

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数
证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	52
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53
§ 8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54
8.2 期末上市基金前十名持有人	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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情况	55
§ 9 开放式基金份额变动	55
§ 10 重大事件揭示	55
10.1 基金份额持有人大会决议	55
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	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	56
10.8 其他重大事件	57
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 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（扩位证券简称：浦银 MSCI 中国 ETF）
基金主代码	515780
前端交易代码	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	11,785,155.00 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 年 5 月 29 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条件下，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	薛香
	联系电话	021-23212888
	电子邮箱	compliance@py-axa.com
客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95566
传真	021-23212985	010-66594942
注册地址	中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层	北京西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	200127	100818
法定代表人	谢伟	葛海蛟

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(2024年1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	-821,470.19
本期利润	115,900.63
加权平均基金份额本期利润	0.0079
本期加权平均净值利润率	0.67%
本期基金份额净值增长率	0.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	1,987,880.92
期末可供分配基金份额利润	0.1687
期末基金资产净值	13,773,035.92
期末基金份额净值	1.1687
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	16.87%

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。

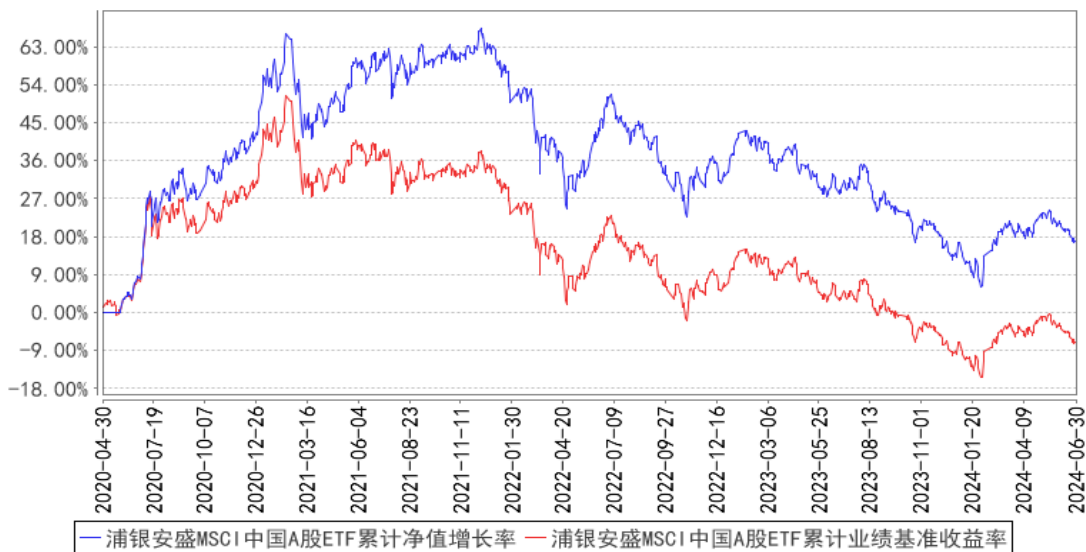
3.2 基金净值表现

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	-3.06%	0.49%	-3.88%	0.51%	0.82%	-0.02%
过去三个月	-1.81%	0.76%	-2.61%	0.79%	0.80%	-0.03%
过去六个月	0.23%	0.95%	0.00%	0.98%	0.23%	-0.03%
过去一年	-9.68%	0.88%	-10.40%	0.91%	0.72%	-0.03%
过去三年	-27.64%	1.01%	-33.59%	1.04%	5.95%	-0.03%
自基金合同生效起至今	16.87%	1.09%	-7.17%	1.11%	24.04%	-0.02%

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



§ 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2024年6月30日止，浦银安盛旗下共管理108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 个月持有期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）、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 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 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、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛普旭 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛光耀优选混合型证券投资基金、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联接基金、浦银安盛安荣回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛景气优选混合型证券投资基金、浦银安盛普兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛普恒利率债债券型证券投资基金、浦银安盛稳健富利 180 天持有期债券型证券投资基金、浦银安盛悦享 30 天持有期债券型证券投资基金、浦银安盛策略优选混合型证券投资基金、浦银安盛招睿精选 3 个月持有期混合型基金中基金、浦银安盛普安利率债债券型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2050 五年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛高端装备混合型发起式证券投资基金、浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术基础设施系统以及有关业务应用系统构成。当前，公司建设有上交所金桥托管机房和办公大楼自建机房，实现本地双活互备。同时，在合肥异地建设有灾备托

管机房，实现异地备份，形成了两地三中心的架构布局。公司的机房建设、网络设备、服务器设备、监控设备等基础设施，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。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。这些系统主要是采购行业内成熟、主流的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。公司的基础设施及业务应用系统，建成后均由公司信息技术部负责日常的运维、管理，同时与第三方专业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运维服务。此外，公司自研开发团队建成了低代码的数字化运营平台，基于 CDH 底座的大数据开发平台，集 RPA、OCR、NLP、AI 等创新技术为一体的创新研发平台以及移动平台等业务支持应用平台，积极为业务赋能。除上述情况外，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	2020年6月4日	-	13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。2023年6月起任指数与量化投资部业务主管兼基金经理。2019年3月至2023年1月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的基金经理。2020年6月至2023年1月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的基金经理。2022年3月至2023年1月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。2021年12月至2024年3月担任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 4 月至 2024 年 3 月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。2020 年 6 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的基金经理。2020 年 9 月起担任浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。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 月起担任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。2023 年 1 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联接基金的基金经理。2023 年 3 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联接基金的基金经理。
--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究

支持。同时，在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性；从事后监控角度上，一方面是定期对股票、债券交易情况进行分析，对不同时间窗口（同日、3 日、5 日和 10 日）发生的不同组合对同一投资标的的同向交易及反向交易进行价差分析，并进行统计显著性的检验，以确定交易价差对相关基金的业绩差异的贡献度；同时对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异的分析；另一方面是公司公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查，并对发现的问题进行及时的报告。本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，公平对待旗下各投资组合，未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 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

上半年，我国国内生产总值同比增长 5.0%。分季度看，一季度实际 GDP 同比增速为 5.3%，二季度同比增速为 4.7%，刚好完成政府工作报告提出的全年 5% 实际 GDP 增速的任务进度，宏观经济整体呈现出 Q2 环比弱于 Q1、名义弱于实际、内需弱于外需的特征。在此宏观背景下，A 股市场呈现出风险偏好低，偏向防御风格的特点，上证综指上半年小幅下跌 0.25%，沪深 300 小幅上涨 0.89%，创业板指下跌 10.99%。今年年初至 2 月 5 日，A 股市场快速下探，一度触发中小盘股票的流动性危机，在国家出台各项政策、汇金等机构加大对市场托底力度之后，流动性得以改善，上证综指从底部快速反弹，并突破了年初位置，重新站上 3000 点，投资者信心得到有效恢复，大盘龙头资产表现更佳。在经历前期快速回升后，市场处于震荡整固阶段。在国务院发布新国九条、地产政策超预期等催化下，市场风险偏好进一步修复，A 股上行至年内高点。后续受到国内经济预期走弱、美联储降息预期落空等因素影响，A 股市场再度回调。陆家嘴论坛在 6 月中旬顺利召开，其中“创八条”的提出加大了对科技企业的支持力度，助力成长风格阶段性占优。股市后续逐步企稳。从资金面角度来看，在今年以来市场多次下跌的情况下，宽基 ETF 成为主力增量资金的投资方向，近期宽基 ETF，尤其是沪深 300ETF 再度大幅净流入，对大盘龙头为代表的核心资产形成支撑。

在投资策略方面，作为跟踪 MSCI 中国 A 股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。本基金以获取中国 A 股市场优质核心资产的长期收益为宗旨，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 MSCI 中国 A 股 ETF 基金份额净值为 1.1687 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.23%；同期业绩比较基准收益率为 0.00%。

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，我们判断 A 股市场有望企稳反弹。当前市场风险偏好较弱，正从过度悲观的状态缓慢修复，向高 ROE、高景气的方向扩散，我们认为大盘龙头风格仍是主线。7 月三中全会公报中提到“健全因地制宜发展新质生产力体制机制。加强新领域新赛道制度供给，建立未来产业投入增长机制。健全相关规则和政策，加快形成同新质生产力更相适应的生产关系，促进各类先进生产要素向新质生产力集聚”。在此政策定调下，支持新质生产力发展的政策有望持续出台，力度有望不断加大，利好科技成长风格。在行业景气度方面，科技板块很多细分行业，例如半导体、消费电子的行业景气度预期已经迎来明显的拐点。受益于 Apple Intelligence 的发布，AI 端侧的新增长空间有望被进一步打开。AI 功能升级将推动用户对于电子产品的更新换代，由此惠及国内的苹果供应链。海外市场方面，CME 预期 9 月美联储降息概率已达 100%，美联储降息预期增强有助提升市场风险偏好，成长板块估值有望提升。因此，大盘成长风格配置价值凸显。

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。

根据投资品种条线的不同，估值委员会下设固定收益品种估值委员会和权益品种估值委员会。权益品种估值委员会由公司基金运营条线分管领导、权益投研条线分管领导、基金运营部主要负责人、风险管理部负责人、所涉及投资品种的投资部门负责人（包括但不限于权益投资部、权益专户部、指数与量化投资部、FOF 业务部等）及一名基金会计业务骨干组成。固定收益品种估值委员会由公司基金运营条线分管领导、固定收益投研条线分管领导、基金运营部主要负责人、风险管理部负责人、所涉及投资品种的投资部门负责人（包括但不限于固定收益投资部、固定收益专户部等）及一名基金会计业务骨干组成。

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。

4.8 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、本报告期内本基金自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 1 月 24 日，2024 年 2 月 5 日至 2024 年 3 月 20 日，及 2024 年 5 月 7 日至 2024 年 6 月 6 日分别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，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”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	643,873.75	652,565.29
结算备付金		3,034.25	6,591.48
存出保证金		114.72	4,427.37
交易性金融资产	6.4.7.2	13,221,706.02	16,674,632.25
其中：股票投资		13,221,706.02	16,674,632.25
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		13,868,728.74	17,338,216.39
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,009.73	2,170.45
应付托管费		669.90	723.49
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	6.4.7.9	93,013.19	96,531.51
负债合计		95,692.82	99,425.45
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	11,785,155.00	14,785,155.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	1,987,880.92	2,453,635.94
净资产合计		13,773,035.92	17,238,790.94
负债和净资产总计		13,868,728.74	17,338,216.39

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1687 元，基金份额总额 11,785,155.00 份。

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		225,552.84	2,187,393.17
1. 利息收入		1,186.38	4,282.03
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,186.38	4,282.03
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-714,222.41	-4,363,896.90

其中：股票投资收益	6.4.7.14	-911,312.34	-4,754,603.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	92,562.51
股利收益	6.4.7.19	197,089.93	298,144.36
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	6.4.7.20	937,370.82	6,464,914.34
4. 汇兑收益(损失以“-” 号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-” 号填列)	6.4.7.21	1,218.05	82,093.70
减：二、营业总支出		109,652.21	182,327.02
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	12,817.48	32,075.15
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,272.55	10,691.75
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	333.43
8. 其他费用	6.4.7.23	92,562.18	139,226.69
三、利润总额(亏损总额以 “-”号填列)		115,900.63	2,005,066.15
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		115,900.63	2,005,066.15
五、其他综合收益的税后净 额		-	-
六、综合收益总额		115,900.63	2,005,066.15

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,785,155.00	2,453,635.94	17,238,790.94

二、本期期初净资产	14,785,155.00	2,453,635.94	17,238,790.94
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-465,755.02	-3,465,755.02
(一)、综合收益总额	-	115,900.63	115,900.63
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-581,655.65	-3,581,655.65
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-581,655.65	-3,581,655.65
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	11,785,155.00	1,987,880.92	13,773,035.92
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59,785,155.00	19,521,451.56	79,306,606.56
二、本期期初净资产	59,785,155.00	19,521,451.56	79,306,606.56
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-42,000,000.00	-14,293,432.50	-56,293,432.50
(一)、综合收益总额	-	2,005,066.15	2,005,066.15
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净资产减少以“-”号填列)	-42,000,000.00	-16,298,498.65	-58,298,498.65
其中: 1. 基金申购款	21,000,000.00	6,902,592.06	27,902,592.06
2. 基金赎回款	-63,000,000.00	-23,201,090.71	-86,201,090.71
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变	-	-	-

动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	17,785,155.00	5,228,019.06	23,013,174.06

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：

<u>张弛</u>	<u>顾佳</u>	<u>孙赵辉</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

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)、存托凭证、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)。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。本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即 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、《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 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2024 年 1 月 1 日至 2024 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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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 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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	643,873.75

等于：本金	643,809.84
加：应计利息	63.91
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	643,873.75

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	15,180,656.80	-	13,221,706.02	-1,958,950.78
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,180,656.80	-	13,221,706.02	-1,958,950.78

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

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

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 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。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
应付交易费用	1,554.97

其中：交易所市场	1,554.97
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	21,458.22
应付指数使用费	70,000.00
合计	93,013.19

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,785,155.00	14,785,155.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
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	11,785,155.00	11,785,155.00

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 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
上年度末	4,320,430.68	-1,866,794.74	2,453,635.94
本期期初	4,320,430.68	-1,866,794.74	2,453,635.94
本期利润	-821,470.19	937,370.82	115,900.63
本期基金份额交易产生的变动数	-728,374.74	146,719.09	-581,655.65
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-728,374.74	146,719.09	-581,655.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,770,585.75	-782,704.83	1,987,880.92

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	1,171.53

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	11.44
其他	3.41
合计	1,186.38

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-786,801.51
股票投资收益——赎回差价收入	-124,510.83
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	-911,312.34

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	2,061,197.89
减：卖出股票成本总额	2,844,464.22
减：交易费用	3,535.18
买卖股票差价收入	-786,801.51

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,581,655.65
减：现金支付赎回款总额	1,338,533.65
减：赎回股票成本总额	2,367,632.83
减：交易费用	-
赎回差价收入	-124,510.83

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.14.5 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。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	197,089.93
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	197,089.93

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	937,370.82
股票投资	937,370.82
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	937,370.82

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,218.05
合计	1,218.05

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	21,458.22
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	130.00
指数使用费	70,973.96
合计	92,562.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东
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	本基金的联接基金

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,817.48	32,075.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	12.41	9.92
应支付基金管理人的净管理费	12,805.07	32,065.23

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当期天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,272.55	10,691.75

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当期天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限

限费率的证券出借业务的情况。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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。

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自有资金投资本基金的情况

注：本报告期本基金管理人未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
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	5,145,500.00	43.66	5,357,900.00	36.24

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取。

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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-活期	643,873.75	1,171.53	857,523.26	1,981.37

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

1、于2024年06月30日，本基金持有12,500.00股中国银行的普通股，成本总额为人民币44,850.94元，估值总额为人民币57,750.00元，占基金净资产的比例为0.42%（于2023年12月31日，本基金持有15,600股中国银行的普通股，成本总额为人民币55,713.40元，估值总额为人民币62,244.00元，占基金净资产的比例为0.36%）。

2、于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有 10,400.00 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 79,533.95 元，估值总额为人民币 85,592.00 元，占基金资产净值的比例为 0.62%（于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 13,100 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 100,162.68 元，估值总额为人民币 86,722.00 元，占基金资产净值的比例为 0.50%）。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间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

注：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 MSCI China A RMB Index (MSCI 中国 A 股人民币指数) 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）、存托凭证、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相关规定）。

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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以将其新投资品种纳入投资范围或根据变更后的比例限制调整上述投资比例。

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。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无债券投资和资产支持证券投资(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2024 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(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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2024 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 2024 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	643,873.75	-	-	-	643,873.75
结算备付金	3,034.25	-	-	-	3,034.25
存出保证金	114.72	-	-	-	114.72
交易性金融资产	-	-	-	13,221,706.02	13,221,706.02
资产总计	647,022.72	-	-	13,221,706.02	13,868,728.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,009.73	2,009.73
应付托管费	-	-	-	669.90	669.90
其他负债	-	-	-	93,013.19	93,013.19
负债总计	-	-	-	95,692.82	95,692.82
利率敏感度缺口	647,022.72	-	-	13,126,013.20	13,773,035.92
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	652,565.29	-	-	-	652,565.29
结算备付金	6,591.48	-	-	-	6,591.48
存出保证金	4,427.37	-	-	-	4,427.37
交易性金融资产	-	-	-	16,674,632.25	16,674,632.25
资产总计	663,584.14	-	-	16,674,632.25	17,338,216.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,170.45	2,170.45
应付托管费	-	-	-	723.49	723.49
其他负债	-	-	-	96,531.51	96,531.51
负债总计	-	-	-	99,425.45	99,425.45
利率敏感度缺口	663,584.14	-	-	16,575,206.80	17,238,790.94

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于2024年6月30日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2023年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券，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。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金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 2024年6月30日		上年度末 2023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	13,221,706.02	96.00	16,674,632.25	96.73
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	13,221,706.02	96.00	16,674,632.25	96.73

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵消后的净额为 0。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 500 基点	661,448.09	839,666.20
业绩比较基准下降 500 基点	-661,448.09	-839,666.20	

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	13,221,706.02	16,674,632.25
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	13,221,706.02	16,674,632.25

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易

不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	13,221,706.02	95.33
	其中：股票	13,221,706.02	95.33
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	646,908.00	4.66
8	其他各项资产	114.72	0.00
9	合计	13,868,728.74	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	142,928.00	1.04
B	采矿业	842,809.70	6.12

C	制造业	7,213,441.45	52.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	672,249.60	4.88
E	建筑业	269,091.60	1.95
F	批发和零售业	83,146.48	0.60
G	交通运输、仓储和邮政业	541,215.20	3.93
H	住宿和餐饮业	6,894.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	509,525.61	3.70
J	金融业	2,561,980.77	18.60
K	房地产业	119,305.80	0.87
L	租赁和商务服务业	99,918.00	0.73
M	科学研究和技术服务业	57,880.70	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	11,524.80	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	39,638.48	0.29
R	文化、体育和娱乐业	42,411.83	0.31
S	综合	7,744.00	0.06
	合计	13,221,706.02	96.00

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	503	738,097.17	5.36
2	300750	宁德时代	1,580	284,447.40	2.07
3	600036	招商银行	7,371	252,014.49	1.83
4	600900	长江电力	8,700	251,604.00	1.83
5	000858	五粮液	1,400	179,256.00	1.30
6	002594	比亚迪	650	162,662.50	1.18

7	601318	中国平安	3,800	157,168.00	1.14
8	300760	迈瑞医疗	500	145,455.00	1.06
9	601288	农业银行	30,300	132,108.00	0.96
10	601166	兴业银行	7,400	130,388.00	0.95
11	601138	工业富联	4,700	128,780.00	0.94
12	601899	紫金矿业	7,300	128,261.00	0.93
13	601398	工商银行	22,500	128,250.00	0.93
14	601088	中国神华	2,400	106,488.00	0.77
15	601328	交通银行	14,000	104,580.00	0.76
16	600809	山西汾酒	480	101,222.40	0.73
17	002475	立讯精密	2,568	100,948.08	0.73
18	601816	京沪高铁	17,500	93,975.00	0.68
19	601225	陕西煤业	3,500	90,195.00	0.65
20	600309	万华化学	1,100	88,946.00	0.65
21	600276	恒瑞医药	2,272	87,381.12	0.63
22	002714	牧原股份	1,988	86,676.80	0.63
23	000568	泸州老窖	600	86,094.00	0.63
24	600000	浦发银行	10,400	85,592.00	0.62
25	000333	美的集团	1,300	83,850.00	0.61
26	601857	中国石油	7,700	79,464.00	0.58
27	601668	中国建筑	14,800	78,588.00	0.57
28	600030	中信证券	4,310	78,571.30	0.57
29	600028	中国石化	11,500	72,680.00	0.53
30	601985	中国核电	6,800	72,488.00	0.53
31	601919	中远海控	4,620	71,563.80	0.52
32	600406	国电南瑞	2,866	71,535.36	0.52
33	000001	平安银行	6,900	70,035.00	0.51
34	688111	金山办公	300	68,250.00	0.50
35	601601	中国太保	2,400	66,864.00	0.49
36	600690	海尔智家	2,300	65,274.00	0.47
37	600150	中国船舶	1,600	65,136.00	0.47
38	601766	中国中车	8,600	64,586.00	0.47
39	002371	北方华创	200	63,978.00	0.46
40	300308	中际旭创	460	63,424.80	0.46
41	688041	海光信息	900	63,288.00	0.46
42	002352	顺丰控股	1,700	60,673.00	0.44
43	300059	东方财富	5,705	60,244.80	0.44
44	600887	伊利股份	2,300	59,432.00	0.43
45	601988	中国银行	12,500	57,750.00	0.42
46	601127	赛力斯	600	54,672.00	0.40
47	000725	京东方 A	13,200	53,988.00	0.39
48	603288	海天味业	1,560	53,773.20	0.39
49	603993	洛阳钼业	6,300	53,550.00	0.39

50	600050	中国联通	11,300	53,110.00	0.39
51	002142	宁波银行	2,400	52,944.00	0.38
52	601658	邮储银行	10,400	52,728.00	0.38
53	601818	光大银行	16,600	52,622.00	0.38
54	600019	宝钢股份	7,800	51,870.00	0.38
55	600031	三一重工	3,056	50,424.00	0.37
56	600886	国投电力	2,700	49,248.00	0.36
57	002304	洋河股份	609	49,170.66	0.36
58	600919	江苏银行	6,580	48,889.40	0.35
59	300498	温氏股份	2,460	48,757.20	0.35
60	300274	阳光电源	780	48,383.40	0.35
61	600016	民生银行	12,600	47,754.00	0.35
62	601390	中国中铁	7,300	47,596.00	0.35
63	603501	韦尔股份	465	46,207.05	0.34
64	601006	大秦铁路	6,300	45,108.00	0.33
65	600989	宝丰能源	2,600	45,058.00	0.33
66	600905	三峡能源	10,200	44,472.00	0.32
67	688271	联影医疗	400	43,880.00	0.32
68	601169	北京银行	7,500	43,800.00	0.32
69	601888	中国中免	700	43,743.00	0.32
70	605499	东鹏饮料	200	43,150.00	0.31
71	688012	中微公司	300	42,378.00	0.31
72	000596	古井贡酒	200	42,214.00	0.31
73	600436	片仔癀	200	41,434.00	0.30
74	000625	长安汽车	3,002	40,316.86	0.29
75	688256	寒武纪	200	39,734.00	0.29
76	000651	格力电器	1,000	39,220.00	0.28
77	000063	中兴通讯	1,400	39,158.00	0.28
78	000338	潍柴动力	2,400	38,976.00	0.28
79	601012	隆基绿能	2,760	38,695.20	0.28
80	002230	科大讯飞	900	38,655.00	0.28
81	601009	南京银行	3,700	38,443.00	0.28
82	603259	药明康德	980	38,406.20	0.28
83	600795	国电电力	6,400	38,336.00	0.28
84	688036	传音控股	500	38,270.00	0.28
85	688120	华海清科	200	37,916.00	0.28
86	600104	上汽集团	2,700	37,422.00	0.27
87	600048	保利发展	4,200	36,792.00	0.27
88	600999	招商证券	2,640	36,722.40	0.27
89	601229	上海银行	5,000	36,300.00	0.26
90	601211	国泰君安	2,668	36,151.40	0.26
91	601600	中国铝业	4,700	35,861.00	0.26
92	002938	鹏鼎控股	900	35,784.00	0.26

93	000792	盐湖股份	2,000	34,900.00	0.25
94	600346	恒力石化	2,500	34,875.00	0.25
95	002493	荣盛石化	3,600	34,776.00	0.25
96	000166	申万宏源	8,000	34,480.00	0.25
97	603986	兆易创新	360	34,423.20	0.25
98	300015	爱尔眼科	3,314	34,200.48	0.25
99	601669	中国电建	6,100	34,099.00	0.25
100	600660	福耀玻璃	700	33,530.00	0.24
101	600547	山东黄金	1,220	33,403.60	0.24
102	600585	海螺水泥	1,400	33,026.00	0.24
103	600893	航发动力	900	32,895.00	0.24
104	300433	蓝思科技	1,800	32,850.00	0.24
105	601688	华泰证券	2,600	32,214.00	0.23
106	600674	川投能源	1,700	31,875.00	0.23
107	600011	华能国际	3,300	31,746.00	0.23
108	002027	分众传媒	5,200	31,512.00	0.23
109	688169	石头科技	80	31,408.00	0.23
110	601628	中国人寿	1,000	31,050.00	0.23
111	601111	中国国航	4,200	30,996.00	0.23
112	000895	双汇发展	1,300	30,901.00	0.22
113	601066	中信建投	1,600	30,784.00	0.22
114	600188	兖矿能源	1,350	30,685.50	0.22
115	600438	通威股份	1,600	30,576.00	0.22
116	600015	华夏银行	4,707	30,124.80	0.22
117	000425	徐工机械	4,200	30,030.00	0.22
118	600837	海通证券	3,500	29,960.00	0.22
119	000538	云南白药	575	29,411.25	0.21
120	000100	TCL 科技	6,740	29,116.80	0.21
121	600023	浙能电力	4,000	28,440.00	0.21
122	601881	中国银河	2,600	28,236.00	0.21
123	002311	海大集团	600	28,230.00	0.20
124	300124	汇川技术	550	28,215.00	0.20
125	001979	招商蛇口	3,200	28,128.00	0.20
126	300014	亿纬锂能	702	28,023.84	0.20
127	600926	杭州银行	2,100	27,405.00	0.20
128	601995	中金公司	900	26,649.00	0.19
129	600845	宝信软件	815	26,022.95	0.19
130	003816	中国广核	5,600	25,928.00	0.19
131	601939	建设银行	3,500	25,900.00	0.19
132	000776	广发证券	2,100	25,557.00	0.19
133	002463	沪电股份	700	25,550.00	0.19
134	002241	歌尔股份	1,300	25,363.00	0.18
135	300122	智飞生物	900	25,227.00	0.18

136	600489	中金黄金	1,700	25,160.00	0.18
137	600089	特变电工	1,800	24,966.00	0.18
138	300394	天孚通信	280	24,757.60	0.18
139	601872	招商轮船	2,900	24,505.00	0.18
140	600115	中国东航	6,100	24,461.00	0.18
141	601868	中国能建	11,500	24,380.00	0.18
142	000002	万科 A	3,500	24,255.00	0.18
143	300896	爱美客	140	24,094.00	0.17
144	601100	恒立液压	516	24,035.28	0.17
145	600029	南方航空	4,000	23,560.00	0.17
146	601825	沪农商行	3,500	23,520.00	0.17
147	603369	今世缘	500	23,100.00	0.17
148	688008	澜起科技	400	22,864.00	0.17
149	603392	万泰生物	347	22,860.36	0.17
150	601633	长城汽车	900	22,770.00	0.17
151	600010	包钢股份	16,200	22,680.00	0.16
152	601901	方正证券	2,900	22,417.00	0.16
153	002648	卫星化学	1,245	22,385.10	0.16
154	603195	公牛集团	290	22,364.80	0.16
155	000938	紫光股份	1,000	22,350.00	0.16
156	300782	卓胜微	284	22,078.16	0.16
157	000977	浪潮信息	600	21,822.00	0.16
158	600160	巨化股份	900	21,717.00	0.16
159	600027	华电国际	3,100	21,514.00	0.16
160	601689	拓普集团	400	21,444.00	0.16
161	688223	晶科能源	3,000	21,300.00	0.15
162	300661	圣邦股份	257	21,274.46	0.15
163	601916	浙商银行	7,700	21,252.00	0.15
164	002916	深南电路	200	21,154.00	0.15
165	002001	新和成	1,100	21,120.00	0.15
166	300502	新易盛	200	21,110.00	0.15
167	600703	三安光电	1,800	21,096.00	0.15
168	601336	新华保险	700	21,021.00	0.15
169	600039	四川路桥	2,640	20,829.60	0.15
170	000983	山西焦煤	2,020	20,826.20	0.15
171	605117	德业股份	280	20,815.20	0.15
172	300033	同花顺	200	20,740.00	0.15
173	600066	宇通客车	800	20,640.00	0.15
173	600111	北方稀土	1,200	20,640.00	0.15
174	600426	华鲁恒升	770	20,512.80	0.15
175	601788	光大证券	1,400	20,468.00	0.15
176	600233	圆通速递	1,300	20,345.00	0.15
177	600026	中远海能	1,300	20,293.00	0.15

178	300832	新产业	300	20,232.00	0.15
179	001965	招商公路	1,700	20,162.00	0.15
180	600958	东方证券	2,644	20,094.40	0.15
181	300751	迈为股份	168	20,072.64	0.15
182	002028	思源电气	300	20,070.00	0.15
183	002736	国信证券	2,300	19,987.00	0.15
184	601699	潞安环能	1,100	19,943.00	0.14
185	601618	中国中冶	6,400	19,840.00	0.14
186	601838	成都银行	1,300	19,747.00	0.14
187	300408	三环集团	665	19,411.35	0.14
188	601360	三六零	2,511	19,284.48	0.14
189	000157	中联重科	2,500	19,200.00	0.14
190	000301	东方盛虹	2,400	19,128.00	0.14
191	601607	上海医药	1,000	19,110.00	0.14
192	600085	同仁堂	500	19,105.00	0.14
193	600584	长电科技	600	19,026.00	0.14
194	600522	中天科技	1,200	19,020.00	0.14
195	600183	生益科技	900	18,954.00	0.14
196	002252	上海莱士	2,400	18,768.00	0.14
197	002236	大华股份	1,200	18,552.00	0.13
198	300866	安克创新	260	18,514.60	0.13
199	600875	东方电气	1,000	18,450.00	0.13
200	000661	长春高新	200	18,354.00	0.13
201	601117	中国化学	2,200	18,128.00	0.13
202	600741	华域汽车	1,100	18,018.00	0.13
203	002466	天齐锂业	600	17,946.00	0.13
204	000999	华润三九	420	17,883.60	0.13
205	002600	领益智造	2,500	17,800.00	0.13
206	000786	北新建材	600	17,796.00	0.13
206	688099	晶晨股份	300	17,796.00	0.13
207	600196	复星医药	800	17,712.00	0.13
208	000807	云铝股份	1,300	17,563.00	0.13
209	601319	中国人保	3,400	17,510.00	0.13
210	601567	三星医疗	500	17,500.00	0.13
211	002920	德赛西威	200	17,418.00	0.13
212	600803	新奥股份	832	17,305.60	0.13
213	688072	拓荆科技	142	17,055.62	0.12
214	688363	华熙生物	300	16,971.00	0.12
215	688082	盛美上海	200	16,902.00	0.12
216	601021	春秋航空	300	16,899.00	0.12
217	002128	电投能源	800	16,880.00	0.12
218	601058	赛轮轮胎	1,200	16,800.00	0.12
219	002601	龙佰集团	900	16,713.00	0.12

220	000963	华东医药	600	16,686.00	0.12
221	601727	上海电气	4,500	16,650.00	0.12
222	000630	铜陵有色	4,600	16,606.00	0.12
223	600362	江西铜业	700	16,576.00	0.12
224	000617	中油资本	3,000	16,560.00	0.12
225	000708	中信特钢	1,200	16,284.00	0.12
226	000933	神火股份	800	16,184.00	0.12
227	300628	亿联网络	440	16,178.80	0.12
228	600733	北汽蓝谷	2,000	16,160.00	0.12
229	601168	西部矿业	900	16,155.00	0.12
230	600009	上海机场	500	16,125.00	0.12
231	300418	昆仑万维	500	16,120.00	0.12
232	688122	西部超导	420	16,094.40	0.12
233	600256	广汇能源	2,400	16,080.00	0.12
234	600219	南山铝业	4,200	16,002.00	0.12
235	601377	兴业证券	3,110	15,736.60	0.11
236	603338	浙江鼎力	260	15,709.20	0.11
237	600398	海澜之家	1,700	15,708.00	0.11
238	000975	山金国际	960	15,638.40	0.11
239	601077	渝农商行	3,100	15,562.00	0.11
240	000876	新希望	1,700	15,538.00	0.11
241	301269	华大九天	200	15,410.00	0.11
242	600176	中国巨石	1,388	15,337.40	0.11
243	600221	海航控股	15,000	15,300.00	0.11
244	601877	正泰电器	800	15,248.00	0.11
245	002422	科伦药业	500	15,165.00	0.11
246	600985	淮北矿业	900	15,066.00	0.11
247	002223	鱼跃医疗	400	15,040.00	0.11
248	600642	申能股份	1,700	15,011.00	0.11
249	601878	浙商证券	1,400	15,008.00	0.11
250	688009	中国通号	2,500	15,000.00	0.11
251	688396	华润微	400	14,976.00	0.11
252	002460	赣锋锂业	520	14,898.00	0.11
253	600415	小商品城	2,000	14,840.00	0.11
254	688187	时代电气	300	14,814.00	0.11
255	600332	白云山	500	14,665.00	0.11
256	600161	天坛生物	600	14,640.00	0.11
257	300999	金龙鱼	533	14,577.55	0.11
258	600600	青岛啤酒	200	14,554.00	0.11
259	601179	中国西电	1,800	14,472.00	0.11
260	600018	上港集团	2,500	14,450.00	0.10
261	300442	润泽科技	600	14,370.00	0.10
262	300316	晶盛机电	500	14,365.00	0.10

263	601233	桐昆股份	900	14,364.00	0.10
264	600487	亨通光电	900	14,193.00	0.10
265	600918	中泰证券	2,500	14,175.00	0.10
266	600745	闻泰科技	500	14,125.00	0.10
267	601865	福莱特	700	14,070.00	0.10
268	002353	杰瑞股份	400	14,032.00	0.10
269	603260	合盛硅业	300	14,013.00	0.10
270	002078	太阳纸业	1,000	13,950.00	0.10
271	603806	福斯特	948	13,935.60	0.10
272	002625	光启技术	800	13,880.00	0.10
273	688126	沪硅产业	1,000	13,810.00	0.10
274	603160	汇顶科技	200	13,750.00	0.10
275	688065	凯赛生物	300	13,617.00	0.10
276	603659	璞泰来	960	13,564.80	0.10
277	688599	天合光能	800	13,536.00	0.10
278	002156	通富微电	600	13,434.00	0.10
279	601991	大唐发电	4,400	13,244.00	0.10
280	002180	纳思达	500	13,210.00	0.10
281	601238	广汽集团	1,700	13,158.00	0.10
282	002459	晶澳科技	1,172	13,126.40	0.10
283	600061	国投资本	2,300	12,995.00	0.09
284	002532	天山铝业	1,600	12,976.00	0.09
285	002064	华峰化学	1,800	12,906.00	0.09
286	600515	海南机场	4,100	12,874.00	0.09
287	600418	江淮汽车	800	12,672.00	0.09
288	002049	紫光国微	240	12,624.00	0.09
289	300765	新诺威	500	12,615.00	0.09
290	603799	华友钴业	570	12,614.10	0.09
291	600588	用友网络	1,260	12,600.00	0.09
292	002409	雅克科技	200	12,582.00	0.09
293	002129	TCL 中环	1,450	12,542.50	0.09
294	300413	芒果超媒	600	12,540.00	0.09
295	000423	东阿阿胶	200	12,520.00	0.09
296	601958	金钼股份	1,200	12,492.00	0.09
297	002384	东山精密	600	12,420.00	0.09
298	600060	海信视像	500	12,370.00	0.09
299	688303	大全能源	600	12,234.00	0.09
300	600570	恒生电子	691	12,203.06	0.09
301	600132	重庆啤酒	200	12,140.00	0.09
302	603290	斯达半导	140	12,055.40	0.09
303	000408	藏格矿业	500	12,035.00	0.09
304	000988	华工科技	400	11,972.00	0.09
305	600348	华阳股份	1,200	11,952.00	0.09

306	603893	瑞芯微	200	11,834.00	0.09
307	301236	软通动力	336	11,830.56	0.09
308	000027	深圳能源	1,620	11,826.00	0.09
309	603833	欧派家居	220	11,783.20	0.09
310	603939	益丰药房	478	11,734.90	0.09
311	600096	云天化	600	11,652.00	0.08
312	603568	伟明环保	560	11,524.80	0.08
313	603198	迎驾贡酒	200	11,500.00	0.08
314	002074	国轩高科	600	11,490.00	0.08
315	002340	格林美	1,800	11,466.00	0.08
316	601577	长沙银行	1,400	11,452.00	0.08
317	002595	豪迈科技	300	11,451.00	0.08
318	002050	三花智控	600	11,448.00	0.08
319	600702	舍得酒业	200	11,334.00	0.08
320	600177	雅戈尔	1,580	11,249.60	0.08
321	002709	天赐材料	640	11,238.40	0.08
322	002281	光迅科技	300	11,211.00	0.08
323	601799	星宇股份	100	11,204.00	0.08
324	300223	北京君正	200	11,088.00	0.08
325	601216	君正集团	3,000	11,070.00	0.08
326	601966	玲珑轮胎	600	11,022.00	0.08
327	601928	凤凰传媒	1,000	10,960.00	0.08
328	600282	南钢股份	2,200	10,956.00	0.08
329	688777	中控技术	290	10,933.00	0.08
330	603596	伯特利	280	10,892.00	0.08
331	600970	中材国际	900	10,854.00	0.08
332	601108	财通证券	1,630	10,774.30	0.08
333	000738	航发控制	533	10,697.31	0.08
334	002294	信立泰	400	10,652.00	0.08
335	603156	养元饮品	500	10,635.00	0.08
336	000932	华菱钢铁	2,400	10,632.00	0.08
337	002085	万丰奥威	800	10,592.00	0.08
338	601555	东吴证券	1,790	10,561.00	0.08
339	600460	士兰微	600	10,506.00	0.08
340	000066	中国长城	1,200	10,500.00	0.08
341	002555	三七互娱	800	10,440.00	0.08
342	300003	乐普医疗	700	10,388.00	0.08
343	600582	天地科技	1,500	10,335.00	0.08
344	600352	浙江龙盛	1,200	10,308.00	0.07
345	600546	山煤国际	700	10,234.00	0.07
346	002821	凯莱英	155	10,199.00	0.07
347	000831	中国稀土	400	10,140.00	0.07
348	300454	深信服	200	10,106.00	0.07

348	603979	金诚信	200	10,106.00	0.07
349	601666	平煤股份	900	10,080.00	0.07
350	002032	苏泊尔	200	10,020.00	0.07
350	600873	梅花生物	1,000	10,020.00	0.07
351	601990	南京证券	1,300	9,984.00	0.07
352	300919	中伟股份	320	9,916.80	0.07
353	002673	西部证券	1,600	9,904.00	0.07
354	600021	上海电力	1,000	9,890.00	0.07
355	600968	海油发展	2,400	9,888.00	0.07
356	002444	巨星科技	400	9,880.00	0.07
357	600153	建发股份	1,100	9,823.00	0.07
358	600109	国金证券	1,300	9,815.00	0.07
359	600988	赤峰黄金	600	9,804.00	0.07
360	002185	华天科技	1,200	9,780.00	0.07
361	603606	东方电缆	200	9,762.00	0.07
362	300759	康龙化成	525	9,754.50	0.07
363	002966	苏州银行	1,300	9,750.00	0.07
364	300347	泰格医药	200	9,720.00	0.07
365	688728	格科微	800	9,688.00	0.07
366	603816	顾家家居	300	9,687.00	0.07
367	000921	海信家电	300	9,672.00	0.07
367	002739	万达电影	800	9,672.00	0.07
368	300957	贝泰妮	200	9,664.00	0.07
369	000783	长江证券	2,000	9,660.00	0.07
370	601231	环旭电子	600	9,630.00	0.07
371	600497	驰宏锌锗	1,800	9,612.00	0.07
372	601198	东兴证券	1,200	9,552.00	0.07
373	600566	济川药业	300	9,513.00	0.07
374	002262	恩华药业	400	9,496.00	0.07
375	002812	恩捷股份	300	9,495.00	0.07
376	688114	华大智造	200	9,482.00	0.07
377	002007	华兰生物	600	9,474.00	0.07
378	600583	海油工程	1,600	9,456.00	0.07
379	603486	科沃斯	200	9,436.00	0.07
380	002152	广电运通	900	9,414.00	0.07
381	603899	晨光股份	300	9,384.00	0.07
382	002939	长城证券	1,400	9,380.00	0.07
383	600521	华海药业	550	9,377.50	0.07
384	002456	欧菲光	1,200	9,372.00	0.07
385	000728	国元证券	1,540	9,332.40	0.07
386	002465	海格通信	900	9,324.00	0.07
387	600157	永泰能源	7,900	9,322.00	0.07
388	600895	张江高科	500	9,240.00	0.07

389	603658	安图生物	200	9,214.00	0.07
390	002414	高德红外	1,559	9,182.51	0.07
391	300496	中科创达	200	9,118.00	0.07
392	300207	欣旺达	600	9,102.00	0.07
393	601696	中银证券	1,000	9,080.00	0.07
394	600872	中炬高新	400	9,076.00	0.07
395	000703	恒逸石化	1,280	9,075.20	0.07
396	002602	世纪华通	2,640	9,055.20	0.07
397	600486	扬农化工	160	9,032.00	0.07
398	601866	中远海发	3,500	9,030.00	0.07
399	000683	远兴能源	1,300	8,983.00	0.07
400	002756	永兴材料	250	8,945.00	0.06
401	002603	以岭药业	580	8,891.40	0.06
402	000729	燕京啤酒	1,000	8,830.00	0.06
403	603885	吉祥航空	800	8,792.00	0.06
404	002202	金风科技	1,300	8,736.00	0.06
405	000937	冀中能源	1,300	8,710.00	0.06
406	600298	安琪酵母	311	8,686.23	0.06
407	601456	国联证券	900	8,676.00	0.06
408	600549	厦门钨业	500	8,625.00	0.06
409	000800	一汽解放	1,100	8,613.00	0.06
410	600369	西南证券	2,400	8,592.00	0.06
411	600079	人福医药	500	8,585.00	0.06
412	600004	白云机场	900	8,532.00	0.06
413	600998	九州通	1,741	8,496.08	0.06
414	300251	光线传媒	1,000	8,410.00	0.06
415	300487	蓝晓科技	200	8,352.00	0.06
416	000733	振华科技	200	8,306.00	0.06
417	000629	钒钛股份	3,300	8,250.00	0.06
418	600704	物产中大	1,900	8,246.00	0.06
419	601880	辽港股份	6,700	8,241.00	0.06
420	600038	中直股份	200	8,222.00	0.06
421	002120	韵达股份	1,060	8,204.40	0.06
422	603529	爱玛科技	300	8,199.00	0.06
423	300146	汤臣倍健	600	8,130.00	0.06
424	688538	和辉光电	4,100	8,118.00	0.06
425	600072	中船科技	600	8,112.00	0.06
426	603728	鸣志电器	200	8,046.00	0.06
427	600848	上海临港	880	8,016.80	0.06
428	300037	新宙邦	280	7,996.80	0.06
429	603000	人民网	400	7,996.00	0.06
430	603589	口子窖	200	7,838.00	0.06
431	000960	锡业股份	500	7,745.00	0.06

432	600673	东阳光	1,100	7,744.00	0.06
433	000009	中国宝安	900	7,740.00	0.06
433	002080	中材科技	600	7,740.00	0.06
434	002372	伟星新材	500	7,710.00	0.06
435	002831	裕同科技	300	7,677.00	0.06
436	002517	恺英网络	800	7,640.00	0.06
437	002850	科达利	100	7,638.00	0.06
438	002797	第一创业	1,500	7,635.00	0.06
439	600563	法拉电子	100	7,618.00	0.06
440	000723	美锦能源	1,600	7,616.00	0.06
441	600779	水井坊	200	7,526.00	0.05
442	600598	北大荒	600	7,494.00	0.05
443	600536	中国软件	250	7,480.00	0.05
444	000513	丽珠集团	200	7,442.00	0.05
445	603345	安井食品	100	7,431.00	0.05
446	600699	均胜电子	500	7,410.00	0.05
447	000987	越秀资本	1,488	7,380.48	0.05
448	600637	东方明珠	1,200	7,296.00	0.05
449	600655	豫园股份	1,400	7,210.00	0.05
450	600839	四川长虹	1,600	7,184.00	0.05
451	000709	河钢股份	3,700	7,178.00	0.05
452	300144	宋城演艺	861	6,913.83	0.05
453	600754	锦江酒店	300	6,894.00	0.05
454	600705	中航产融	3,100	6,882.00	0.05
455	000825	太钢不锈	2,000	6,760.00	0.05
456	601162	天风证券	3,100	6,758.00	0.05
457	600380	健康元	600	6,702.00	0.05
458	002430	杭氧股份	300	6,675.00	0.05
459	600170	上海建工	3,100	6,665.00	0.05
460	002508	老板电器	300	6,630.00	0.05
461	600884	杉杉股份	800	6,496.00	0.05
462	600977	中国电影	600	6,456.00	0.05
463	300699	光威复材	260	6,455.80	0.05
464	600166	福田汽车	2,800	6,300.00	0.05
465	300763	锦浪科技	150	6,246.00	0.05
466	002056	横店东磁	500	6,235.00	0.05
467	002271	东方雨虹	500	6,170.00	0.04
468	600511	国药股份	200	6,158.00	0.04
469	300601	康泰生物	386	6,025.46	0.04
470	002841	视源股份	203	5,994.59	0.04
471	603688	石英股份	200	5,922.00	0.04
472	600732	爱旭股份	640	5,792.00	0.04
473	600378	昊华科技	200	5,780.00	0.04

474	300142	沃森生物	500	5,690.00	0.04
475	603233	大参林	385	5,505.50	0.04
476	603882	金域医学	200	5,438.00	0.04
477	002738	中矿资源	200	5,360.00	0.04
478	603077	和邦生物	3,100	5,115.00	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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	100,992.00	0.59
2	300760	迈瑞医疗	29,624.00	0.17
3	600809	山西汾酒	23,050.00	0.13
4	001965	招商公路	22,939.00	0.13
5	000708	中信特钢	22,770.00	0.13
6	605499	东鹏饮料	21,816.00	0.13
7	603979	金诚信	17,145.00	0.10
8	000921	海信家电	16,300.00	0.09
9	601567	三星医疗	15,936.00	0.09
10	601881	中国银河	15,300.00	0.09
11	002085	万丰奥威	14,890.00	0.09
12	000858	五粮液	14,737.00	0.09
13	600282	南钢股份	14,672.00	0.09
14	601666	平煤股份	14,542.00	0.08
15	688114	华大智造	14,318.00	0.08
16	688041	海光信息	14,064.00	0.08
17	600582	天地科技	13,642.00	0.08
18	600968	海油发展	13,082.00	0.08
19	300782	卓胜微	9,276.00	0.05
20	002916	深南电路	9,059.00	0.05

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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	75,372.00	0.44
2	000858	五粮液	53,732.00	0.31
3	002594	比亚迪	50,870.00	0.30
4	002371	北方华创	32,811.00	0.19

5	300760	迈瑞医疗	29,304.00	0.17
6	002475	立讯精密	26,593.00	0.15
7	688516	奥特维	24,992.20	0.14
8	300033	同花顺	24,754.00	0.14
9	002916	深南电路	24,698.00	0.14
10	002714	牧原股份	22,083.00	0.13
11	603737	三棵树	20,287.44	0.12
12	002920	德赛西威	19,707.00	0.11
13	300782	卓胜微	19,506.00	0.11
14	000001	平安银行	19,228.00	0.11
15	000333	美的集团	19,200.00	0.11
16	300059	东方财富	18,360.00	0.11
17	002352	顺丰控股	18,145.00	0.11
18	000568	泸州老窖	15,399.00	0.09
19	000725	京东方 A	15,155.00	0.09
20	688301	奕瑞科技	14,961.60	0.09

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	821,800.00
卖出股票收入（成交）总额	2,061,197.89

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局深圳监管局、国家外汇管理局深圳市分局的处罚；中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚。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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	114.72
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
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	114.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有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

注：本基金本报告期末不存在指数投资前十名股票流通受限情况。

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

注：本基金本报告期末不存在积极投资前五名股票流通受限情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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 (%)
201	58,632.61	9,070,755.00	76.97	2,714,400.00	23.03

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

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
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	5,145,500.00	43.66

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	广发证券股份有限公司	2,027,521.00	17.20
2	华泰证券股份有限公司	1,618,095.00	13.73
3	沈晨波	330,000.00	2.80
4	中信证券股份有限公司	279,639.00	2.37
5	郭晓靖	162,000.00	1.37
6	戴克阳	150,000.00	1.27
7	贺珊君	100,000.00	0.85
7	林良通	100,000.00	0.85
7	宗兰	100,000.00	0.85
10	俞春东	99,700.00	0.85
11	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	5,145,500.00	43.66

注：前十名持有人为除浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

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	0.00

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、基金投资和研发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
本报告期期初基金份额总额	14,785,155.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	11,785,155.00

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，本基金基金管理人无重大人事变动。

报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人重大人事变动如下：

2024年7月1日，张弛先生新任公司总经理，郁蓓华女士离任公司总经理。具体信息请参见基金管理人于2024年7月2日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

10.6.1 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，管理人及其高级管理人员无受到有权机关调查、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。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本基金本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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 (%)	
华泰证券	2	2,039,401.50	70.74	1,521.22	65.59	-
天风证券	1	843,596.39	29.26	798.07	34.41	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；
具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；
佣金费率合理；
本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；
基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

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 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024 年 1 月 22 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 2023 年年度报告	规定网站	2024 年 3 月 30 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 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024 年 4 月 22 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基金产品资料概要更新	规定网站	2024 年 4 月 26 日
5	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(更新) 2024 年第 1 号	规定网站	2024 年 4 月 26 日
6	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产品资料概要更新	规定网站	2024 年 6 月 26 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

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	20240101-202 40630	5,357,900 .00	1,217,90 0.00	1,430,300 .00	5,145,500.00	43.66
产品特有风险							
<p>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。</p>							

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 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规定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 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

2024 年 8 月 31 日