

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 年 4 月 30 日起至 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	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§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.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
§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的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18

6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
§7 投资组合报告.....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	44
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	60
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.....	60
7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	60
7.8 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.....	60
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.....	61
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	61
7.12 投资组合报告附注.....	61
§8 基金份额持有人信息.....	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.4 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的情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	66
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	67

§11 影响投资者决策的其他重要信息	68
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	68
§12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF
场内简称	浦银 MSCI
基金主代码	515780
交易代码	515780
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 4 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	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	398,785,155.00 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	2020-05-29

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	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即 MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。
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。

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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	顾佳	许俊
	联系电话	021-23212888	010-66594319
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	ficd@bankofchina.com
客户服务电话		021-33079999 或	95566

	400-8828-999	
传真	021-23212985	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200020	100818
法定代表人	谢伟	刘连舸

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(2020年4月30日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	11,787,293.90
本期利润	45,274,323.74
加权平均基金份额本期利润	0.0912
本期加权平均净值利润率	8.93%
本期基金份额净值增长率	9.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	10,719,267.52
期末可供分配基金份额利润	0.0269
期末基金资产净值	437,516,729.49
期末基金份额净值	1.0971
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	9.71%

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

5、本基金《基金合同》2020年4月30日生效，至报告期末，合同成立未满一年。

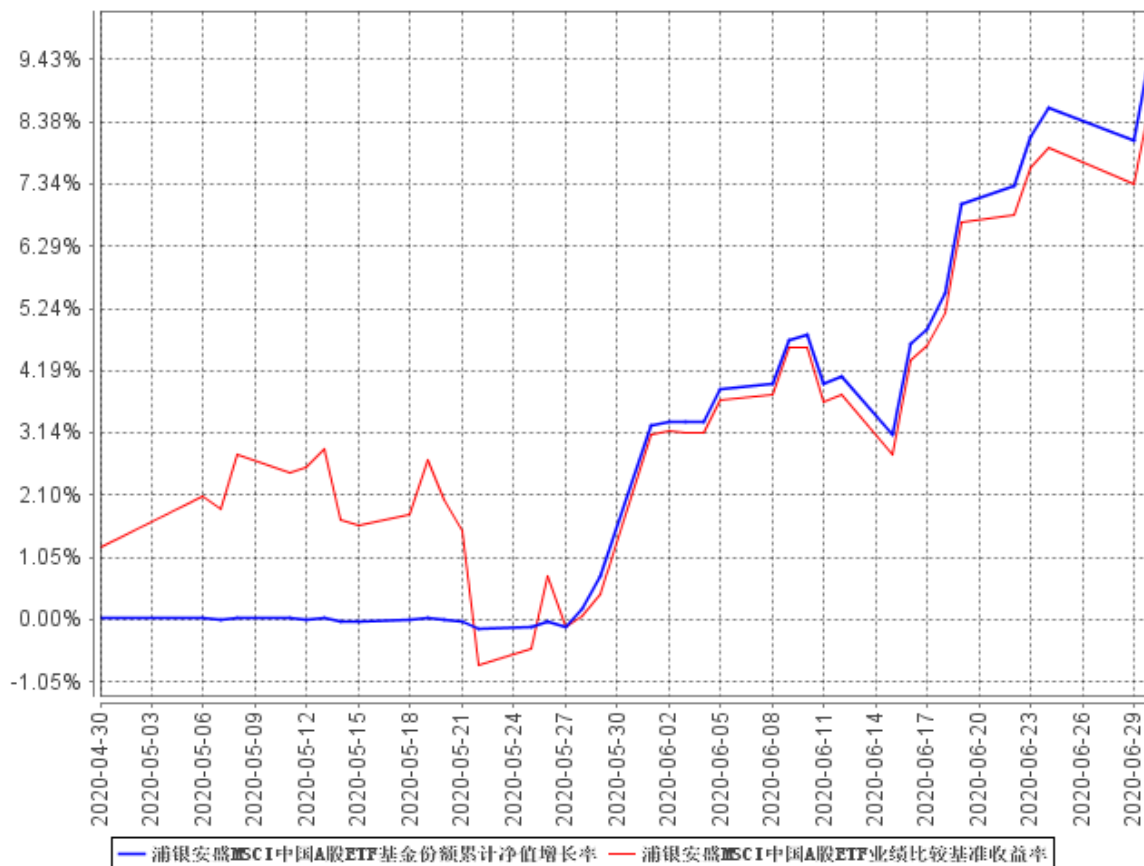
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	8.93%	0.83%	8.40%	0.87%	0.53%	-0.04%
自基金合同生效起至今	9.71%	0.63%	8.87%	0.88%	0.84%	-0.25%

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 MSCI 中国 A 股 ETF 基金份额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 2020 年 4 月 30 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 2020 年 4 月 30 日至 2020 年 10 月 29 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2020 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 62 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、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、浦银安盛季季添利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、浦银安盛月月盈定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放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、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、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、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金。

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子系统、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、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈士俊	公司指数及量化投资部 总	2020 年 4 月 30 日	-	19	陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001 年至 2003 年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员 2 年；

	监，公司职工监事，公司旗下指数与量化投资部基金经理。				2003 年至 2007 年 10 月在银河基金管理有限公司工作 4 年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007 年 10 月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于 2010 年 12 月起兼任浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。2012 年 3 月兼任本公司职工监事。2012 年 5 月起，兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金经理。2017 年 4 月起，兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018 年 9 月起，兼任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019 年 1 月起，兼任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020 年 4 月起，兼任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金及浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 6 月起，兼任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
高钢杰	公司旗下部分基金的基金经理。	2020 年 6 月 4 日	-	10	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。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年上半年，新冠疫情爆发后在世界多个国家持续蔓延，全球确诊人数持续增加，中国率先控制住疫情并推动复工复产，海外主流经济体也积极跟进。货币政策、财政政策整体较为宽松，助力全球经济逐步走向复苏。A 股市场主要指数探底回升，波动水平明显上升。

在投资策略方面，作为投资于 MSCI 中国 A 股人民币指数的被动型投资产品，本基金采取完全复制指数的投资策略，严格控制每日基金净值与业绩基准波动的偏差，使基金回报紧密跟踪目标指数的收益，降低跟踪偏离度。本基金以获取指数长期增长收益为宗旨，跟踪误差较小，较好地实现了基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0971 元；本报告期基金份额净值增长率为 9.71%，业绩比较基准收益率为 8.87%。

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，我们认为国内经济复苏将会持续，但复苏力度取决于多方面的因素，包括货币政策是否会边际收紧、中美贸易摩擦的发展态势、新冠病毒疫苗是否能够更大范围地被应用等。整体上，在货币政策相对宽松的大背景下，A 股市场有望继续震荡上行。

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副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任，当存有异议时，托管银行有责任要求基金管理公司作出合理解释，通过积极商讨达成一致意见。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司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》第十八部分第三条约定，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，每次收益分配比例由基金管理人根据上述原则确定，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

本基金报告期内未进行利润分配。

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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,601,344.56	-
结算备付金		5,823,538.90	-
存出保证金		271,648.68	-
交易性金融资产	6.4.7.2	421,278,462.17	-
其中：股票投资		421,196,262.17	-
基金投资		-	-
债券投资		82,200.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		446,208.90	-
应收利息	6.4.7.5	3,831.81	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		440,425,035.02	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		2,194,334.66	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		56,048.06	-
应付托管费		18,682.69	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	551,713.66	-
应交税费		0.37	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	87,526.09	-
负债合计		2,908,305.53	-
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	398,785,155.00	-
未分配利润	6.4.7.10	38,731,574.49	-
所有者权益合计		437,516,729.49	-
负债和所有者权益总计		440,425,035.02	-

注：1. 报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0971 元，基金份额总额 398,785,155.00 份。

2. 本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020年4月30日(基 金合同生效日)至 2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年6月30日
一、收入		46,240,753.26	-
1.利息收入		369,093.54	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	307,692.97	-
债券利息收入		7.30	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		61,393.27	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,102,448.03	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,076,076.83	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,026,371.20	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	33,487,029.84	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填		-	-

列)			
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	282,181.85	-
减:二、费用		966,429.52	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	126,482.09	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,160.69	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	708,815.45	-
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.04	-
7. 其他费用	6.4.7.20	88,971.25	-
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		45,274,323.74	-
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		45,274,323.74	-

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期:2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	554,785,155.00	-	554,785,155.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,274,323.74	45,274,323.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-156,000,000.00	-6,542,749.25	-162,542,749.25
其中:1.基金申购款	24,000,000.00	1,328,930.39	25,328,930.39
2.基金赎回款	-180,000,000.00	-7,871,679.64	-187,871,679.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金	-	-	-

净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	398,785,155.00	38,731,574.49	437,516,729.49
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 郁蓓华 _____ 郁蓓华 _____ 钱琨
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛 MSCI 中国 A 股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[2019]1746号《关于准予浦银安盛 MSCI 中国 A 股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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 554,709,330.00 元(含募集股票市值),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(2020)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 554,785,155.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 75,825.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《浦银安盛 MSCI 中国 A 股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[2020]141 号核准,本基金 554,785,155.00 份基金份额于 2020 年 5 月 29 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 MSCI 中国 A 股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(即 MSCI 中国 A 股人民币指数)的成份股、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成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、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规定)。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,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即 MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

人民币

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

6.4.4.10 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。

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

6.4.4.11 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，若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内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[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	12,601,344.56
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	12,601,344.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	387,709,232.33	421,196,262.17	33,487,029.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	82,200.00	82,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	82,200.00	82,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	387,791,432.33	421,278,462.17	33,487,029.84

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

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

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,081.28
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,620.60
应收债券利息	7.63
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

应收出借证券利息	-
其他	122.30
合计	3,831.81

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	551,713.66
银行间市场应付交易费用	-
合计	551,713.66

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	45,365.40
应付指数使用费	42,160.69
合计	87,526.09

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	554,785,155.00	554,785,155.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-180,000,000.00	-180,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-

本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	398,785,155.00	398,785,155.00

注：1. 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2. 本基金自 2020 年 3 月 20 日至 2020 年 4 月 24 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 554,709,330.00 元，折合为 554,709,330.00 份基金份额。根据《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金》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 75,825.00 元在本基金成立后，折合为 75,825.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	11,787,293.90	33,487,029.84	45,274,323.74
本期基金份额交易产生的变动数	-1,068,026.38	-5,474,722.87	-6,542,749.25
其中：基金申购款	347,787.85	981,142.54	1,328,930.39
基金赎回款	-1,415,814.23	-6,455,865.41	-7,871,679.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,719,267.52	28,012,306.97	38,731,574.49

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	143,905.34
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	163,433.07
其他	354.56
合计	307,692.97

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,906,777.63
股票投资收益——赎回差价收入	3,169,299.20
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	9,076,076.83

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	92,589,156.58
减：卖出股票成本总额	86,682,378.95
买卖股票差价收入	5,906,777.63

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	187,871,679.64
减：现金支付赎回款总额	79,858,017.64
减：赎回股票成本总额	104,844,362.80
赎回差价收入	3,169,299.20

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金在本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金在本报告期间无债券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金在本报告期间无债券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,026,371.20
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	3,026,371.20

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	33,487,029.84
——股票投资	33,487,029.84
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	33,487,029.84

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	282,181.85
合计	282,181.85

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

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

转出基金的基金资产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
交易所市场交易费用	708,815.45
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	708,815.45

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
审计费用	15,121.80
信息披露费	30,243.60
证券出借违约金	-
银行费用	989.65
指数使用费	42,160.69
其他费用	455.51
合计	88,971.25

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	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

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

本基金本报告期内未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金在本报告期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

本基金在本报告期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

本基金在本报告期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

本基金在本报告期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 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付	126,482.09	-

的管理费		
其中：支付销售机构的客户维护费	572.33	-

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 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 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
	2020 年 4 月 30 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,160.69	-

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金在本报告期间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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金《基金合同》生效日为 2020 年 04 月 30 日，无上年度可比期间。

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

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 2020 年 04 月 30 日，无上年度末可比期间。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2020 年 4 月 30 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		2019 年 1 月 1 日至 2019 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
中国银行	12,601,344.56	143,905.34	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本基金在本报告期间未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在本报告期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金在本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688568	中科星图	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 8 日	新股及科创板锁定	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 8 日	新股及科创板锁定	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 7 日	新股及科创板锁定	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾	2020 年	2020	新股及	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-

	量子	6月30日	2020年7月9日	科创板锁定						
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股及科创板锁定	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股及科创板锁定	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年7月9日	新股流通受限	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金主要投资于标的指数(即 MSCI 中国 A 股人民币指数)的成份股、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成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、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规

定)。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，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即 MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险控制委员会、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、合规及审计委员会、督察长。

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

本基金管理人设立的风险控制委员会是公司经营层面负责风险管理的最高权利机构，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。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人上海银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	82,200.00	-
未评级	-	-
合计	82,200.00	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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。

于 2020 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易, 部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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 2020 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 2020 年 6 月 30 日, 本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允

价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有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、存出保证金和买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	12,601,344.56	-	-	-	12,601,344.56
结算备付金	5,823,538.90	-	-	-	5,823,538.90
存出保证金	271,648.68	-	-	-	271,648.68
交易性金融资产	-	-	82,200.00	421,196,262.17	421,278,462.17
应收证券清算款	-	-	-	446,208.90	446,208.90
应收利息	-	-	-	3,831.81	3,831.81
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	18,696,532.14	-	82,200.00	421,646,302.88	440,425,035.02
负债					
应付证券清算款	-	-	-	2,194,334.66	2,194,334.66
应付管理人	-	-	-	56,048.06	56,048.06

报酬					
应付托管费	-	-	-	18,682.69	18,682.69
应付交易费用	-	-	-	551,713.66	551,713.66
应交税费	-	-	-	0.37	0.37
其他负债	-	-	-	87,526.09	87,526.09
负债总计	-	-	-	2,908,305.53	2,908,305.53
利率敏感度缺口	18,696,532.14	-	-82,200.00	418,737,997.35	437,516,729.49
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
资产总计	-	-	-	-	-
负债					
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度缺口	-	-	-	-	-

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	-		
分析	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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率上升 25 基点	-1,180.48	-
市场利率下降 25 基点	1,200.80		

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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪 MSCI 中国 A 股人民币指数，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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的股票投资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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	421,196,262.17	96.27	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	421,196,262.17	96.27	-	-

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 500 基点		11,542,658.07
业绩比较基准下降 500 基点		-11,542,658.07	-

§ 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	421,196,262.17	95.63
	其中：股票	421,196,262.17	95.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	82,200.00	0.02
	其中：债券	82,200.00	0.02
	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	18,424,883.46	4.18
8	其他各项资产	721,689.39	0.16
9	合计	440,425,035.02	100.00

注：此处股票投资含可退替代款估值增值 5.60 元。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	6,963,933.00	1.59
B	采矿业	10,347,696.00	2.37
C	制造业	216,246,356.46	49.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,288,158.80	2.35
E	建筑业	8,526,593.00	1.95
F	批发和零售业	6,689,805.78	1.53
G	交通运输、仓储和邮政业	11,258,019.00	2.57
H	住宿和餐饮业	486,873.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,319,547.60	5.33
J	金融业	90,713,139.56	20.73
K	房地产业	15,348,029.04	3.51
L	租赁和商务服务业	6,160,163.00	1.41
M	科学研究和技术服务业	3,712,048.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	337,792.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	592,185.00	0.14
Q	卫生和社会工作	5,333,837.00	1.22
R	文化、体育和娱乐业	3,658,192.30	0.84
S	综合	272,945.00	0.06
	合计	420,255,313.54	96.05

7.2.2 期末积极投资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	采掘业	-	-
C	制造业	661,123.14	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	190,731.77	0.04
J	金融业	76,321.80	0.02
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	940,943.03	0.22

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	16,703	24,434,484.64	5.58
2	601318	中国平安	141,900	10,131,660.00	2.32
3	600036	招商银行	270,171	9,110,166.12	2.08
4	000858	五粮液	50,800	8,692,896.00	1.99
5	600276	恒瑞医药	69,727	6,435,802.10	1.47
6	600900	长江电力	288,000	5,454,720.00	1.25
7	300750	宁德时代	29,100	5,073,876.00	1.16
8	002475	立讯精密	91,668	4,707,151.80	1.08
9	603288	海天味业	35,240	4,383,856.00	1.00
10	601166	兴业银行	272,200	4,295,316.00	0.98
11	300760	迈瑞医疗	13,300	4,065,810.00	0.93
12	600000	浦发银行	381,300	4,034,154.00	0.92
13	002714	牧原股份	48,920	4,011,440.00	0.92
14	601888	中国中免	25,600	3,943,168.00	0.90
15	002415	海康威视	122,000	3,702,700.00	0.85
16	601398	工商银行	706,100	3,516,378.00	0.80
17	000002	万科 A	127,300	3,327,622.00	0.76
18	601288	农业银行	975,400	3,296,852.00	0.75
19	000001	平安银行	253,900	3,249,920.00	0.74
20	600030	中信证券	128,900	3,107,779.00	0.71
21	600585	海螺水泥	52,400	2,772,484.00	0.63
22	601328	交通银行	514,000	2,636,820.00	0.60
23	600016	民生银行	464,500	2,633,715.00	0.60
24	603259	药明康德	27,200	2,627,520.00	0.60
25	601668	中国建筑	549,500	2,621,115.00	0.60
26	600887	伊利股份	80,000	2,490,400.00	0.57
27	000661	长春高新	5,600	2,437,680.00	0.56
28	600048	保利地产	156,400	2,311,592.00	0.53
29	300015	爱尔眼科	52,780	2,293,291.00	0.52
30	601601	中国太保	82,700	2,253,575.00	0.52
31	000651	格力电器	39,400	2,228,858.00	0.51
32	300059	东方财富	105,660	2,134,332.00	0.49
33	002352	顺丰控股	38,500	2,105,950.00	0.48
34	300122	智飞生物	20,700	2,073,105.00	0.47
35	002142	宁波银行	78,800	2,070,076.00	0.47
36	000725	京东方 A	443,000	2,068,810.00	0.47
37	600309	万华化学	41,300	2,064,587.00	0.47

38	600031	三一重工	109,956	2,062,774.56	0.47
39	002304	洋河股份	19,409	2,040,662.26	0.47
40	000063	中兴通讯	50,400	2,022,552.00	0.46
41	601012	隆基股份	49,300	2,007,989.00	0.46
42	600588	用友网络	42,860	1,890,126.00	0.43
43	601818	光大银行	521,000	1,865,180.00	0.43
44	300498	温氏股份	83,060	1,810,708.00	0.41
45	601688	华泰证券	95,900	1,802,920.00	0.41
46	601766	中国中车	318,400	1,773,488.00	0.41
47	600104	上汽集团	101,900	1,731,281.00	0.40
48	000568	泸州老窖	18,700	1,703,944.00	0.39
49	002594	比亚迪	23,650	1,698,070.00	0.39
50	601211	国泰君安	98,168	1,694,379.68	0.39
51	000895	双汇发展	36,100	1,663,849.00	0.38
52	000876	新希望	55,400	1,650,920.00	0.38
53	600999	招商证券	74,800	1,641,860.00	0.38
54	600809	山西汾酒	11,300	1,638,500.00	0.37
55	600050	中国联通	338,500	1,638,340.00	0.37
56	601988	中国银行	459,800	1,600,104.00	0.37
57	000538	云南白药	17,025	1,597,115.25	0.37
58	601229	上海银行	185,600	1,540,480.00	0.35
59	600745	闻泰科技	12,200	1,536,590.00	0.35
60	300413	芒果超媒	23,200	1,512,640.00	0.35
61	000166	申万宏源	295,100	1,490,255.00	0.34
62	603986	兆易创新	6,300	1,486,233.00	0.34
63	600570	恒生电子	13,740	1,479,798.00	0.34
64	600690	海尔智家	83,000	1,469,100.00	0.34
65	603501	韦尔股份	7,200	1,454,040.00	0.33
66	601066	中信建投	36,100	1,421,618.00	0.32
67	001979	招商蛇口	86,100	1,415,484.00	0.32
68	603160	汇顶科技	6,300	1,404,270.00	0.32
69	601006	大秦铁路	194,800	1,371,392.00	0.31
70	601169	北京银行	276,500	1,354,850.00	0.31
71	601390	中国中铁	266,500	1,337,830.00	0.31
72	600703	三安光电	53,500	1,337,500.00	0.31
73	600837	海通证券	106,200	1,335,996.00	0.31
74	300601	康泰生物	8,216	1,332,306.56	0.30
75	600028	中国石化	333,700	1,304,767.00	0.30
76	002555	三七互娱	27,800	1,301,040.00	0.30

77	600436	片仔癀	7,600	1,293,900.00	0.30
78	601186	中国铁建	150,400	1,260,352.00	0.29
79	002241	歌尔股份	42,700	1,253,672.00	0.29
80	600547	山东黄金	33,800	1,237,756.00	0.28
81	600406	国电南瑞	60,300	1,221,075.00	0.28
82	601336	新华保险	27,400	1,213,272.00	0.28
83	601989	中国重工	298,800	1,195,200.00	0.27
84	002007	华兰生物	23,800	1,192,618.00	0.27
85	601857	中国石油	282,700	1,184,513.00	0.27
86	601138	工业富联	78,100	1,183,215.00	0.27
87	601933	永辉超市	125,100	1,173,438.00	0.27
88	000938	紫光股份	26,800	1,151,864.00	0.26
89	300014	亿纬锂能	24,002	1,148,495.70	0.26
90	601899	紫金矿业	257,200	1,131,680.00	0.26
91	600019	宝钢股份	243,000	1,108,080.00	0.25
92	002916	深南电路	6,600	1,105,632.00	0.25
93	000100	TCL 科技	177,000	1,097,400.00	0.25
94	000776	广发证券	77,500	1,094,300.00	0.25
95	002230	科大讯飞	29,000	1,085,470.00	0.25
96	000338	潍柴动力	78,500	1,077,020.00	0.25
97	600346	恒力石化	76,800	1,075,200.00	0.25
98	002027	分众传媒	192,200	1,070,554.00	0.24
99	002024	苏宁易购	121,505	1,065,598.85	0.24
100	002410	广联达	14,900	1,038,530.00	0.24
101	300433	蓝思科技	37,000	1,037,480.00	0.24
102	300142	沃森生物	19,800	1,036,728.00	0.24
103	601088	中国神华	71,700	1,029,612.00	0.24
104	600015	华夏银行	168,000	1,028,160.00	0.23
105	002050	三花智控	46,840	1,025,796.00	0.23
106	002371	北方华创	6,000	1,025,460.00	0.23
107	002624	完美世界	17,200	991,408.00	0.23
108	601628	中国人寿	36,200	985,002.00	0.23
109	300347	泰格医药	9,600	978,048.00	0.22
110	002311	海大集团	20,400	970,836.00	0.22
111	601009	南京银行	131,200	961,696.00	0.22
112	601155	新城控股	29,771	930,046.04	0.21
113	601100	恒立液压	11,500	922,300.00	0.21
114	600009	上海机场	12,600	908,082.00	0.21
115	600340	华夏幸福	39,500	902,970.00	0.21

116	600196	复星医药	26,400	893,640.00	0.20
117	300033	同花顺	6,700	891,636.00	0.20
118	600438	通威股份	50,800	882,904.00	0.20
119	600183	生益科技	30,100	881,027.00	0.20
120	300676	华大基因	5,600	873,096.00	0.20
121	600741	华域汽车	41,500	862,785.00	0.20
122	600919	江苏银行	151,000	856,170.00	0.20
123	300124	汇川技术	22,500	854,775.00	0.20
124	603993	洛阳钼业	231,300	848,871.00	0.19
125	002493	荣盛石化	68,900	847,470.00	0.19
126	300003	乐普医疗	23,200	847,264.00	0.19
127	002602	世纪华通	54,500	834,395.00	0.19
128	002841	视源股份	8,303	826,314.56	0.19
129	002001	新和成	28,300	823,530.00	0.19
130	002271	东方雨虹	20,200	820,726.00	0.19
131	601788	光大证券	51,100	820,666.00	0.19
132	002129	中环股份	36,300	815,298.00	0.19
133	600383	金地集团	58,800	805,560.00	0.18
134	000596	古井贡酒	5,300	796,272.00	0.18
135	601939	建设银行	125,500	791,905.00	0.18
136	002600	领益智造	74,300	789,809.00	0.18
137	300558	贝达药业	5,600	783,888.00	0.18
138	601225	陕西煤业	108,700	783,727.00	0.18
139	300454	深信服	3,800	782,648.00	0.18
140	002821	凯莱英	3,211	780,273.00	0.18
141	002120	韵达股份	31,860	778,977.00	0.18
142	002460	赣锋锂业	14,400	771,408.00	0.18
143	601901	方正证券	108,072	765,149.76	0.17
144	002236	大华股份	39,400	756,874.00	0.17
145	000977	浪潮信息	19,300	756,174.00	0.17
146	600763	通策医疗	4,500	750,465.00	0.17
147	601877	正泰电器	28,300	745,705.00	0.17
148	600958	东方证券	78,200	742,118.00	0.17
149	002044	美年健康	51,300	739,233.00	0.17
150	300529	健帆生物	10,300	715,850.00	0.16
151	600886	国投电力	88,800	697,968.00	0.16
152	600893	航发动力	29,700	697,356.00	0.16
153	601985	中国核电	170,000	695,300.00	0.16
154	600926	杭州银行	77,700	693,084.00	0.16

155	601669	中国电建	200,000	692,000.00	0.16
156	002812	恩捷股份	10,400	684,320.00	0.16
157	600600	青岛啤酒	8,900	680,850.00	0.16
158	300136	信维通信	12,700	673,354.00	0.15
159	300661	圣邦股份	2,200	671,110.00	0.15
160	002127	南极电商	31,700	671,089.00	0.15
161	603369	今世缘	16,700	664,493.00	0.15
162	600606	绿地控股	106,400	657,552.00	0.15
163	600521	华海药业	19,350	656,545.50	0.15
164	300628	亿联网络	9,600	655,296.00	0.15
165	603899	晨光文具	12,000	655,200.00	0.15
166	000069	华侨城 A	107,700	652,662.00	0.15
167	603658	安图生物	4,000	649,760.00	0.15
168	601881	中国银河	56,600	649,202.00	0.15
169	002456	欧菲光	35,300	649,167.00	0.15
170	600010	宝钢股份	596,500	644,220.00	0.15
171	600845	宝信软件	10,900	643,972.00	0.15
172	300253	卫宁健康	28,040	643,237.60	0.15
173	603019	中科曙光	16,700	641,280.00	0.15
174	000768	中航飞机	36,100	640,414.00	0.15
175	603659	璞泰来	6,100	628,422.00	0.14
176	300408	三环集团	22,565	625,050.50	0.14
177	600161	天坛生物	13,700	621,021.00	0.14
178	601990	南京证券	43,500	620,745.00	0.14
179	002384	东山精密	20,700	619,965.00	0.14
180	002736	国信证券	53,800	607,940.00	0.14
181	600332	白云山	18,800	607,804.00	0.14
182	000425	徐工机械	102,600	606,366.00	0.14
183	600872	中炬高新	10,300	602,859.00	0.14
184	603939	益丰药房	6,600	600,600.00	0.14
185	002414	高德红外	20,510	600,532.80	0.14
186	601377	兴业证券	87,600	600,060.00	0.14
187	002179	中航光电	14,500	594,645.00	0.14
188	002607	中公教育	21,340	592,185.00	0.14
189	300144	宋城演艺	33,961	587,525.30	0.13
190	601618	中国中冶	233,900	587,089.00	0.13
191	600061	国投资本	45,800	583,034.00	0.13
192	600029	南方航空	112,400	581,108.00	0.13
193	000963	华东医药	22,700	574,310.00	0.13

194	601111	中国国航	86,800	573,748.00	0.13
195	000656	金科股份	70,300	573,648.00	0.13
196	300308	中际旭创	9,100	573,300.00	0.13
197	603882	金域医学	6,400	572,800.00	0.13
198	603799	华友钴业	14,700	571,242.00	0.13
199	002157	正邦科技	32,500	568,100.00	0.13
200	000625	长安汽车	51,100	562,100.00	0.13
201	002463	沪电股份	22,400	559,552.00	0.13
202	002049	紫光国微	7,600	552,900.00	0.13
203	002252	上海莱士	65,200	551,592.00	0.13
204	603444	吉比特	1,000	549,010.00	0.13
205	600660	福耀玻璃	26,300	548,881.00	0.13
206	600352	浙江龙盛	42,900	548,691.00	0.13
207	601360	三六零	29,800	545,638.00	0.12
208	603517	绝味食品	7,700	544,698.00	0.12
209	000157	中联重科	84,600	543,978.00	0.12
210	000860	顺鑫农业	9,516	542,221.68	0.12
211	601727	上海电气	106,500	536,760.00	0.12
212	600674	川投能源	57,600	533,952.00	0.12
213	300450	先导智能	11,500	531,415.00	0.12
214	600298	安琪酵母	10,700	529,436.00	0.12
215	601162	天风证券	87,100	527,826.00	0.12
216	300595	欧普康视	7,600	526,984.00	0.12
217	300383	光环新网	19,900	518,793.00	0.12
218	600115	东方航空	121,900	514,418.00	0.12
219	601872	招商轮船	88,200	514,206.00	0.12
220	002065	东华软件	40,900	512,068.00	0.12
221	600018	上港集团	121,400	509,880.00	0.12
222	000066	中国长城	38,300	505,560.00	0.12
223	600760	中航沈飞	15,400	505,428.00	0.12
224	603605	珀莱雅	2,800	504,056.00	0.12
225	002385	大北农	55,200	502,872.00	0.11
226	300482	万孚生物	4,800	499,200.00	0.11
227	601319	中国人保	77,500	499,100.00	0.11
228	600085	同仁堂	18,300	496,296.00	0.11
229	002603	以岭药业	15,900	495,921.00	0.11
230	002439	启明星辰	11,700	492,219.00	0.11
231	600132	重庆啤酒	6,700	489,100.00	0.11
232	000783	长江证券	72,100	485,954.00	0.11

233	603707	健友股份	7,500	484,275.00	0.11
234	600536	中国软件	6,100	483,120.00	0.11
235	002185	华天科技	35,700	483,021.00	0.11
236	002032	苏泊尔	6,800	482,800.00	0.11
237	601799	星宇股份	3,800	482,600.00	0.11
238	600118	中国卫星	15,600	480,948.00	0.11
239	601108	财通证券	46,700	478,675.00	0.11
240	002299	圣农发展	16,500	478,500.00	0.11
241	002223	鱼跃医疗	13,100	476,840.00	0.11
242	600795	国电电力	257,300	476,005.00	0.11
243	601600	中国铝业	171,500	473,340.00	0.11
244	000786	北新建材	21,900	467,127.00	0.11
245	600705	中航资本	117,700	466,092.00	0.11
246	600867	通化东宝	26,700	465,381.00	0.11
247	002146	荣盛发展	57,300	464,130.00	0.11
248	600522	中天科技	40,300	461,435.00	0.11
249	601607	上海医药	25,100	461,338.00	0.11
250	002773	康弘药业	9,300	461,280.00	0.11
251	002180	纳思达	14,000	460,740.00	0.11
252	002373	千方科技	19,100	458,209.00	0.10
253	600998	九州通	24,500	456,190.00	0.10
254	600109	国金证券	39,700	452,977.00	0.10
255	002153	石基信息	11,600	452,748.00	0.10
256	002690	美亚光电	8,600	452,360.00	0.10
257	603833	欧派家居	3,900	452,010.00	0.10
258	603338	浙江鼎力	5,960	451,589.20	0.10
259	601800	中国交建	61,400	450,676.00	0.10
260	600498	烽火通信	15,500	448,105.00	0.10
261	002202	金风科技	44,800	446,656.00	0.10
262	600111	北方稀土	47,300	440,836.00	0.10
263	000703	恒逸石化	48,180	439,883.40	0.10
264	601919	中远海控	126,600	439,302.00	0.10
265	603858	步长制药	15,100	435,635.00	0.10
266	600637	东方明珠	45,100	435,215.00	0.10
267	300496	中科创达	5,600	435,120.00	0.10
268	000961	中南建设	48,400	430,760.00	0.10
269	600801	华新水泥	18,100	429,151.00	0.10
270	001914	招商积余	13,900	427,147.00	0.10
271	002405	四维图新	25,700	423,793.00	0.10

272	601231	环旭电子	19,400	423,696.00	0.10
273	300316	晶盛机电	17,100	423,054.00	0.10
274	601021	春秋航空	12,000	422,880.00	0.10
275	300285	国瓷材料	12,600	422,226.00	0.10
276	300251	光线传媒	38,400	418,944.00	0.10
277	601555	东吴证券	51,100	416,976.00	0.10
278	002739	万达电影	27,300	416,871.00	0.10
279	600176	中国巨石	45,500	416,325.00	0.10
280	600201	生物股份	14,900	414,816.00	0.09
281	600004	白云机场	27,200	414,528.00	0.09
282	600380	健康元	25,500	414,120.00	0.09
283	000050	深天马 A	26,900	413,184.00	0.09
284	002152	广电运通	31,900	412,786.00	0.09
285	000021	深科技	18,900	412,587.00	0.09
286	601018	宁波港	115,000	410,550.00	0.09
287	600489	中金黄金	44,800	409,472.00	0.09
288	002294	信立泰	13,800	409,308.00	0.09
289	600487	亨通光电	24,900	408,609.00	0.09
290	000975	银泰黄金	26,000	407,680.00	0.09
291	600315	上海家化	8,500	407,150.00	0.09
292	002601	龙蟠佰利	22,000	407,000.00	0.09
293	002212	南洋股份	15,300	406,674.00	0.09
294	600895	张江高科	19,900	405,363.00	0.09
295	600011	华能国际	96,000	405,120.00	0.09
296	300357	我武生物	6,500	404,625.00	0.09
297	002422	科伦药业	19,200	403,200.00	0.09
298	300146	汤臣倍健	20,400	401,676.00	0.09
299	300699	光威复材	6,400	401,472.00	0.09
300	603883	老百姓	4,000	400,160.00	0.09
301	002074	国轩高科	14,900	399,916.00	0.09
302	002465	海格通信	30,500	394,670.00	0.09
303	600271	航天信息	24,300	394,632.00	0.09
304	600511	国药股份	9,700	394,499.00	0.09
305	601198	东兴证券	36,000	392,400.00	0.09
306	600177	雅戈尔	65,700	391,572.00	0.09
307	600699	均胜电子	16,400	390,484.00	0.09
308	002511	中顺洁柔	17,400	388,020.00	0.09
309	601689	拓普集团	13,900	387,810.00	0.09
310	002353	杰瑞股份	12,500	387,500.00	0.09

311	002508	老板电器	12,400	385,764.00	0.09
312	600885	宏发股份	9,600	385,152.00	0.09
313	300207	欣旺达	20,200	381,780.00	0.09
314	603589	口子窖	7,500	381,750.00	0.09
315	601998	中信银行	74,100	381,615.00	0.09
316	002558	巨人网络	21,900	381,060.00	0.09
317	002156	通富微电	15,200	380,760.00	0.09
318	600642	申能股份	64,300	380,013.00	0.09
319	603712	七一二	9,900	379,962.00	0.09
320	300418	昆仑万维	15,200	379,392.00	0.09
321	600655	豫园股份	42,600	377,436.00	0.09
322	002019	亿帆医药	16,400	376,708.00	0.09
323	300212	易华录	6,700	375,200.00	0.09
324	600779	水井坊	6,000	374,520.00	0.09
325	000513	丽珠集团	7,800	374,478.00	0.09
326	601838	成都银行	47,000	374,120.00	0.09
327	000999	华润三九	12,800	373,632.00	0.09
328	000728	国元证券	44,400	372,960.00	0.09
329	600739	辽宁成大	19,701	372,939.93	0.09
330	600598	北大荒	23,100	371,910.00	0.09
331	002013	中航机电	47,000	371,300.00	0.08
332	600426	华鲁恒升	21,000	371,280.00	0.08
333	002673	西部证券	45,500	371,280.00	0.08
334	002925	盈趣科技	6,400	370,816.00	0.08
335	002242	九阳股份	9,900	368,973.00	0.08
336	600362	江西铜业	27,300	367,458.00	0.08
337	002507	涪陵榨菜	10,200	367,302.00	0.08
338	002075	沙钢股份	29,100	363,750.00	0.08
339	002926	华西证券	34,100	362,483.00	0.08
340	000739	普洛药业	15,550	362,159.50	0.08
341	601878	浙商证券	36,200	358,742.00	0.08
342	600170	上海建工	116,700	358,269.00	0.08
343	600068	葛洲坝	60,100	357,595.00	0.08
344	300088	长信科技	31,900	357,280.00	0.08
345	600066	宇通客车	29,200	356,240.00	0.08
346	600486	扬农化工	4,300	354,750.00	0.08
347	601117	中国化学	64,600	354,008.00	0.08
348	603866	桃李面包	6,800	346,052.00	0.08
349	002399	海普瑞	13,700	343,048.00	0.08

350	300168	万达信息	15,500	342,085.00	0.08
351	002557	洽洽食品	6,300	341,397.00	0.08
352	002131	利欧股份	88,400	341,224.00	0.08
353	600369	西南证券	73,700	338,283.00	0.08
354	300070	碧水源	41,600	337,792.00	0.08
355	000627	天茂集团	64,700	337,087.00	0.08
356	000723	美锦能源	53,800	336,788.00	0.08
357	000671	阳光城	53,100	336,654.00	0.08
358	002939	长城证券	27,200	335,104.00	0.08
359	600208	新湖中宝	112,400	334,952.00	0.08
360	601992	金隅集团	108,800	332,928.00	0.08
361	600089	特变电工	48,500	328,345.00	0.08
362	600667	太极实业	27,700	327,414.00	0.07
363	002468	申通快递	19,700	323,277.00	0.07
364	600221	海航控股	215,000	322,500.00	0.07
365	000988	华工科技	13,200	322,476.00	0.07
366	600909	华安证券	47,200	322,376.00	0.07
367	600875	东方电气	36,300	321,255.00	0.07
368	601966	玲珑轮胎	15,900	321,180.00	0.07
369	002958	青农商行	72,500	321,175.00	0.07
370	002078	太阳纸业	33,700	320,824.00	0.07
371	600219	南山铝业	156,600	317,898.00	0.07
372	002797	第一创业	45,500	314,860.00	0.07
373	002683	宏大爆破	9,000	314,100.00	0.07
374	002500	山西证券	47,870	313,069.80	0.07
375	600516	方大炭素	49,680	311,990.40	0.07
376	002030	达安基因	11,420	311,537.60	0.07
377	002340	格林美	62,600	311,122.00	0.07
378	000750	国海证券	70,900	307,706.00	0.07
379	601233	桐昆股份	24,100	307,516.00	0.07
380	600038	中直股份	7,400	303,918.00	0.07
381	600027	华电国际	88,800	303,696.00	0.07
382	000932	华菱钢铁	80,500	303,485.00	0.07
383	002174	游族网络	11,600	302,528.00	0.07
384	600153	建发股份	37,000	299,700.00	0.07
385	000423	东阿阿胶	8,300	297,223.00	0.07
386	300271	华宇软件	10,500	296,205.00	0.07
387	000540	中天金融	91,800	295,596.00	0.07
388	000998	隆平高科	17,500	291,375.00	0.07

389	600026	中远海能	45,000	290,700.00	0.07
390	600754	锦江酒店	10,400	288,600.00	0.07
391	002572	索菲亚	11,900	287,623.00	0.07
392	000401	冀东水泥	17,900	287,116.00	0.07
393	000709	河钢股份	138,900	283,356.00	0.06
394	000547	航天发展	20,700	282,969.00	0.06
395	601099	太平洋	89,200	282,764.00	0.06
396	002281	光迅科技	8,600	282,596.00	0.06
397	600167	联美控股	19,600	281,064.00	0.06
398	601216	君正集团	110,200	279,908.00	0.06
399	600704	物产中大	66,400	279,544.00	0.06
400	600188	兖州煤业	31,900	279,444.00	0.06
401	600688	上海石化	80,200	279,096.00	0.06
402	000688	国城矿业	15,000	277,950.00	0.06
403	300024	机器人	20,100	274,767.00	0.06
404	002081	金螳螂	34,900	274,314.00	0.06
405	600673	东阳光	39,500	272,945.00	0.06
406	300017	网宿科技	32,000	271,680.00	0.06
407	601128	常熟银行	35,700	268,107.00	0.06
408	600566	济川药业	10,500	267,330.00	0.06
409	000630	铜陵有色	137,600	265,568.00	0.06
410	600977	中国电影	20,000	262,600.00	0.06
411	000686	东北证券	31,000	261,950.00	0.06
412	600583	海油工程	57,500	261,625.00	0.06
413	000402	金融街	39,200	260,288.00	0.06
414	002387	维信诺	18,200	259,896.00	0.06
415	002396	星网锐捷	7,300	257,909.00	0.06
416	600460	士兰微	17,500	256,900.00	0.06
417	000729	燕京啤酒	36,800	252,080.00	0.06
418	600021	上海电力	34,000	251,600.00	0.06
419	600372	中航电子	18,800	250,416.00	0.06
420	601098	中南传媒	23,400	247,572.00	0.06
421	000825	太钢不锈	74,400	247,008.00	0.06
422	600160	巨化股份	35,800	246,662.00	0.06
423	600733	北汽蓝谷	38,100	244,983.00	0.06
424	000623	吉林敖东	15,400	242,242.00	0.06
425	000415	渤海租赁	81,200	241,976.00	0.06
426	000027	深圳能源	51,920	240,908.80	0.06
427	600256	广汇能源	88,900	240,030.00	0.05

428	002372	伟星新材	20,300	236,089.00	0.05
429	000028	国药一致	5,200	234,052.00	0.05
430	002010	传化智联	42,900	233,376.00	0.05
431	600820	隧道股份	41,300	233,345.00	0.05
432	002268	卫士通	10,900	232,606.00	0.05
433	600879	航天电子	35,400	227,976.00	0.05
434	600967	内蒙一机	21,900	227,541.00	0.05
435	000629	攀钢钒钛	112,300	225,723.00	0.05
436	000581	威孚高科	10,800	223,344.00	0.05
437	600549	厦门钨业	18,800	222,592.00	0.05
438	000997	新大陆	13,800	220,524.00	0.05
439	601699	潞安环能	39,200	218,344.00	0.05
440	300026	红日药业	39,400	217,488.00	0.05
441	600446	金证股份	11,200	217,280.00	0.05
442	600675	中华企业	53,300	216,931.00	0.05
443	601958	金铂股份	35,000	216,300.00	0.05
444	002217	合力泰	41,000	215,250.00	0.05
445	000046	泛海控股	57,000	214,890.00	0.05
446	600466	蓝光发展	39,500	212,905.00	0.05
447	002195	二三四五	75,500	212,155.00	0.05
448	600373	中文传媒	18,000	212,040.00	0.05
449	300012	华测检测	10,700	211,432.00	0.05
450	002110	三钢闽光	31,700	211,122.00	0.05
451	002563	森马服饰	29,700	209,385.00	0.05
452	000738	航发控制	15,133	206,565.45	0.05
453	000089	深圳机场	26,900	206,054.00	0.05
454	000983	西山煤电	53,820	201,825.00	0.05
455	600808	马钢股份	78,200	201,756.00	0.05
456	000883	湖北能源	57,100	200,992.00	0.05
457	300296	利亚德	33,000	200,310.00	0.05
458	600056	中国医药	14,100	199,515.00	0.05
459	600258	首旅酒店	12,900	198,273.00	0.05
460	600376	首开股份	33,500	196,310.00	0.04
461	603885	吉祥航空	21,200	192,920.00	0.04
462	601866	中远海发	103,900	191,176.00	0.04
463	600572	康恩贝	34,700	190,850.00	0.04
464	000413	东旭光电	71,400	190,638.00	0.04
465	000031	大悦城	37,300	189,857.00	0.04
466	600863	内蒙华电	76,000	186,960.00	0.04

467	002085	万丰奥威	28,800	186,624.00	0.04
468	601598	中国外运	57,700	186,371.00	0.04
469	000598	兴蓉环境	39,100	179,860.00	0.04
470	600260	凯乐科技	13,100	177,112.00	0.04
471	002506	协鑫集成	66,700	174,087.00	0.04
472	000898	鞍钢股份	70,100	171,745.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.04
2	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.03
3	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.02
4	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.02
5	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.02
6	688528	秦川物联	8,337	94,458.21	0.02
7	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.02
8	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
9	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
10	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
11	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
12	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
13	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	600519	贵州茅台	30,301,347.02	6.93
2	601318	中国平安	14,432,927.00	3.30
3	600036	招商银行	13,229,590.42	3.02
4	000858	五粮液	10,982,300.94	2.51
5	600276	恒瑞医药	8,103,486.79	1.85
6	600900	长江电力	7,097,724.73	1.62

7	601166	兴业银行	6,268,673.87	1.43
8	603288	海天味业	6,035,582.20	1.38
9	300750	宁德时代	6,030,530.00	1.38
10	600000	浦发银行	5,750,747.00	1.31
11	300760	迈瑞医疗	5,272,814.00	1.21
12	601398	工商银行	5,192,057.00	1.19
13	002415	海康威视	5,085,686.00	1.16
14	002714	牧原股份	4,956,140.28	1.13
15	000001	平安银行	4,902,165.00	1.12
16	601288	农业银行	4,740,832.00	1.08
17	002475	立讯精密	4,572,609.15	1.05
18	600585	海螺水泥	4,370,121.00	1.00
19	600030	中信证券	4,101,588.00	0.94
20	601668	中国建筑	3,942,215.00	0.90

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

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	000858	五粮液	3,841,870.00	0.88
2	000002	万科 A	1,984,316.00	0.45
3	300750	宁德时代	1,854,314.00	0.42
4	002714	牧原股份	1,711,443.60	0.39
5	300760	迈瑞医疗	1,685,119.00	0.39
6	002475	立讯精密	1,655,190.00	0.38
7	002415	海康威视	1,638,632.00	0.37
8	000001	平安银行	1,598,262.00	0.37
9	002304	洋河股份	1,286,355.00	0.29
10	000651	格力电器	1,061,258.00	0.24
11	300015	爱尔眼科	1,030,682.20	0.24
12	300122	智飞生物	1,019,405.00	0.23
13	600519	贵州茅台	979,944.00	0.22
14	002142	宁波银行	954,094.00	0.22
15	002371	北方华创	948,777.00	0.22
16	000063	中兴通讯	929,211.90	0.21
17	000568	泸州老窖	908,407.00	0.21

18	000725	京东方 A	903,676.00	0.21
19	002352	顺丰控股	887,992.00	0.20
20	300498	温氏股份	885,713.20	0.20

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	564,154,474.52
卖出股票收入（成交）总额	92,589,156.58

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	82,200.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	82,200.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128112	歌尔转债	623	62,300.00	0.01
2	128114	正邦转债	199	19,900.00	0.00

7.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.8 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	271,648.68
2	应收证券清算款	446,208.90
3	应收股利	-
4	应收利息	3,831.81
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	721,689.39
---	----	------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688568	中科星图	178,634.20	0.04	新股锁定
2	688377	迪威尔	129,619.48	0.03	新股锁定
3	688277	天智航	106,072.40	0.02	新股锁定
4	688027	国盾量子	102,389.40	0.02	新股锁定

§ 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

8.1.1 本基金的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
506	788, 112. 95	376, 187, 955. 00	94. 33%	22, 597, 200. 00	5. 67%

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.2 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	新华人寿保险股份有限公司	50, 154, 300. 00	12. 58%
2	中金公司—交通银行—中金交银致远策略优选 8 号集合资产管理计划	50, 010, 800. 00	12. 54%
3	中国人寿保险股份有限公司	50, 006, 750. 00	12. 54%
4	工银安盛人寿保险有限公司	30, 009, 450. 00	7. 53%
5	长安国际信托股份有限公司—长安信托—交银致远策略优选 6 号集合资金信托计划	25, 005, 175. 00	6. 27%
6	交银国际信托有限公司—交银国信·交银致远策略优选 7 号集合资金信托计划	25, 000, 000. 00	6. 27%
7	浦银安盛基金—东兴期货有限责任公司—浦银安盛盛明 1 号单一资产管理计划	24, 007, 875. 00	6. 02%
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	20, 005, 400. 00	5. 02%
9	招商证券股份有限公司	13, 099, 771. 00	3. 28%
10	中信证券股份有限公司	12, 450, 200. 00	3. 12%

8.3 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. 0000%

8.4 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的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 4 月 30 日）基金份额总额	554,785,155.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	24,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	180,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	398,785,155.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，管理人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	
天风证券	1	346,430,365.64	52.87%	322,631.09	58.48%	-
华泰证券	2	292,837,832.93	44.69%	214,155.22	38.82%	-
国泰君安	1	16,028,150.65	2.45%	14,927.15	2.71%	-

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：

本基金本报告期内证券公司交易单元均为新增。

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
天风证券	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-

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 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	指定网站	2020 年 3 月 16 日
2	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	报刊及指定网站	2020 年 3 月 16 日
3	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同	指定网站	2020 年 3 月 16 日
4	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议	指定网站	2020 年 3 月 16 日
5	关于浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	报刊及指定网站	2020 年 4 月 17 日
6	浦银安盛基金管理有限公司关于浦银安盛 MSCI 中国 A 股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	报刊及指定网站	2020 年 4 月 17 日
7	关于浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易	报刊及指定网站	2020 年 4 月 22 日

	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		
8	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	报刊及指定网站	2020 年 5 月 6 日
9	关于调整浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金最小申购、赎回单位的公告	报刊及指定网站	2020 年 5 月 26 日
10	浦银安盛 MSCI 中国 A 股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	报刊及指定网站	2020 年 5 月 26 日
11	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	指定网站	2020 年 5 月 26 日
12	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	报刊及指定网站	2020 年 6 月 5 日
13	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书摘要（更新）2020 年第 1 号	指定网站	2020 年 6 月 9 日
14	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书正文（更新）2020 年第 1 号	指定网站	2020 年 6 月 9 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

本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金募集的文件
- 2、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛 MSCI 中国 A 股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指定报刊上披露的各项公告
- 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

2020 年 8 月 29 日