楼信息技术相关系统建设，结合合肥异地灾备中心，初步形成两地三中心的布局，进一步完善了公司信息技术基础设施系统建设，这些系统由公司信息技术部主导并聘请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。近年，公司信息技术部以自主开发平台为基础，构建了数字化运营平台、大数据开发平台、创新研发平台、移动平台等业务应用平台，初步创建了公司自研团队。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		
高钢杰	本基金的基金经理	2022 年 3 月 8 日	-	12 年	高钢杰先生，中国科学院天体物理博士。2010 年 10 月至 2014 年 3 月在上海东证期货研究所、国泰君安期货研究所担任量化投资研究员。2014 年 3 月至 2018 年 10 月在

				中国工商银行总行贵金属业务部工作, 历任产品研发经理、代客交易经理。2018 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司, 参与 ETF 业务筹备工作。2019 年 3 月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 6 月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金及浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 7 月起担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 9 月起担任浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。2021 年 7 月起担任浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月起担任浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 11 月起担任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的基金经理。2021 年 12 月起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及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的基金经理。2022 年 3 月起担任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的基金经理。2022 年 4 月起担任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的基金经理。2022 年 6 月起担任浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--

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

3、根据 2023 年 1 月 30 日《关于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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，自 2023 年 1 月 31 日起，高钢杰先生不再担任本基金的基金经理。

## 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。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。

#### 4.3.3 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

2022 年，在美联储强烈的加息周期、突发的俄乌地缘冲突以及超预期的新冠疫情影响下，A 股市场全年震荡下行。市场对政策层面阶段性存在较强的稳增长预期，但受限于客观条件，实际经济增速低于预期。在整体下行趋势中，指数层面有两次较大的反弹行情，分别从 4 月底到 7 月初、10 月底到年底，是年内较好的阶段性投资机会。其中，4 月底的反弹主要是疫情影响预期好转以及政策支持影响，市场从极度悲观中的修复；而 10 月底以来的反弹，则是市场对地产政策调整、防疫政策优化以及经济复苏预期的反应。2022 年市场整体波动较大，市场分化明显，行业轮动较快，投资难度较高。报告期内，我们根据指数定期成份股调整进行了基金调仓，事前制定了详细的调仓方案，在实施过程中严控风险与跟踪偏离度，平稳完成基金持仓调整。报告期内，本基金保持较低的跟踪误差，较好地实现了基金的投资目标。本基金跟踪误差来源主要包含成份股调整、基金申赎和股票停牌等。

在投资策略方面，作为投资于中华交易服务沪深港 300 指数成份股的被动型投资产品，本基金采取完全复制指数的投资策略，严格控制每日基金净值与业绩基准波动的偏差，使基金回报紧

密跟踪目标指数的收益，降低跟踪偏离度。本基金以获取沪港深三地“沪股通”、“深股通”、“港股通”各 100 只市值较大证券的长期收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的前提下，构建紧密跟踪标的指数的投资组合。

#### 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中华交易服务沪深港 300ETF 基金份额净值为 1.0055 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.55%；同期业绩比较基准收益率为-5.17%。

#### 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 2023 年，国内经济复苏的确定性较高，市场也存在低位反弹的投资机会。随着疫情政策的优化调整，叠加扩内需政策的支持，消费端复苏可期，实体企业对经济复苏的信心较强，预计全年 GDP 增速在 2022 年低基数的基础上有较高的抬升。对于资本市场而言，2023 年 A 股有望震荡上行，上行高度取决于经济复苏强度、政策力度以及欧美经济体衰退的程度。此外，科技自主、能源转型以及高质量发展等方向可能存在较好的结构性投资机会。

#### 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》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》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。

2022 年以来，公司进一步强化合规风险底线意识，塑造良好的合规风控文化，打造“纵向到底，横向到边”的合规风控机制，促进公司持续、健康、平稳地高质量发展，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重大风险事件。

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。2022 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、客户投诉处理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后续审计工作。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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规和基金合同的规定。

#### 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

根据《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基金合同》以及基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2023 年 1 月 31 日发布的《关于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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基

金于 2023 年 2 月 1 日进入财产清算期。会计师事务所出具带强调事项段的无保留意见的审计报告：提醒财务报告使用者关注，如财务报告附注“7.4.2 会计报告的编制基础”所述，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”）拟在资产负债表日后清算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的剩余资产。因此，上述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的财务报告以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。

#### 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

1、本报告期内，2022 年 8 月 29 日至 2022 年 10 月 9 日，本基金基金份额持有人数量不满二百人超过连续二十个工作日。

2、本报告期内超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万，本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在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，浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数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中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数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，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中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中的财务数据等内容进行了核查，以上内容真实、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	带强调事项段的无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 28152 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	浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数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中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的利润表和净资产(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中华交易服务沪深港 300ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</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中华交易服务沪深港 300ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注,如财务报表附注“7.4.2 会计报表的编制基础”所述,浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF 基金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”)拟在资产负债表日后清算浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF 基金的剩余资产。因此,上述浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF 基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>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中华交易服务沪深港 300ETF 基金的持续经营能力，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中华交易服务沪深港 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。参见财务报表附注 7.4.2 有关以清算基础编制财务报表的说明。</p> <p>基金管理人治理层负责监督浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF 基金的财务报告过程。</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，就可能对浦银安盛中华交易服务沪深港 300ETF 基金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。</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	赵钰   沈俐
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	2023 年 3 月 27 日
--------	-----------------

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	652,166.94
结算备付金		26,584.48
存出保证金		48,495.94
交易性金融资产	7.4.7.2	11,975,428.93
其中：股票投资		11,975,428.93
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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		782.73
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		12,703,459.02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 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		-
应付清算款		1.35

应付赎回款		-
应付管理人报酬		5,123.89
应付托管费		1,024.78
应付销售服务费		-
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	7.4.7.9	177,255.32
负债合计		183,405.34
<b>净资产：</b>		
实收基金	7.4.7.10	12,451,060.00
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	68,993.68
净资产合计		12,520,053.68
负债和净资产总计		12,703,459.02

注：1. 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0055 元，基金份额总额 12,451,060.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2022 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		10,545,365.09
1. 利息收入		199,862.75
其中：存款利息收入	7.4.7.13	199,862.75
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）		8,907,970.48
其中：股票投资收益	7.4.7.14	8,319,337.61
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-

贵金属投资收益	7.4.7.17	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-
股利收益	7.4.7.19	588,632.87
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）	7.4.7.20	195,991.73
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	1,241,540.13
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>341,651.53</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	148,213.79
2. 托管费	7.4.10.2.2	29,642.71
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
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	7.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.23	163,795.03
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>10,203,713.56</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>10,203,713.56</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>10,203,713.56</b>

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 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）	-	-	-	-
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)	243,451,060.00	-	-	243,451,060.00
三、本 期 增 减 变 动 额 ( 减 少 以 “- ” 号 填 列)	-231,000,000.00	-	68,993.68	-230,931,006.32
(一)、 综 合 收 益 总 额	-	-	10,203,713.56	10,203,713.56
(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)	-231,000,000.00	-	-10,134,719.88	-241,134,719.88
其中:1. 基 金 申 购 款	60,000,000.00	-	-422,290.06	59,577,709.94
2 .基 金 赎 回 款	-291,000,000.00	-	-9,712,429.82	-300,712,429.82
(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)	-	-	-	-

(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)	12,451,060.00	-	68,993.68	12,520,053.68

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]2126 号《关于准予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《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 243,446,220.00 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(2022)第 0161 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2022 年 3 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 243,451,060.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 4,840.00 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为海通证券股份有限公司。

根据《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基金合同》和《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招募说明书》的有关规定,经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]64 号核准,本基金 243,451,060.00 份基金份额于 2022 年 3 月 18 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股,

为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板、港股通标的股票及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中华交易服务沪深港 300 指数收益率。

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 2023 年 3 月 27 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛中华交易服务沪深港 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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。

根据《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基金合同》、本基金基金份额持有人大会于 2023 年 1 月 30 日表决通过的《关于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终止基金合同并终止上市有关事项的议案》以及基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2023 年 1 月 31 日发布的《关于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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2023 年 2 月 1 日进入财产清算期，详情参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项，因此本基金财务报表以清算基础编制。于 2022 年 12 月 31 日，所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2022 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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 3 月 8



日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产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 2022 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2022 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

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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

###### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表

中列示为交易性金融资产。

## (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。

### 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。

于本报告期内及上年度可比期间，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。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

于本报告期末，各项金融资产以可收回金额和账面价值孰低计量。

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。

#### 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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

以摊余成本计量的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

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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配，本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 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。

#### 7.4.4.14 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

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2022 年 12 月 31 日
活期存款	652,166.94
等于：本金	651,840.49
加：应计利息	326.45
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	652,166.94

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	11,779,437.20	-	11,975,428.93	195,991.73
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	11,779,437.20	-	11,975,428.93	195,991.73

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 7.4.7.3.2 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。

## 7.4.7.3.3 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。

## 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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 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。

## 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未按预期信用损失一般模型计提减值准备。

## 7.4.7.5 债权投资

## 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

## 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。



#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	17,255.32
其中：交易所市场	17,255.32
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	160,000.00
合计	177,255.32

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	243,451,060.00	243,451,060.00
本期申购	60,000,000.00	60,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-291,000,000.00	-291,000,000.00
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	12,451,060.00	12,451,060.00

注：1. 本基金自 2021 年 12 月 21 日至 2022 年 3 月 2 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 243,446,220.00 元，折合为 243,446,220.00 份基金份额。根据《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 4,840.00 元在本基金成立后，折合为 4,840.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《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基金合同》、《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招募说明书》及《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开放日常申购、赎回业务公告》的相关规定，本基金于 2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 3 月 17 日止期间暂不向投资人开放基金交易，申购业务和赎回业务自 2022 年 3 月 18 日起开始办理。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	10,007,721.83	195,991.73	10,203,713.56
本期基金份额交易产生的变动数	-8,662,719.95	-1,471,999.93	-10,134,719.88
其中：基金申购款	7,902,516.69	-8,324,806.75	-422,290.06
基金赎回款	-16,565,236.64	6,852,806.82	-9,712,429.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,345,001.88	-1,276,008.20	68,993.68

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	130,138.30
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	14,868.81
其他	54,855.64
合计	199,862.75

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	6,750,798.49
股票投资收益——赎回差价收入	1,568,539.12
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	8,319,337.61

#### 7.4.7.14.2 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3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	205,366,620.11
减：卖出股票成本总额	197,781,152.36
减：交易费用	834,669.26
买卖股票差价收入	6,750,798.49

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
赎回基金份额对价总额	300,712,429.82
减：现金支付赎回款总额	195,945,704.82
减：赎回股票成本总额	103,198,185.88
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,568,539.12

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 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。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 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。

##### 7.4.7.15.2 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。

##### 7.4.7.15.3 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。

**7.4.7.15.4 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。

**7.4.7.16 资产支持证券投资收益****7.4.7.16.1 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。

**7.4.7.16.2 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。

**7.4.7.16.3 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。

**7.4.7.16.4 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。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 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。

**7.4.7.17.2 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。

**7.4.7.17.3 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。

**7.4.7.17.4 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。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 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。

**7.4.7.18.2 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。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	588,632.87
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	588,632.87

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1. 交易性金融资产	195,991.73
股票投资	195,991.73
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	195,991.73

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,241,540.13
合计	1,241,540.13

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	120,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	3,195.03
账户维护费	200.00
开户费	400.00

合计	163,795.03
----	------------

#### 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

根据《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基金合同》，本基金基金份额持有人大会于 2023 年 1 月 30 日表决通过的《关于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终止基金合同并终止上市有关事项的议案》以及基金管理人浦银安盛于 2023 年 1 月 31 日发布的《关于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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金于 2023 年 2 月 1 日进入财产清算程序。

##### 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
海通证券股份有限公司（“海通证券”）	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
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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
海通证券	501,451,535.47	100.00

###### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
海通证券	382,766.74	100.00	17,255.32	100.00

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

### 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 2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	5,868.02

注：支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年3月8日（基金合同生效日）至2022年12月31日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：支付基金托管人海通证券的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

**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：本基金本报告期内未发生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。

**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：本基金本报告期内未发生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。

**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 2022 年 3 月 8 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 2022 年 3 月 8 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 2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
	海通证券	652,166.94

注：本基金由基金托管人海通证券保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

**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**

1. 于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 3,000.00 股托管人海通证券的普通股，成本总额为人民币 27,006.56 元，估值总额为人民币 26,070.00 元，占基金净资产的比例为 0.21%。



2. 于 2022 年 12 月 31 日, 本基金持有 3,900.00 股浦发银行的普通股, 成本总额为人民币 28,303.74 元, 估值总额为人民币 28,392.00 元, 占基金净资产的比例为 0.23%。

#### 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 (2022 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

注: 本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
01918.HK	融创中国	2022 年 4 月 1 日	重大事项停牌	1.22	-	-	10,000	41,564.38	12,237.80	-
00813.HK	世茂集团	2022 年 4 月 1 日	重大事项停牌	1.19	-	-	3,500	11,512.26	4,158.17	-
06666.HK	恒大物业	2022 年 3 月 21 日	重大事项停牌	0.01	-	-	23,500	37,942.77	209.92	-
03333.HK	中国恒大	2022 年 3 月 21 日	重大事项停牌	0.01	-	-	12,000	13,473.93	107.19	-

##### 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

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数中华交易服务沪深港 300 指数的表现，

具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资港股通标的股票时，会面临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。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股（包括主板、创业板、港股通标的股票及其他中国证监会允许基金投资的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银

行存款、同业存单、股指期货等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符

合中国证监会的相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。

本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围

之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

#### 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、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、

合规及审计委员会、督察长。

本基金管理人下设的各业务部门是公司第一线风险控制的实施者，均备有符合法律法规、公司政策的业务流程，其中包含与其业务相关的风险控制措施、风险管理计划、工作流程和管理责任。这些流程均得到公司管理层的批准。

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，主要负责制定公司的风险管理政策，并监督实施，确保公司整体风险暴露得到有效的识别、评估、监控和控制。公司设立风险管理部与法律合规部监控公司面临的各类风险。风险管理部建立了定性和数量化分析模型进行基金投资风险和绩效评估，法律合规部根据基金相关法律法规、公司基本制度及业务流程，对信息披露、法律文件等进行事中审核，并对基金管理人经营活动及各职能部门履职情况的合法合规性进行监督和检查。

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

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

#### 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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人海通证券股份有限公司开立于中国工商银行股份有限公司的托管账户，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 12 月 31 日，本基金无债券投资和资产支持证券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

### 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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(净资产)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 2022 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。

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。

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

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	652,166.94	-	-	-	652,166.94
结算备付金	26,584.48	-	-	-	26,584.48
存出保证金	48,495.94	-	-	-	48,495.94
交易性金融资产	-	-	-	11,975,428.93	11,975,428.93
应收股利	-	-	-	782.73	782.73
<b>资产总计</b>	<b>727,247.36</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>11,976,211.66</b>	<b>12,703,459.02</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	5,123.89	5,123.89
应付托管费	-	-	-	1,024.78	1,024.78
应付清算款	-	-	-	1.35	1.35
其他负债	-	-	-	177,255.32	177,255.32
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>183,405.34</b>	<b>183,405.34</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>727,247.36</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>11,792,806.32</b>	<b>12,520,053.68</b>

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

注：于2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币 元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	6,161,541.61	-	6,161,541.61
资产合计	-	6,161,541.61	-	6,161,541.61
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇 风险敞口净额	-	6,161,541.61	-	6,161,541.61

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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（2022 年 12 月 31 日）
分析	1. 所有外币相对人民币升值 5%	308,077.08
	2. 所有外币相对人民币贬值 5%	-308,077.08

#### 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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中华交易服务沪深港 300 指数，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金股票组合根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，中华交易服务沪深港 300 指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪

和控制。

#### 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 2022 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	11,975,428.93	95.65
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	11,975,428.93	95.65

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变	
	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 12 月 31 日）
分析	业绩比较基准上升 500 基点	631,584.89
	业绩比较基准下降 500 基点	-631,584.89

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 12 月 31 日
第一层次	11,958,715.85
第二层次	-
第三层次	16,713.08
合计	11,975,428.93

#### 7.4.14.2.2 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，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 3 月 8 日（基金合同生效日）至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	16,713.08	16,713.08
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	16,713.08	16,713.08
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期	-	-87,780.26	-87,780.26



损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
--------------------------	--	--	--

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为香港证券交易所上市交易但处于停牌中的股票投资。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	16,395.97	市场法	可比公司股价变动率	-70%	正相关
流通受限股票	317.11	市场法	市净率	1	正相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2022 年 3 月 8 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日止期间，本基金申购基金份额的对价总额为 59,577,709.94 元，其中包括以股票支付的申购款 16,031,640.08 元和以现金支付的申购款 43,546,069.86 元。

##### (2) 除基金申购款外，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	11,975,428.93	94.27
	其中：股票	11,975,428.93	94.27
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	678,751.42	5.34
8	其他各项资产	49,278.67	0.39
9	合计	12,703,459.02	100.00

注：其中港股通股票投资（12,703,459.02 元）占总资产比例 48.50%。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	73,320.00	0.59
B	采矿业	159,511.00	1.27
C	制造业	3,519,097.36	28.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	125,133.00	1.00
E	建筑业	97,389.00	0.78
F	批发和零售业	14,040.00	0.11
G	交通运输、仓储和邮政业	119,466.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	232,256.80	1.86
J	金融业	1,145,062.00	9.15
K	房地产业	92,295.00	0.74
L	租赁和商务服务业	86,853.00	0.69
M	科学研究和技术服务业	100,440.00	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	40,018.16	0.32
R	文化、体育和娱乐业	9,006.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	5,813,887.32	46.44

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期内无积极投资。

## 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	16,458.50	0.13
非周期性消费品	1,028,365.48	8.21
周期性消费品	409,573.24	3.27
能源	179,636.60	1.43
金融	1,949,970.90	15.57
医疗	379,639.75	3.03
工业	289,396.25	2.31
信息技术	226,853.96	1.81
电信服务	888,097.97	7.09
公用事业	248,304.07	1.98
房地产	545,244.89	4.35
合计	6,161,541.61	49.21

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	2,100	626,539.58	5.00
2	600519	贵州茅台	300	518,100.00	4.14
3	02318	中国平安	5,000	230,686.98	1.84
3	601318	中国平安	3,600	169,200.00	1.35
4	00005	汇丰控股	7,200	312,251.46	2.49
5	03690	美团-W	2,000	312,108.54	2.49
6	01299	友邦保险	4,000	310,143.34	2.48
7	600036	招商银行	3,900	145,314.00	1.16
7	03968	招商银行	3,000	116,973.71	0.93
8	300750	宁德时代	600	236,052.00	1.89
9	00388	香港交易所	700	210,847.45	1.68
10	00939	建设银行	39,000	170,355.52	1.36
11	01211	比亚迪股份	500	86,021.90	0.69
11	002594	比亚迪	300	77,091.00	0.62
12	00941	中国移动	3,500	161,793.53	1.29
13	02269	药明生物	3,000	160,386.63	1.28
14	01398	工商银行	27,000	96,955.53	0.77
14	601398	工商银行	11,400	49,476.00	0.40
15	02331	李宁	2,000	121,038.09	0.97
16	000858	五粮液	600	108,414.00	0.87
17	02378	保诚	1,100	107,790.89	0.86
18	00883	中国海洋石油	12,000	106,978.02	0.85
19	03988	中国银行	32,000	81,180.38	0.65

19	601988	中国银行	6,900	21,804.00	0.17
20	00291	华润啤酒	2,000	97,455.76	0.78
21	00016	新鸿基地产	1,000	95,401.24	0.76
22	300760	迈瑞医疗	300	94,791.00	0.76
23	601012	隆基绿能	2,194	92,718.44	0.74
24	02020	安踏体育	1,000	91,381.52	0.73
25	09633	农夫山泉	2,200	86,665.06	0.69
26	600809	山西汾酒	300	85,497.00	0.68
27	03328	交通银行	11,000	44,118.61	0.35
27	601328	交通银行	8,700	41,238.00	0.33
28	601166	兴业银行	4,800	84,432.00	0.67
29	00981	中芯国际	3,500	52,274.16	0.42
29	688981	中芯国际	764	31,430.96	0.25
30	00001	长和	2,000	83,699.40	0.67
31	01024	快手-W	1,300	82,506.88	0.66
32	02628	中国人寿	5,000	59,849.09	0.48
32	601628	中国人寿	600	22,272.00	0.18
33	00669	创科实业	1,000	77,803.82	0.62
34	000333	美的集团	1,500	77,700.00	0.62
35	600900	长江电力	3,600	75,600.00	0.60
36	06690	海尔智家	1,800	42,769.77	0.34
36	600690	海尔智家	1,200	29,352.00	0.23
37	06160	百济神州	600	71,926.10	0.57
38	02388	中银香港	3,000	71,282.95	0.57
39	000568	泸州老窖	300	67,284.00	0.54
40	00386	中国石油化工股份	14,000	47,146.79	0.38
40	600028	中国石化	4,200	18,312.00	0.15
41	600887	伊利股份	2,100	65,100.00	0.52
42	601888	中国中免	300	64,809.00	0.52
43	300059	东方财富	3,320	64,408.00	0.51
44	01109	华润置地	2,000	63,868.81	0.51
45	02319	蒙牛乳业	2,000	63,243.52	0.51
46	600030	中信证券	3,000	59,730.00	0.48
47	09987	百胜中国	150	58,821.83	0.47
48	01093	石药集团	8,000	58,598.51	0.47
49	601288	农业银行	10,200	29,682.00	0.24
49	01288	农业银行	12,000	28,727.56	0.23
50	00011	恒生银行	500	57,973.22	0.46
51	600276	恒瑞医药	1,500	57,795.00	0.46
52	300896	爱美客	100	56,635.00	0.45
53	600309	万华化学	600	55,590.00	0.44
54	00688	中国海外发展	3,000	55,204.09	0.44
55	01810	小米集团-W	5,600	54,725.29	0.44

56	601601	中国太保	1,200	29,424.00	0.24
56	02601	中国太保	1,600	24,840.05	0.20
57	688111	金山办公	200	52,898.00	0.42
58	002415	海康威视	1,500	52,020.00	0.42
59	002352	顺丰控股	900	51,984.00	0.42
60	00002	中电控股	1,000	50,871.73	0.41
61	02688	新奥能源	500	48,951.20	0.39
62	603259	药明康德	600	48,600.00	0.39
63	000651	格力电器	1,500	48,480.00	0.39
64	002304	洋河股份	300	48,150.00	0.38
65	002475	立讯精密	1,500	47,625.00	0.38
66	02313	申洲国际	600	47,057.46	0.38
67	01928	金沙中国有限公司	2,000	46,271.39	0.37
68	00027	银河娱乐	1,000	46,092.73	0.37
69	601899	紫金矿业	4,600	46,000.00	0.37
70	688599	天合光能	700	44,632.00	0.36
71	06618	京东健康	700	44,614.37	0.36
72	00267	中信股份	6,000	44,163.27	0.35
73	002714	牧原股份	900	43,875.00	0.35
74	00960	龙湖集团	2,000	43,412.92	0.35
75	01113	长实集团	1,000	42,921.62	0.34
76	01658	邮储银行	6,000	25,994.16	0.21
76	601658	邮储银行	3,600	16,632.00	0.13
77	300124	汇川技术	600	41,700.00	0.33
78	02382	舜宇光学科技	500	41,470.06	0.33
79	02015	理想汽车-W	600	41,161.88	0.33
80	00857	中国石油股份	8,000	25,511.79	0.20
80	601857	中国石油	3,100	15,407.00	0.12
81	000792	盐湖股份	1,800	40,842.00	0.33
82	00175	吉利汽车	4,000	40,733.11	0.33
83	01997	九龙仓置业	1,000	40,643.79	0.32
84	000725	京东方 A	12,000	40,560.00	0.32
85	300015	爱尔眼科	1,288	40,018.16	0.32
86	002049	紫光国微	300	39,546.00	0.32
87	000001	平安银行	3,000	39,480.00	0.32
88	002812	恩捷股份	300	39,387.00	0.31
89	002142	宁波银行	1,200	38,940.00	0.31
90	000002	万科 A	2,100	38,220.00	0.31
91	00066	港铁公司	1,000	36,936.71	0.30
92	600048	保利发展	2,400	36,312.00	0.29
93	601668	中国建筑	6,600	35,838.00	0.29
94	603986	兆易创新	348	35,659.56	0.28
95	600438	通威股份	900	34,722.00	0.28

96	002129	TCL 中环	900	33,894.00	0.27
97	300274	阳光电源	300	33,540.00	0.27
98	601088	中国神华	1,200	33,144.00	0.26
99	00003	香港中华煤气	5,000	33,140.32	0.26
100	603288	海天味业	400	31,840.00	0.25
101	300347	泰格医药	300	31,440.00	0.25
102	01801	信达生物	1,000	29,924.55	0.24
103	300498	温氏股份	1,500	29,445.00	0.24
104	600406	国电南瑞	1,200	29,280.00	0.23
105	01821	ESR	2,000	29,263.53	0.23
106	600436	片仔癀	100	28,846.00	0.23
107	00836	华润电力	2,000	28,513.18	0.23
108	01929	周大福	2,000	28,441.72	0.23
109	600031	三一重工	1,800	28,440.00	0.23
110	600919	江苏银行	3,900	28,431.00	0.23
111	600000	浦发银行	3,900	28,392.00	0.23
112	600016	民生银行	8,100	27,945.00	0.22
113	600570	恒生电子	680	27,512.80	0.22
114	600050	中国联通	6,000	26,880.00	0.21
115	601728	中国电信	6,400	26,816.00	0.21
116	000596	古井贡酒	100	26,690.00	0.21
117	03692	翰森制药	2,000	26,512.25	0.21
118	002460	赣锋锂业	380	26,413.80	0.21
119	300014	亿纬锂能	300	26,370.00	0.21
120	300122	智飞生物	300	26,349.00	0.21
121	600837	海通证券	3,000	26,070.00	0.21
122	00868	信义玻璃	2,000	25,976.29	0.21
123	600585	海螺水泥	900	24,642.00	0.20
124	00322	康师傅控股	2,000	24,618.52	0.20
125	00012	恒基地产	1,000	24,341.61	0.19
126	00288	万洲国际	6,000	24,332.67	0.19
127	01876	百威亚太	1,100	24,122.76	0.19
128	300142	沃森生物	600	24,114.00	0.19
129	603501	韦尔股份	310	23,897.90	0.19
130	002466	天齐锂业	300	23,697.00	0.19
131	000063	中兴通讯	900	23,274.00	0.19
132	601688	华泰证券	1,800	22,932.00	0.18
133	00992	联想集团	4,000	22,903.44	0.18
134	002371	北方华创	100	22,530.00	0.18
135	601225	陕西煤业	1,200	22,296.00	0.18
136	002027	分众传媒	3,300	22,044.00	0.18
137	601669	中国电建	3,100	21,948.00	0.18
138	600104	上汽集团	1,500	21,615.00	0.17

139	601919	中远海控	2,100	21,609.00	0.17
140	600660	福耀玻璃	600	21,042.00	0.17
141	601169	北京银行	4,800	20,688.00	0.17
142	09868	小鹏汽车-W	600	20,554.14	0.16
143	00004	九龙仓集团	1,000	20,500.55	0.16
144	01177	中国生物制药	5,000	20,411.22	0.16
145	300759	康龙化成	300	20,400.00	0.16
146	601211	国泰君安	1,500	20,385.00	0.16
147	002271	东方雨虹	600	20,142.00	0.16
148	06862	海底捞	1,000	20,009.25	0.16
149	603806	福斯特	300	19,932.00	0.16
150	601766	中国中车	3,900	19,929.00	0.16
151	002230	科大讯飞	600	19,698.00	0.16
152	00017	新世界发展	1,000	19,651.94	0.16
153	688012	中微公司	200	19,602.00	0.16
154	601229	上海银行	3,300	19,503.00	0.16
155	000625	长安汽车	1,570	19,326.70	0.15
156	00006	电能实业	500	19,093.65	0.15
157	300316	晶盛机电	300	19,068.00	0.15
158	601100	恒立液压	300	18,945.00	0.15
159	601009	南京银行	1,800	18,756.00	0.15
160	00151	中国旺旺	4,000	18,651.48	0.15
161	002311	海大集团	300	18,519.00	0.15
162	000538	云南白药	340	18,482.40	0.15
163	601390	中国中铁	3,300	18,348.00	0.15
164	000338	潍柴动力	1,800	18,324.00	0.15
165	01038	长江基建集团	500	18,245.04	0.15
166	002459	晶澳科技	300	18,027.00	0.14
167	300763	锦浪科技	100	18,005.00	0.14
168	601985	中国核电	3,000	18,000.00	0.14
169	002410	广联达	300	17,985.00	0.14
170	00881	中升控股	500	17,932.40	0.14
171	600760	中航沈飞	300	17,589.00	0.14
172	00083	信和置业	2,000	17,436.63	0.14
173	06098	碧桂园服务	1,000	17,365.17	0.14
174	002179	中航光电	300	17,328.00	0.14
175	600009	上海机场	300	17,313.00	0.14
176	300661	圣邦股份	100	17,260.00	0.14
177	00762	中国联通	4,000	17,257.98	0.14
178	600019	宝钢股份	3,000	16,770.00	0.13
179	000100	TCL 科技	4,500	16,740.00	0.13
180	603799	华友钴业	300	16,689.00	0.13
181	000661	长春高新	100	16,645.00	0.13

182	601818	光大银行	5,400	16,578.00	0.13
183	01378	中国宏桥	2,500	16,458.50	0.13
184	600999	招商证券	1,200	15,960.00	0.13
185	688036	传音控股	200	15,904.00	0.13
186	600745	闻泰科技	300	15,774.00	0.13
187	002180	纳思达	300	15,567.00	0.12
188	603659	璞泰来	300	15,567.00	0.12
189	000895	双汇发展	600	15,558.00	0.12
190	00968	信义光能	2,000	15,435.71	0.12
191	600905	三峡能源	2,700	15,255.00	0.12
192	002241	歌尔股份	900	15,147.00	0.12
193	600111	北方稀土	600	15,030.00	0.12
194	00268	金蝶国际	1,000	14,953.34	0.12
195	300957	贝泰妮	100	14,924.00	0.12
196	002821	凯莱英	100	14,800.00	0.12
197	600588	用友网络	600	14,502.00	0.12
198	02007	碧桂园	6,000	14,310.19	0.11
199	00270	粤海投资	2,000	14,274.45	0.11
200	01972	太古地产	800	14,177.98	0.11
201	01209	华润万象生活	400	14,167.26	0.11
202	000963	华东医药	300	14,040.00	0.11
203	000776	广发证券	900	13,941.00	0.11
204	00020	商汤-W	7,000	13,881.42	0.11
205	600010	包钢股份	7,200	13,824.00	0.11
206	000799	酒鬼酒	100	13,794.00	0.11
207	600029	南方航空	1,800	13,680.00	0.11
208	00101	恒隆地产	1,000	13,631.30	0.11
209	600188	兖矿能源	400	13,432.00	0.11
210	002709	天赐材料	300	13,158.00	0.11
211	01193	华润燃气	500	13,086.41	0.10
212	300999	金龙鱼	300	13,068.00	0.10
213	002050	三花智控	600	12,732.00	0.10
214	600893	航发动力	300	12,684.00	0.10
215	603392	万泰生物	100	12,670.00	0.10
216	601989	中国重工	3,600	12,564.00	0.10
217	688008	澜起科技	200	12,520.00	0.10
218	00384	中国燃气	1,200	12,177.06	0.10
219	300450	先导智能	300	12,075.00	0.10
220	002001	新和成	640	12,000.00	0.10
221	000166	申万宏源	3,000	11,940.00	0.10
222	00241	阿里健康	2,000	11,880.49	0.09
223	06186	中国飞鹤	2,000	11,862.63	0.09
224	000938	紫光股份	600	11,706.00	0.09



225	601186	中国铁建	1,500	11,595.00	0.09
226	002074	国轩高科	400	11,532.00	0.09
227	601995	中金公司	300	11,439.00	0.09
228	300782	卓胜微	100	11,430.00	0.09
229	001979	招商蛇口	900	11,367.00	0.09
230	00656	复星国际	2,000	11,362.39	0.09
231	002601	龙佰集团	600	11,352.00	0.09
232	300454	深信服	100	11,255.00	0.09
233	00285	比亚迪电子	500	11,210.54	0.09
234	002493	荣盛石化	900	11,070.00	0.09
235	601138	工业富联	1,200	11,016.00	0.09
236	603993	洛阳钼业	2,400	10,920.00	0.09
237	600015	华夏银行	2,100	10,899.00	0.09
238	06969	思摩尔国际	1,000	10,826.43	0.09
239	600196	复星医药	300	10,572.00	0.08
240	002920	德赛西威	100	10,534.00	0.08
241	003816	中国广核	3,900	10,491.00	0.08
242	600741	华域汽车	600	10,398.00	0.08
243	300601	康泰生物	320	10,089.60	0.08
244	00135	昆仑能源	2,000	9,951.03	0.08
245	002648	卫星化学	640	9,920.00	0.08
246	300033	同花顺	100	9,861.00	0.08
247	601800	中国交建	1,200	9,660.00	0.08
248	601111	中国国航	900	9,540.00	0.08
249	688303	大全能源	200	9,536.00	0.08
250	02618	京东物流	700	9,454.37	0.08
251	600346	恒力石化	600	9,318.00	0.07
252	300408	三环集团	300	9,213.00	0.07
253	300413	芒果超媒	300	9,006.00	0.07
254	601633	长城汽车	300	8,886.00	0.07
255	603260	合盛硅业	100	8,294.00	0.07
256	002938	鹏鼎控股	300	8,232.00	0.07
257	000157	中联重科	1,500	8,160.00	0.07
258	002736	国信证券	900	7,992.00	0.06
259	000301	东方盛虹	600	7,824.00	0.06
260	000786	北新建材	300	7,764.00	0.06
261	000876	新希望	600	7,746.00	0.06
262	000768	中航西飞	300	7,635.00	0.06
263	600989	宝丰能源	600	7,242.00	0.06
264	002916	深南电路	100	7,215.00	0.06
265	601066	中信建投	300	7,125.00	0.06
266	09992	泡泡玛特	400	7,081.84	0.06
267	002236	大华股份	600	6,786.00	0.05

268	601238	广汽集团	600	6,618.00	0.05
269	300919	中伟股份	100	6,561.00	0.05
270	000069	华侨城 A	1,200	6,396.00	0.05
271	300433	蓝思科技	600	6,318.00	0.05
272	300628	亿联网络	100	6,059.00	0.05
273	002841	视源股份	100	5,904.00	0.05
274	300979	华利集团	100	5,711.00	0.05
275	002555	三七互娱	300	5,430.00	0.04
276	600018	上港集团	1,000	5,340.00	0.04
277	000708	中信特钢	300	5,148.00	0.04
278	000617	中油资本	900	5,013.00	0.04
279	601319	中国人保	900	4,698.00	0.04
280	601998	中信银行	900	4,482.00	0.04
281	600025	华能水电	600	3,960.00	0.03
282	03799	达利食品	1,000	3,180.04	0.03
283	000877	天山股份	300	2,556.00	0.02
284	001289	龙源电力	100	1,827.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	01918	融创中国	10,000	12,237.80	0.10
2	00813	世茂集团	3,500	4,158.17	0.03
3	03380	龙光集团	2,000	2,233.18	0.02
4	09658	特海国际	100	887.91	0.01
5	06666	恒大物业	23,500	209.92	0.00
6	03333	中国恒大	12,000	107.19	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	00700	腾讯控股	20,447,116.28	163.31
2	600519	贵州茅台	14,516,459.00	115.95
3	300750	宁德时代	9,850,336.00	78.68
4	00005	汇丰控股	8,982,077.25	71.74
5	01299	友邦保险	8,115,439.51	64.82
6	02318	中国平安	3,186,378.93	25.45
7	601318	中国平安	4,647,115.00	37.12
8	03690	美团-W	7,102,049.17	56.73
9	03968	招商银行	2,111,058.36	16.86
10	600036	招商银行	4,983,156.00	39.80
11	00939	建设银行	5,862,969.16	46.83

12	01398	工商银行	3,437,451.07	27.46
13	601398	工商银行	1,500,110.00	11.98
14	00388	香港交易所	3,691,905.60	29.49
15	002594	比亚迪	2,393,049.00	19.11
16	01211	比亚迪股份	993,691.80	7.94
17	601012	隆基绿能	3,378,006.00	26.98
18	000858	五粮液	3,328,361.00	26.58
19	300760	迈瑞医疗	3,097,833.00	24.74
20	000333	美的集团	2,857,696.00	22.82
21	03988	中国银行	2,176,837.75	17.39
22	601988	中国银行	609,684.00	4.87
23	601166	兴业银行	2,730,529.00	21.81
24	00941	中国移动	2,515,875.85	20.09
25	300059	东方财富	2,417,009.00	19.31
26	600809	山西汾酒	2,318,566.00	18.52
27	600900	长江电力	2,246,637.00	17.94
28	002812	恩捷股份	2,234,685.02	17.85
29	002415	海康威视	2,060,907.00	16.46
30	000568	泸州老窖	2,020,650.00	16.14
31	600030	中信证券	2,002,297.00	15.99
32	03328	交通银行	740,410.34	5.91
33	601328	交通银行	1,243,048.00	9.93
34	01810	小米集团-W	1,936,149.75	15.46
35	600887	伊利股份	1,882,494.00	15.04
36	02269	药明生物	1,816,015.11	14.50
37	002475	立讯精密	1,772,997.18	14.16
38	603501	韦尔股份	1,755,953.00	14.03
39	00669	创科实业	1,749,247.51	13.97
40	01288	农业银行	742,200.62	5.93
41	601288	农业银行	962,001.00	7.68
42	603259	药明康德	1,683,938.00	13.45
43	00981	中芯国际	828,103.21	6.61
44	688981	中芯国际	830,809.87	6.64
45	000651	格力电器	1,626,716.00	12.99
46	002714	牧原股份	1,601,960.00	12.80
47	600276	恒瑞医药	1,572,232.44	12.56
48	601888	中国中免	1,564,627.00	12.50
49	000001	平安银行	1,557,096.00	12.44
50	002304	洋河股份	1,463,559.00	11.69
51	00883	中国海洋石油	1,448,978.31	11.57
52	000725	京东方 A	1,446,937.00	11.56
53	002142	宁波银行	1,418,511.00	11.33
54	601899	紫金矿业	1,395,075.00	11.14

55	600309	万华化学	1,374,487.00	10.98
56	00914	海螺水泥	375,304.89	3.00
57	600585	海螺水泥	941,421.00	7.52
58	603986	兆易创新	1,316,522.83	10.52
59	02331	李宁	1,294,211.11	10.34
60	00386	中国石油化工股份	750,708.84	6.00
61	600028	中国石化	520,248.00	4.16
62	000002	万科 A	1,253,279.00	10.01
63	300274	阳光电源	1,244,011.00	9.94
64	300122	智飞生物	1,224,561.00	9.78
65	02601	中国太保	436,185.40	3.48
66	601601	中国太保	783,064.00	6.25
67	002460	赣锋锂业	1,216,080.00	9.71
68	00002	中电控股	1,215,489.17	9.71
69	02628	中国人寿	769,195.30	6.14
70	601628	中国人寿	439,844.00	3.51
71	00857	中国石油股份	703,689.09	5.62
72	601857	中国石油	493,451.00	3.94
73	600438	通威股份	1,153,338.00	9.21
74	09633	农夫山泉	1,148,340.17	9.17
75	300124	汇川技术	1,121,845.00	8.96
76	01024	快手-W	1,114,219.06	8.90
77	00001	长和	1,112,116.82	8.88
78	603288	海天味业	1,107,450.00	8.85
79	01658	邮储银行	579,204.17	4.63
80	601658	邮储银行	527,084.00	4.21
81	002352	顺丰控股	1,081,633.00	8.64
82	002241	歌尔股份	1,056,066.00	8.43
83	00016	新鸿基地产	1,043,894.60	8.34
84	002129	TCL 中环	1,035,263.00	8.27
85	02020	安踏体育	1,023,892.67	8.18
86	600048	保利发展	1,021,467.00	8.16
87	300498	温氏股份	1,017,225.00	8.12
88	300142	沃森生物	1,006,176.00	8.04
89	00003	香港中华煤气	1,002,218.34	8.00
90	02319	蒙牛乳业	998,479.56	7.98
91	002049	紫光国微	993,992.00	7.94
92	600837	海通证券	968,271.00	7.73
93	300015	爱尔眼科	961,723.00	7.68
94	600031	三一重工	961,215.00	7.68
95	601919	中远海控	958,989.00	7.66
96	300347	泰格医药	938,906.00	7.50
97	600436	片仔癀	920,902.00	7.36

98	002709	天赐材料	917,593.00	7.33
99	02388	中银香港	917,182.95	7.33
100	002230	科大讯飞	901,583.00	7.20
101	600000	浦发银行	891,932.00	7.12
102	601088	中国神华	888,770.00	7.10
103	601668	中国建筑	886,637.00	7.08
104	00011	恒生银行	875,873.41	7.00
105	601816	京沪高铁	864,696.75	6.91
106	600016	民生银行	857,654.00	6.85
107	002459	晶澳科技	851,844.00	6.80
108	600406	国电南瑞	851,649.00	6.80
109	06690	海尔智家	97,637.38	0.78
110	600690	海尔智家	747,688.00	5.97
111	600745	闻泰科技	843,338.00	6.74
112	01113	长实集团	841,835.39	6.72
113	002271	东方雨虹	823,974.00	6.58
114	01109	华润置地	821,659.81	6.56
115	002179	中航光电	807,365.00	6.45
116	000063	中兴通讯	807,334.00	6.45
117	00688	中国海外发展	802,098.87	6.41
118	300014	亿纬锂能	799,201.00	6.38
119	603799	华友钴业	792,935.00	6.33
120	02382	舜宇光学科技	776,921.08	6.21
121	000538	云南白药	762,608.00	6.09
122	06160	百济神州	748,886.85	5.98
123	601688	华泰证券	747,368.00	5.97
124	600104	上汽集团	746,775.00	5.96
125	000100	TCL 科技	725,915.00	5.80
126	600919	江苏银行	707,350.00	5.65
127	02313	申洲国际	687,411.77	5.49
128	002027	分众传媒	680,778.00	5.44
129	002371	北方华创	678,651.00	5.42
130	000338	潍柴动力	677,660.00	5.41
131	601985	中国核电	667,171.67	5.33
132	601211	国泰君安	661,072.00	5.28
133	00027	银河娱乐	650,396.45	5.19
134	002001	新 和 成	645,320.80	5.15
135	01093	石药集团	644,559.85	5.15
136	02688	新奥能源	636,995.63	5.09
137	06098	碧桂园服务	633,033.07	5.06
138	601169	北京银行	619,388.00	4.95
139	601229	上海银行	617,087.00	4.93
140	600660	福耀玻璃	616,558.00	4.92

141	600050	中国联通	611,480.00	4.88
142	00066	港铁公司	600,847.89	4.80
143	601766	中国中车	595,738.00	4.76
144	300450	先导智能	594,362.00	4.75
145	002311	海大集团	591,106.00	4.72
146	00267	中信股份	588,305.98	4.70
147	000768	中航西飞	576,134.00	4.60
148	00960	龙湖集团	567,270.57	4.53
149	600019	宝钢股份	560,595.00	4.48
150	00006	电能实业	557,535.39	4.45
151	601390	中国中铁	550,981.00	4.40
152	000895	双汇发展	537,145.00	4.29
153	000661	长春高新	535,661.00	4.28
154	00291	华润啤酒	529,124.29	4.23
155	00968	信义光能	518,228.26	4.14
156	00175	吉利汽车	517,632.12	4.13
157	000776	广发证券	513,553.00	4.10
158	600570	恒生电子	509,814.00	4.07
159	000166	申万宏源	509,594.00	4.07
160	600893	航发动力	507,404.00	4.05
161	601225	陕西煤业	495,746.00	3.96
162	600999	招商证券	495,389.00	3.96
163	601818	光大银行	493,849.00	3.94
164	600905	三峡能源	488,846.00	3.90
165	600760	中航沈飞	482,817.00	3.86
166	002410	广联达	481,251.00	3.84
167	000625	长安汽车	481,185.00	3.84
168	300782	卓胜微	478,369.00	3.82
169	601100	恒立液压	473,415.00	3.78
170	300896	爱美客	451,461.00	3.61
171	01177	中国生物制药	450,925.07	3.60
172	06618	京东健康	450,448.84	3.60
173	01928	金沙中国有限公司	449,611.84	3.59
174	02007	碧桂园	446,627.51	3.57
175	601009	南京银行	438,686.00	3.50
176	00322	康师傅控股	433,380.79	3.46
177	002821	凯莱英	432,283.00	3.45
178	01997	九龙仓置业	429,079.09	3.43
179	001979	招商蛇口	417,184.00	3.33
180	600588	用友网络	416,125.00	3.32
181	600196	复星医药	412,271.00	3.29
182	600009	上海机场	409,104.00	3.27
183	02618	京东物流	396,983.83	3.17

184	601989	中国重工	396,170.00	3.16
185	00868	信义玻璃	396,144.90	3.16
186	00992	联想集团	391,196.28	3.12
187	000938	紫光股份	382,588.00	3.06
188	002493	荣盛石化	377,300.00	3.01
189	688111	金山办公	375,968.83	3.00
190	300759	康龙化成	373,040.00	2.98
191	00288	万洲国际	370,976.03	2.96
192	003816	中国广核	367,870.00	2.94
193	01929	周大福	366,250.38	2.93
194	000876	新希望	363,157.00	2.90
195	000792	盐湖股份	359,807.00	2.87
196	601138	工业富联	356,935.00	2.85
197	600741	华域汽车	353,529.00	2.82
198	002050	三花智控	352,494.00	2.82
199	00151	中国旺旺	347,990.13	2.78
200	300408	三环集团	346,509.00	2.77
201	603993	洛阳钼业	344,365.00	2.75
202	000963	华东医药	342,777.00	2.74
203	688012	中微公司	338,616.25	2.70
204	000157	中联重科	334,582.00	2.67
205	002236	大华股份	330,817.00	2.64
206	300595	欧普康视	330,348.00	2.64
207	300601	康泰生物	327,200.00	2.61
208	601186	中国铁建	321,016.00	2.56
209	601633	长城汽车	320,730.00	2.56
210	600346	恒力石化	320,220.00	2.56
211	600015	华夏银行	319,069.00	2.55
212	600029	南方航空	316,930.00	2.53
213	600989	宝丰能源	315,774.00	2.52
214	000301	东方盛虹	313,502.00	2.50
215	00017	新世界发展	313,428.81	2.50
216	600547	山东黄金	313,124.00	2.50
217	01876	百威亚太	312,853.86	2.50
218	688008	澜起科技	306,562.81	2.45
219	00012	恒基地产	305,392.45	2.44
220	002938	鹏鼎控股	304,710.00	2.43
221	002601	龙佰集团	304,207.00	2.43
222	601800	中国交建	303,242.00	2.42
223	01801	信达生物	298,402.79	2.38
224	300413	芒果超媒	298,388.00	2.38
225	00881	中升控股	297,629.92	2.38
226	002736	国信证券	297,176.00	2.37

227	000596	古井贡酒	295,433.00	2.36
228	000786	北新建材	292,745.00	2.34
229	00004	九龙仓集团	292,258.93	2.33
230	00083	信和置业	291,975.40	2.33
231	002602	世纪华通	290,327.00	2.32
232	601336	新华保险	289,373.00	2.31
233	002466	天齐锂业	288,653.00	2.31
234	688036	传音控股	288,102.00	2.30
235	02015	理想汽车-W	286,956.21	2.29
236	603392	万泰生物	279,415.00	2.23
237	601066	中信建投	278,682.00	2.23
238	601901	方正证券	278,566.00	2.22
239	01038	长江基建集团	270,398.09	2.16
240	300999	金龙鱼	268,765.00	2.15
241	000425	徐工机械	266,572.00	2.13
242	601360	三六零	260,131.00	2.08
243	06186	中国飞鹤	257,865.36	2.06
244	00101	恒隆地产	257,857.31	2.06
245	300628	亿联网络	256,443.00	2.05
246	002841	视源股份	255,876.00	2.04

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。

#### 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	00700	腾讯控股	21,046,354.88	168.10
2	300750	宁德时代	9,885,753.00	78.96
3	00005	汇丰控股	9,012,891.05	71.99
4	01299	友邦保险	8,270,185.46	66.06
5	03690	美团-W	8,003,151.42	63.92
6	00939	建设银行	5,789,853.42	46.24
7	00388	香港交易所	3,689,089.60	29.47
8	002594	比亚迪	2,478,568.54	19.80
9	01211	比亚迪股份	1,081,553.23	8.64
10	01398	工商银行	3,398,650.55	27.15
11	601398	工商银行	15,808.00	0.13
12	02318	中国平安	3,168,804.86	25.31
13	601318	中国平安	104,832.00	0.84
14	000858	五粮液	3,216,516.00	25.69
15	300760	迈瑞医疗	3,029,560.00	24.20
16	000333	美的集团	2,774,681.00	22.16
17	00941	中国移动	2,496,459.49	19.94
18	300059	东方财富	2,426,163.00	19.38



19	002812	恩捷股份	2,156,807.00	17.23
20	03988	中国银行	2,141,664.47	17.11
21	601988	中国银行	12,825.00	0.10
22	03968	招商银行	2,101,526.05	16.79
23	600036	招商银行	40,664.00	0.32
24	02269	药明生物	2,068,558.80	16.52
25	000568	泸州老窖	1,989,802.00	15.89
26	01810	小米集团-W	1,980,729.34	15.82
27	002415	海康威视	1,948,179.00	15.56
28	00669	创科实业	1,708,343.29	13.64
29	002475	立讯精密	1,703,515.00	13.61
30	002714	牧原股份	1,611,244.04	12.87
31	000651	格力电器	1,565,367.00	12.50
32	000001	平安银行	1,538,433.65	12.29
33	00883	中国海洋石油	1,482,181.73	11.84
34	002304	洋河股份	1,434,992.00	11.46
35	002142	宁波银行	1,418,603.00	11.33
36	000725	京东方 A	1,390,220.00	11.10
37	02331	李宁	1,340,196.08	10.70
38	000002	万科 A	1,316,137.00	10.51
39	300122	智飞生物	1,239,441.00	9.90
40	002460	赣锋锂业	1,199,838.59	9.58
41	09633	农夫山泉	1,178,647.04	9.41
42	300274	阳光电源	1,151,642.00	9.20
43	300124	汇川技术	1,138,859.00	9.10
44	00002	中电控股	1,121,586.12	8.96
45	01024	快手-W	1,120,461.17	8.95
46	00001	长和	1,077,909.09	8.61
47	002241	歌尔股份	1,048,329.00	8.37
48	300142	沃森生物	1,043,442.00	8.33
49	300498	温氏股份	1,037,228.00	8.28
50	002352	顺丰控股	1,012,266.00	8.09
51	00016	新鸿基地产	1,011,861.85	8.08
52	02020	安踏体育	993,508.70	7.94
53	002129	TCL 中环	984,555.00	7.86
54	300015	爱尔眼科	967,654.00	7.73
55	02319	蒙牛乳业	956,783.64	7.64
56	300347	泰格医药	935,579.42	7.47
57	002709	天赐材料	923,262.00	7.37
58	002049	紫光国微	899,239.00	7.18
59	600436	片仔癀	898,770.00	7.18
60	00003	香港中华煤气	897,317.45	7.17
61	002230	科大讯飞	878,695.00	7.02

62	02388	中银香港	869,461.54	6.94
63	300014	亿纬锂能	856,967.00	6.84
64	01109	华润置地	844,986.06	6.75
65	01113	长实集团	840,936.69	6.72
66	00011	恒生银行	829,687.51	6.63
67	002459	晶澳科技	824,516.00	6.59
68	00981	中芯国际	807,562.40	6.45
69	688981	中芯国际	8,646.00	0.07
70	002271	东方雨虹	811,277.00	6.48
71	06160	百济神州	801,739.83	6.40
72	00688	中国海外发展	800,749.67	6.40
73	000063	中兴通讯	799,352.00	6.38
74	002179	中航光电	778,979.00	6.22
75	00386	中国石油化工股份	757,969.44	6.05
76	600028	中国石化	7,204.00	0.06
77	02628	中国人寿	750,875.90	6.00
78	601628	中国人寿	11,252.00	0.09
79	03328	交通银行	715,961.81	5.72
80	601328	交通银行	42,780.00	0.34
81	000538	云南白药	754,106.00	6.02
82	01288	农业银行	730,737.80	5.84
83	601288	农业银行	21,590.00	0.17
84	02382	舜宇光学科技	739,830.09	5.91
85	00857	中国石油股份	721,854.88	5.77
86	601857	中国石油	16,256.00	0.13
87	000100	TCL 科技	704,346.00	5.63
88	00027	银河娱乐	702,888.77	5.61
89	02313	申洲国际	681,715.82	5.44
90	02688	新奥能源	670,217.64	5.35
91	002027	分众传媒	666,154.00	5.32
92	000338	潍柴动力	659,982.00	5.27
93	06098	碧桂园服务	636,183.46	5.08
94	01093	石药集团	632,737.74	5.05
95	002001	新和成	606,514.36	4.84
96	002371	北方华创	598,283.00	4.78
97	300450	先导智能	592,401.52	4.73
98	01658	邮储银行	570,156.59	4.55
99	601658	邮储银行	11,928.00	0.10
100	00066	港铁公司	579,601.56	4.63
101	000768	中航西飞	571,160.00	4.56
102	002311	海大集团	569,779.00	4.55
103	00267	中信股份	558,407.61	4.46
104	00960	龙湖集团	556,021.07	4.44

105	00006	电能实业	535,294.88	4.28
106	000895	双汇发展	521,925.00	4.17
107	00175	吉利汽车	521,584.55	4.17
108	000776	广发证券	508,663.00	4.06
109	00968	信义光能	501,334.29	4.00
110	000625	长安汽车	495,129.00	3.95
111	06618	京东健康	493,417.75	3.94
112	000166	申万宏源	492,566.00	3.93
113	000661	长春高新	490,131.00	3.91
114	002410	广联达	489,847.00	3.91
115	02007	碧桂园	481,046.50	3.84
116	01177	中国生物制药	476,494.25	3.81
117	001979	招商蛇口	472,041.00	3.77
118	01928	金沙中国有限公司	467,793.08	3.74
119	00291	华润啤酒	457,573.75	3.65
120	002493	荣盛石化	439,967.00	3.51
121	01997	九龙仓置业	439,069.80	3.51
122	300782	卓胜微	438,470.00	3.50
123	02601	中国太保	420,344.29	3.36
124	601601	中国太保	16,300.00	0.13
125	002821	凯莱英	436,004.00	3.48
126	02618	京东物流	422,167.64	3.37
127	300896	爱美客	419,440.00	3.35
128	00322	康师傅控股	409,783.78	3.27
129	00914	海螺水泥	386,529.16	3.09
130	600585	海螺水泥	19,569.00	0.16
131	00992	联想集团	388,714.18	3.10
132	00868	信义玻璃	384,252.55	3.07
133	300759	康龙化成	377,367.00	3.01
134	000938	紫光股份	370,895.00	2.96
135	000876	新希望	370,616.00	2.96
136	000069	华侨城 A	361,182.53	2.88
137	00288	万洲国际	359,705.19	2.87
138	002050	三花智控	359,010.00	2.87
139	300601	康泰生物	356,611.00	2.85
140	01929	周大福	354,435.04	2.83
141	003816	中国广核	349,599.00	2.79
142	300595	欧普康视	345,040.60	2.76
143	000963	华东医药	342,757.00	2.74
144	300408	三环集团	333,120.00	2.66
145	000157	中联重科	321,581.40	2.57
146	688111	金山办公	321,268.59	2.57
147	002236	大华股份	316,389.00	2.53

148	603288	海天味业	313,272.40	2.50
149	00151	中国旺旺	310,749.71	2.48
150	01801	信达生物	307,659.07	2.46
151	000301	东方盛虹	303,947.00	2.43
152	00017	新世界发展	303,792.67	2.43
153	01876	百威亚太	300,472.59	2.40
154	002938	鹏鼎控股	300,014.00	2.40
155	000786	北新建材	298,453.00	2.38
156	300413	芒果超媒	297,916.00	2.38
157	00083	信和置业	296,031.27	2.36
158	002601	龙佰集团	294,783.00	2.35
159	00012	恒基地产	293,022.11	2.34
160	688012	中微公司	292,563.30	2.34
161	002602	世纪华通	289,640.00	2.31
162	002736	国信证券	287,188.00	2.29
163	000792	盐湖股份	285,638.00	2.28
164	00881	中升控股	284,850.86	2.28
165	603392	万泰生物	284,341.45	2.27
166	00004	九龙仓集团	280,541.90	2.24
167	000425	徐工机械	267,217.00	2.13
168	688008	澜起科技	264,294.00	2.11
169	000596	古井贡酒	260,027.00	2.08
170	300999	金龙鱼	258,957.00	2.07
171	01038	长江基建集团	255,576.83	2.04
172	00101	恒隆地产	254,936.57	2.04
173	688036	传音控股	252,045.26	2.01
174	300628	亿联网络	251,925.60	2.01

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。

#### 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	296,084,915.36
卖出股票收入（成交）总额	205,366,620.11

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

注：本基金本报告期末未持有债券。

**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 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 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，中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。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	48,495.94
2	应收清算款	-
3	应收股利	782.73
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	49,278.67
---	----	-----------

#### 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债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	01918	融创中国	12,237.80	0.10	重大事项停牌
2	00813	世茂集团	4,158.17	0.03	重大事项停牌
3	06666	恒大物业	209.92	0.00	重大事项停牌

## § 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

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 (%)
197	63,203.35	10,809,160.00	86.81	1,641,900.00	13.19

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	浦银安盛智选 11 号单一资产管理计划	6,000,000.00	48.19
2	福州经济技术开发区数为私募基金管理有限公司-数为对冲套利 5 号私募证券投资基金	2,556,100.00	20.53
3	广发证券股份有限公司	1,157,900.00	9.30
4	中信证券股份有限公司	451,902.00	3.63
5	戚艳妮	406,000.00	3.26
6	方正证券股份有限公司	300,100.00	2.41
7	钱中明	265,100.00	2.13

8	上海易则投资管理有限公司-易则源识一号私募证券投资基金	200,000.00	1.61
9	长江证券股份有限公司	143,158.00	1.15
10	马志腾	101,000.00	0.81

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022年3月8日）基金份额总额	243,451,060.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	60,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	291,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	12,451,060.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

2022年12月22日至2023年1月20日，基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并审议通过了《关于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终止基金合同并终止上市有关事项的议案》，详见本基金管理人于2022年12月17日发布的《关于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以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》及其后续公告。

### 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：

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 40,000 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

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人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。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 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	4	501,451,535.47	100.00	382,766.74	100.00	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

#### (1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

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

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；



佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期新增海通证券交易单元。

### 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	-	-	-	-	-	-

### 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	浦银安盛基金管理有限公司关于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新增网下现金认购、网下股票认购发售代理机构的公告	报刊及规定网站	2022 年 1 月 21 日
2	浦银安盛基金管理有限公司关于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新增网下股票认购发售代理机构的公告	报刊及规定网站	2022 年 2 月 15 日
3	浦银安盛基金管理有限公司关于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开展直销柜台认购费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2022 年 2 月 16 日
4	浦银安盛基金管理有限公司关于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新增网下现金认购发售代理机构的公告	报刊及规定网站	2022 年 2 月 22 日
5	浦银安盛基金管理有限公司关于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新增网下现金认购、网下股票认购发售代理机构	报刊及规定网站	2022 年 2 月 22 日

	的公告		
6	关于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调整募集期限的公告	报刊及规定网站	2022 年 2 月 24 日
7	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基金合同生效公告	报刊及规定网站	2022 年 3 月 9 日
8	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	2022 年 3 月 10 日
9	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开放日常申购、赎回业务公告	报刊及规定网站	2022 年 3 月 15 日
10	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上市交易公告书	报刊及规定网站	2022 年 3 月 15 日
11	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上市交易提示性公告	报刊及规定网站	2022 年 3 月 18 日
12	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基金产品资料概要更新	规定网站	2022 年 3 月 18 日
13	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 3 月 29 日
14	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 4 月 13 日
15	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 4 月 26 日
16	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 5 月 6 日
17	关于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新增银河证券为一级交易商代理机构的公告	报刊及规定网站	2022 年 5 月 10 日
18	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 6 月 29 日
19	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 2022 年第 2 季度报告	规定网站	2022 年 7 月 21 日

20	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 8 月 25 日
21	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 2022 年中期报告	规定网站	2022 年 8 月 31 日
22	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 9 月 27 日
23	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 2022 年第 3 季度报告	规定网站	2022 年 10 月 26 日
24	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 基金暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 11 月 2 日
25	浦银安盛基金管理有限公司关于调整长期停牌股票估值方法的公告	报刊及规定网站	2022 年 11 月 5 日
26	关于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以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	报刊及规定网站	2022 年 12 月 17 日
27	关于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以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	报刊及规定网站	2022 年 12 月 19 日
28	关于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以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	报刊及规定网站	2022 年 12 月 20 日
29	关于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暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2022 年 12 月 23 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220419-20220421, 20221230-20221231	0.00	37,891,975.00	35,335,875.00	2,556,100.00	20.53

	2	20220422-20220613	0.00	28,107,404.00	28,107,404.00	0.00	0.00
	3	20220613-20220818	0.00	12,000,000.00	12,000,000.00	0.00	0.00
	4	20220624-20220626, 20220818, 20220824-20220925, 20221010, 20221104-20221201, 20221208-20221211	7,800,000.00	43,473,879.00	50,821,977.00	451,902.00	3.63
	5	20220324-20220325, 20220406, 20220610-20220612, 20220614-20220619, 20221010-20221011	7,000,000.00	88,768,404.00	95,468,304.00	300,100.00	2.41
	6	20220318-20220325	0.00	69,000,033.00	69,000,033.00	0.00	0.00
	7	20220819-20221009	0.00	7,660,000.00	7,660,000.00	0.00	0.00
	8	20220926-20221129	0.00	12,287,700.00	12,287,700.00	0.00	0.00
	9	20221202-20221231	0.00	6,000,000.00	-	6,000,000.00	48.19
个人	1	20220407-20220418	0.00	39,088,504.00	39,088,504.00	0.00	0.00
	2	20221115	0.00	54,703,900.00	54,703,900.00	0.00	0.00

## 产品特有风险

基金管理人提示投资者注意：当特定的机构投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。

## 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募集的文件
- 2、 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基金合同
- 3、 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招募说明书
- 4、 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

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 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

2023 年 3 月 31 日