

浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基
金
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛中证 A50 指数增强
基金主代码	021256
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2024 年 5 月 31 日
报告期末基金份额总额	389,050,209.16 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 A50 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	在正常市场情况下，本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。本基金以中证 A50 指数为标的指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制标的指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪标的指数的同时，力争获得超越标的指数的收益。本基金的资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、资产支持证券投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 A50 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期

	收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛中证 A50 指数增强 A	浦银安盛中证 A50 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	021256	021257
报告期末下属分级基金的份额总额	270,541,549.14 份	118,508,660.02 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）	
	浦银安盛中证 A50 指数增强 A	浦银安盛中证 A50 指数增强 C
1. 本期已实现收益	1,771,056.02	603,136.85
2. 本期利润	49,852,413.98	21,695,996.88
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1351	0.1159
4. 期末基金资产净值	316,349,014.05	138,383,356.55
5. 期末基金份额净值	1.1693	1.1677

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛中证 A50 指数增强 A

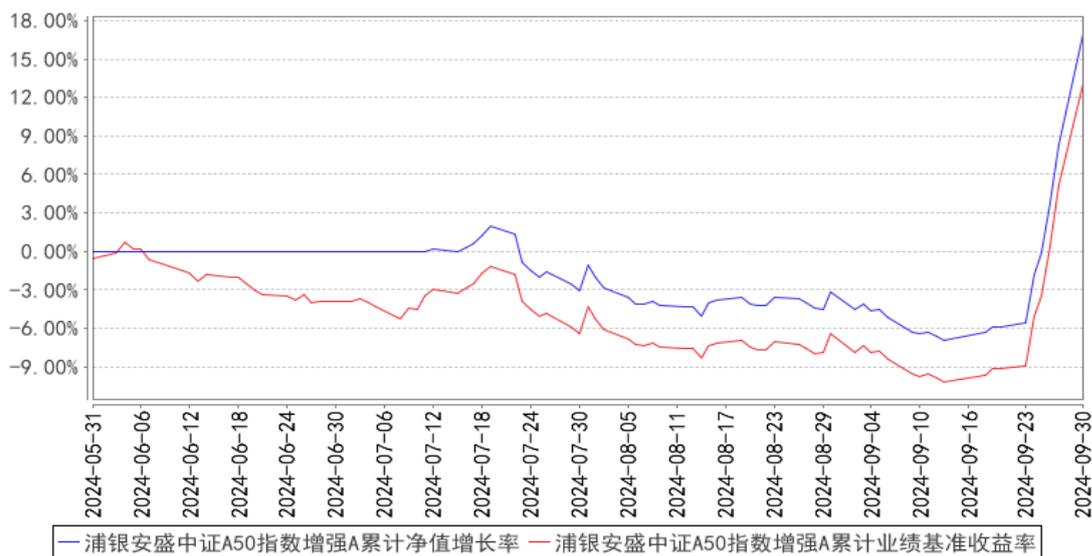
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.91%	1.48%	17.69%	1.51%	-0.78%	-0.03%
自基金合同生效起至今	16.93%	1.29%	13.08%	1.34%	3.85%	-0.05%

浦银安盛中证 A50 指数增强 C

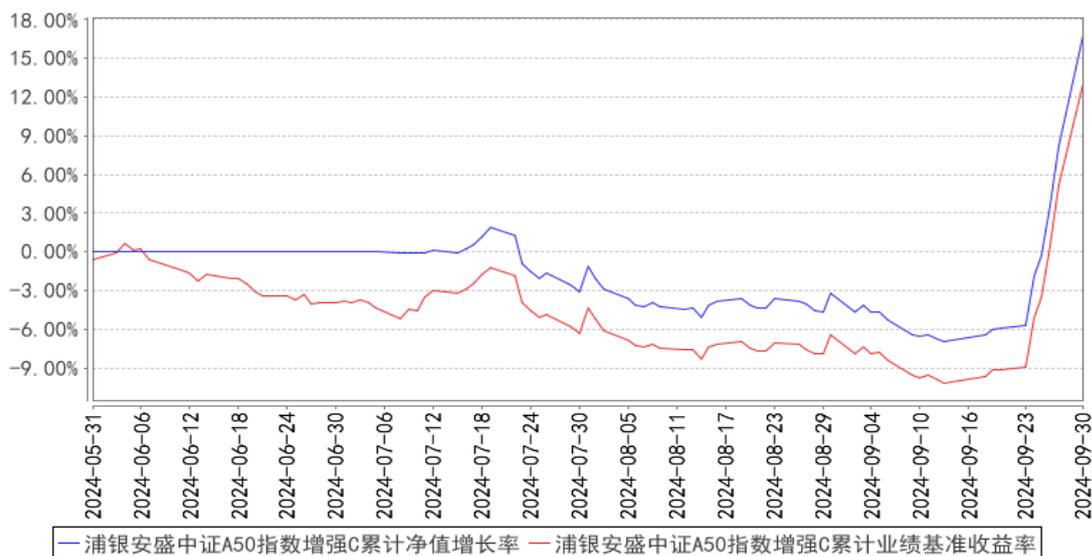
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.78%	1.48%	17.69%	1.51%	-0.91%	-0.03%
自基金合同生效起至今	16.77%	1.29%	13.08%	1.34%	3.69%	-0.05%

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

浦银安盛中证A50指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



浦银安盛中证A50指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同生效日为 2024 年 5 月 31 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满足 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 2024 年 5 月 31 日至 2024 年 11 月 30 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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗雯	本基金的基金经理	2024 年 5 月 31 日	-	16 年	罗雯女士，浙江大学理学院数学系金融数学硕士。2007 年 10 月加盟浦银安盛基金管理有限公司任金融工程分析师。2011 年 7 月至 2018 年 1 月，担任公司旗下指数基金基金经理助理，现任指数及量化投资部基金经理。2018 年 1 月至 2022 年 12 月担任浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2022 年 11 月至 2022 年 12 月担任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金和浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 LOF 的基金经理。2021 年 11 月起，担任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的基金经理。2022 年 11 月起担任浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金和浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 5 月起担任浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月起担任浦银安盛上证科创板 100 指数增强型证券投资基金的基金经理。
孙晨进	公司指数与量化投资部总监，公司旗下部分基金基金经理	2024 年 9 月 3 日	-	14 年	孙晨进，武汉大学金融工程专业硕士。2010 年 7 月至 2021 年 1 月就职于华安基金管理有限公司指数与量化投资部，历任数量分析师、投资经理、基金经理、量化业务负责人、助理总监等职务。2021 年 2 月至 2023 年 2 月就职于申万菱信基金管理有限公司，历任量化投资部总监、基金经理、基金经理兼投资经理等职务。2023 年 3 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，

					现任指数与量化投资部总监之职。2024 年 9 月起担任浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1 日、3 日、5 日、10 日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他投资组合参与的交易所公开竞价

同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

今年三季度以来，市场在底部企稳，并在 9 月最后一周快速反弹。从新增的货币、财政政策来看，政府明确表达了稳经济、稳地产、稳预期的意图，在流动性、化债和地产等方面出台一揽子刺激政策。沪深两市放量反弹，9 月末沪指回到 3300 点上方，深证成指突破 10000 点大关，双双收复年内失地，从行业角度来看，三季度涨幅较高的为非银金融、地产，而高股息板块如煤炭、石油石化和公用事业涨幅靠后。从反弹节奏来看，在货币和流动性宽松引领下，市场从超跌板块的估值修复逐步扩散至长久期的成长板块。

本报告期内，本基金逐步完成建仓，期初回避了部分市场回撤，之后紧跟指数操作，在三季度期间获得了正收益并跑赢基准指数。报告期内，以量化投资策略为主，并结合基本面灵活调整的投资框架给基金的选股和行业配置带来了一定的超额收益。展望后市，看好以中证 A50 指数成分股为代表的核心资产，有望受益于本轮货币、财政政策的双重刺激和增量资金配置。

展望后市，建议重点关注稳增长受益以及中长期资金入市两条主线，前者重点关注稳增长政策力度及方向，后者以低估值核心资产为主，把握中长期资金入市带来的长期机会。本基金会在严控风险的情况下优选估值合理，基本面向上的优质标的进行配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银安盛中证 A50 指数增强 A 的基金份额净值为 1.1693 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.91%，同期业绩比较基准收益率为 17.69%，截至本报告期末浦银安盛中证 A50 指数增强 C 的基金份额净值为 1.1677 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.78%，同期业绩比较基准收益率为 17.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	424,562,820.82	77.77
	其中：股票	424,562,820.82	77.77
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	53,455,540.67	9.79
8	其他资产	67,916,371.85	12.44
9	合计	545,934,733.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	5,476,620.60	1.20
B	采矿业	26,183,672.80	5.76
C	制造业	246,387,403.10	54.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,024,335.00	3.08
E	建筑业	8,207,658.00	1.80
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	6,720,012.00	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,835,354.00	3.70
J	金融业	66,490,254.00	14.62
K	房地产业	1,361,772.00	0.30
L	租赁和商务服务业	7,109,463.00	1.56
M	科学研究和技术服务业	6,000,456.00	1.32
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	924,371.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	405,721,371.50	89.22

5.2.2 报告期末积极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	-	-
B	采矿业	1,538,240.00	0.34
C	制造业	8,773,582.00	1.93

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业		-
E	建筑业		-
F	批发和零售业	2,529,540.00	0.56
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	4,007,059.32	0.88
J	金融业	1,169,883.00	0.26
K	房地产业		-
L	租赁和商务服务业	823,145.00	0.18
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	18,841,449.32	4.14

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	25,300	44,224,400.00	9.73
2	300750	宁德时代	154,500	38,917,005.00	8.56
3	601318	中国平安	531,400	30,337,626.00	6.67
4	600036	招商银行	542,800	20,414,708.00	4.49
5	600276	恒瑞医药	345,900	18,090,570.00	3.98
6	002594	比亚迪	54,000	16,594,740.00	3.65
7	601899	紫金矿业	910,600	16,518,284.00	3.63
8	000333	美的集团	213,700	16,254,022.00	3.57
9	600030	中信证券	578,600	15,737,920.00	3.46
10	600900	长江电力	466,700	14,024,335.00	3.08

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	000538	云南白药	44,100	2,690,100.00	0.59
2	601607	上海医药	119,600	2,529,540.00	0.56
3	688111	金山办公	8,859	2,360,037.60	0.52
4	600845	宝信软件	48,300	1,593,417.00	0.35
5	600489	中金黄金	101,200	1,538,240.00	0.34

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2412	中证 500 期货 2412	2	2,355,040.00	509,760.00	-
IF2412	沪深 300 期货 2412	4	4,962,720.00	1,152,780.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,662,540.00
股指期货投资本期收益（元）					232,644.15
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,662,540.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本产品投资一定比例的股指期货多头，主要是应对基金的流动性需求和超额收益需求。本产品产品在宽基指数为基准的期货品种中进行了多品种的配置。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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；中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	975,657.06
2	应收证券清算款	60,871,341.35
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,069,373.44
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	67,916,371.85

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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的情况。

5.11.5.2 报告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的情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛中证 A50 指数增强 A	浦银安盛中证 A50 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	548,813,134.85	382,686,943.20
报告期期间基金总申购份额	36,445,621.08	16,848,047.98
减：报告期期间基金总赎回份额	314,717,206.79	281,026,331.16
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	270,541,549.14	118,508,660.02

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息**8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况**

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、 中国证监会批准浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金募集的文件
- 2、 浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、 浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金招募说明书
- 4、 浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金托管协议
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、 基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、 本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告
- 8、 中国证监会要求的其他文件

9.2 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。

9.3 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 10 月 25 日