

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数  
证券投资基金  
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	18
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>20</b>
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>51</b>

8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>65</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末上市基金前十名持有人	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>66</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>67</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
11.4 基金投资策略的改变	68
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	68
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.8 其他重大事件	69
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>71</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	71
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>71</b>
13.1 备查文件目录	71
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	72

## § 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	8,785,155.00 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	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	张健	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-1,107,456.89	-5,247,329.24	-39,583,409.51
本期利润	1,958,653.15	96,829.07	-55,321,841.31
加权平均基金份额本期利润	0.1531	0.0042	-0.4100
本期加权平均净值利润率	12.77%	0.32%	-28.83%
本期基金份额净值增长率	13.22%	-12.10%	-18.78%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	1,846,230.61	2,453,635.94	19,521,451.56
期末可供分配基金份额利润	0.2102	0.1660	0.3265
期末基金资产净值	11,597,016.02	17,238,790.94	79,306,606.56
期末基金	1.3201	1.1660	1.3265

份额净值			
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	32.01%	16.60%	32.65%

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。

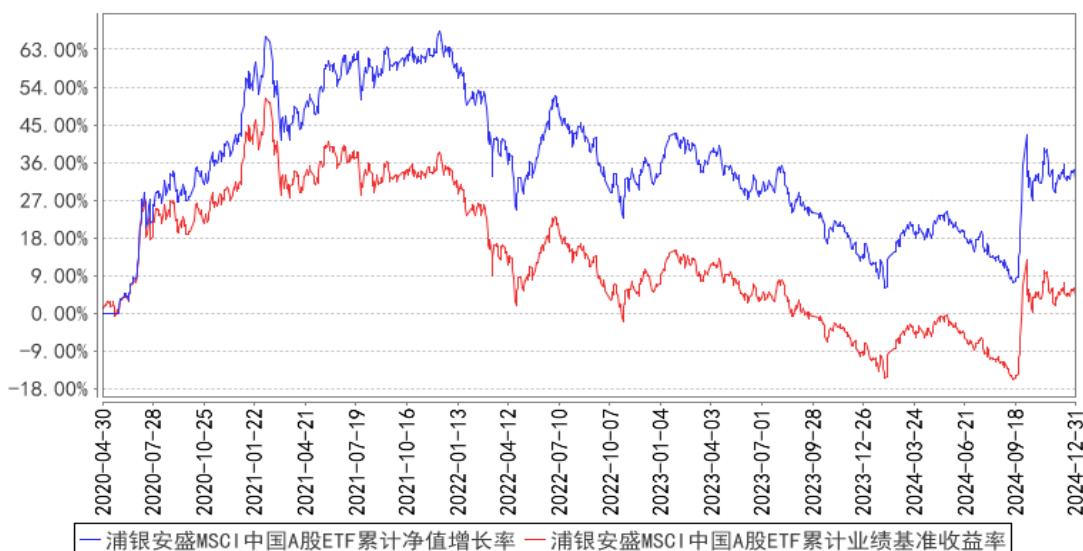
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	-2.37%	1.68%	-2.47%	1.71%	0.10%	-0.03%
过去六个月	12.95%	1.63%	12.14%	1.66%	0.81%	-0.03%
过去一年	13.22%	1.34%	12.14%	1.37%	1.08%	-0.03%
过去三年	-19.17%	1.15%	-22.70%	1.18%	3.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	32.01%	1.16%	4.10%	1.19%	27.91%	-0.03%

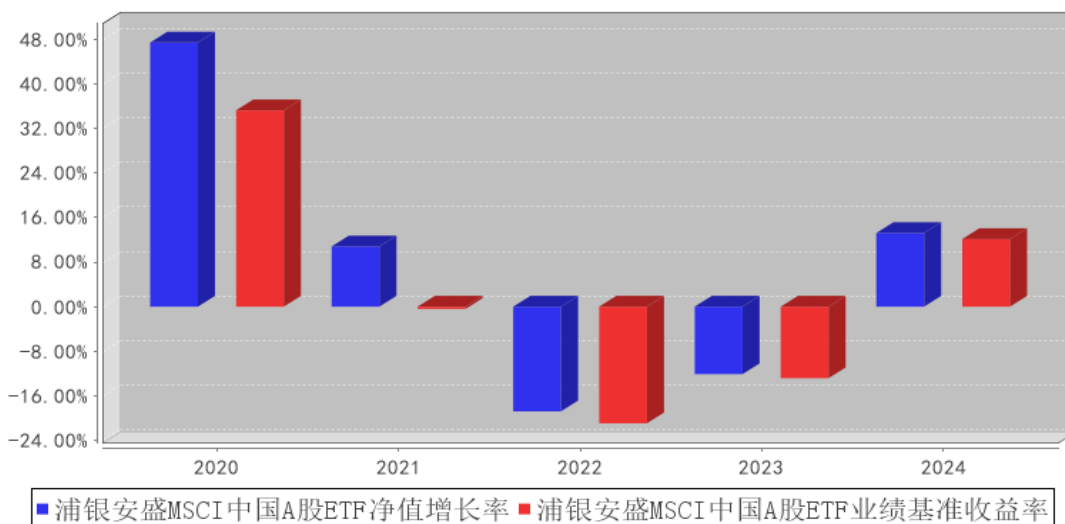
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

浦银安盛MSCI中国A股ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2020 年 4 月 30 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未进行过利润分配。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，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 12 月 31 日止，浦银安盛旗下共管理 107 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、浦银安盛盛焯 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、

浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 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 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛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基金中基金 (FOF)、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基金中基金 (FOF)、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、浦银安盛普安利率债券型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (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、浦银安盛上证科创板 100 指数增强型证券投资基金、浦银安盛红利量化选股混合型证券投资基金、浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金。

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	公司指数与量化投资部业务主管，公司旗下部分基金基金经理。	2020年6月4日	-	14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。

				<p>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。2023 年 1 月至 2024 年 11 月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。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 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。</p>
--	--	--	--	---

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

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

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

管理人制定了《浦银安盛基金管理有限公司公平交易管理规定》，并进行了多次修订。现行公平交易管理规定分为总则、实现公平交易的具体措施、公平交易监控与实施效果评估、公平交易的报告和信息披露、隔离及保密、附则等六部分。公平交易管理规定从投资决策、研究支持、交易实施、监控与评估、报告与披露等各个环节，预防和发现可能违反公平交易的异常情况，并予以及时纠正与改进。

管理人用于公平交易控制方法包括：

- 公司建立严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；
- 相对所有组合建立并使用统一的、系统化的研究平台；
- 明确了投资决策委员会、投资总监、投资组合经理三级授权体系；
- 要求同一基金经理管理的多个组合下达投资指令应尽量“同时同价”；
- 严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；
- 执行投资交易系统中的公平交易程序；
- 银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易的交易分配严格依照制度和程序规范进行，并对该分配过程进行监控；
- 定期对投资目标和投资策略类似的投资组合的业绩表现进行分析、归因和评估；
- 对不同时间窗下（如日内、3日内、5日内、10日内）管理人管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析。分析如发现有涉嫌不公平的交易，投资组合经理及交易主管对该情况需提供详细的原因说明，并将检查结果向公司管理层和督察长汇报。同时改进公平交易管理方法及流程。
- 其他能够防范公平交易异常情况的有效方式。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《公平交易管理规定》，建立并健全了有效的公平交易执行体系，保证公平

对待旗下的每一个基金组合。

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生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

2024 年 A 股市场一波三折，宏观政策转向后，A 股探底回升，上证综指全年上涨 12.67%，沪深 300 上涨 14.68%，创业板指上涨 13.23%。2024 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，上证综指在风险偏好和流动性共振下重新站上 3000 点。4 月，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。步入三季度，9 月 19 日，美联储降息落地，下降 50 个基点至 4.75%-5.00%，为国内货币政策打开空间，人民币汇率得到一定支撑。转折点来自 9 月底出台的政策“大礼包”。9 月 24 日，国新办举行新闻发布会，宣布下调存款准备金率、降低 7 天期逆回购利率，降低存量房贷利率和调降首套与二套房首付比例等政策。创设证券、基金、保险互换便利以及创设股票回购增持专项再贷款这两项新的货币政策则传达出中央稳定资本市场的信号。9 月 26 日非常规时间召开的中央政治局会议提出要加大财政货币政策逆周期调节力度，保证必要的财政支出。另外，要发行使用好超长期特别国债和地方政府专项债，更好发挥政府投资带动作用，坚定表达了政府进一步经济稳增长的决心。上述事件直接驱动 A 股市场快速重估，

投资者信心和风险偏好迅速提升，成交额迅速放大，估值提升使得 A 股大幅上涨。自 11 月 6 日特朗普胜选以来，由于美元指数上涨、对华贸易鹰派预期、资金获利了结等因素，A 股在震荡中下跌。为应对不确定性，国内稳增长政策在四季度持续加码。11 月 8 日，人大常委会批准 6 万亿地方政府债限额置换存量隐性债务，为近年来最大规模化债方案。12 月 9 日，中央政治局会议提出“更加积极的财政政策、适度宽松的货币政策”。12 月 11-12 日，中央经济工作会议在北京举行。会议通稿新增增发超长期特别国债，适时降准降息，实施提振消费专项行动等方面的提法，延续积极定调。从风格层面上看，2024 年全年大盘风格相对占优，在成长价值风格上，红利价值风格相对占优。在 9 月 24 日以来，成长风格则弹性更大，创业板指自 9 月 24 日以来至 2024 年末的涨幅达到 39.93%。

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条件下，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 1.3201 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.22%；同期业绩比较基准收益率为 12.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，我们判断 A 股市场有望发生结构性行情，科技有望成为最强主线。2025 年 1 月，六部委联合发布《关于推动中长期资金入市工作的实施方案》，该方案明确：公募持有 A 股流通市值每年至少增长 10%；力争大型国有保险公司从 2025 年起，每年新增保费的 30%用于投资 A 股；第二批保险资金长期股票投资试点在 2025 上半年落实，规模不低于 1000 亿元。公募、保险等中长期资金入市将利好 A 股市场表现。特朗普就任美国总统后，特朗普交易反复扰动 A 股表现，为应对冲击，国内将出台稳经济政策，强政策预期下，A 股“下有底”。结构上看，特朗普上台后，“中美对抗”叙事强化，制造业回流美国、中美科技业脱钩是大概率事件，自主可控科技板块有望受益。DeepSeek-R1 在 2025 年春节期间横空出世，全球 AI 行业为之震动，迅速成为全世界最受关注的 AI 公司，DeepSeekAPP 迅速在全球 140 个国家的手机应用市场登顶。DeepSeek 日活目前已超过 3000 万，成为史上最快达成这一里程碑的应用。DeepSeek 爆火有望带动国内 AI 产业链持续突破，带动 A 股科技板块躁动，引发国内外资金对 A 股价值重估，市场风险偏好有望显著提升，看好产业趋势明显的科技板块。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人根据《证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，强化风险及合规管理，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金份额持有人的合法权益。

2024 年以来，公司进一步强化合规风险底线意识，塑造良好的合规风控文化，打造“纵向到底，横向到边”的合规风控机制，促进公司持续、健康、平稳地高质量发展，充分保护投资者的利益，维护公司股东的合法权益，依照法律法规及监管部门的要求，结合公司实际业务开展情况，制定和修订了一系列内部规章制度，进一步完善了全面合规和风险管理机制。2024 年度，公司各项合规风控审计管理方面总体上得到了良好的控制，各项控制措施切实而有效，年内未发生重大违规及重大风险事件。

在公司董事会的指导、管理层的支持和各部门的密切配合下，公司紧密围绕经营目标和计划，结合公司的特点和现状，扎实推进开展各项合规风控审计工作。2024 年，合规风控审计工作内容涵盖了制度内控、法律合规、信息披露、反洗钱、风险监控、绩效评估、内部审计等工作。

法律合规方面，新规落实、法律事务、合规审核、合规培训、合规检查、信息披露、反洗钱、配合客户投诉处理等各项工作均有序开展，为公司各项业务开展提供有力的法律合规支持，为公司高质量发展打下了坚实基础。

风险管理方面，对投资合规风险、信用风险、流动性风险、市场风险、操作风险、信息科技风险、法律风险、合规风险、声誉风险、业务连续性风险、洗钱风险、集中度风险、廉洁从业风险和 innovation 产品/业务风险等均建立了完善的二层风险监控机制，注重加强对基金经理的日常培训，提升前台人员风险意识，同时进一步开发智能风控系统及数字可视化驾驶舱，前置化加强风险预警能力，智能化分析各项风险并向投研人员提供线上支持，努力提升风险化解及处置能力。

内部审计方面，以公司整体的战略目标为指导，努力构建与公司业务发展相适应的审计监督模式，建立健全各项审计工作规范、不断提升内部审计工作质量，不断强化审计监督职能，守牢公司风险第三道防线。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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》。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规和基金合同的规定。

#### 4.9 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、本报告期内出现了基金份额持有人数量连续 60 个工作日不满 200 人的情形。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。

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元，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合规守信、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2501645 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他信息	该基金管理人浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024

	<p>年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意</p>

	见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	王国蓓	叶凯韵
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2025年3月27日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	300,652.48	652,565.29
结算备付金		16,053.94	6,591.48
存出保证金		3,080.65	4,427.37
交易性金融资产	7.4.7.2	11,324,864.73	16,674,632.25
其中：股票投资		11,324,864.73	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		11,644,651.80	17,338,216.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年12月31日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,484.56	2,170.45
应付托管费		494.86	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	7.4.7.9	45,656.36	96,531.51
负债合计		47,635.78	99,425.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	8,785,155.00	14,785,155.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	2,811,861.02	2,453,635.94
净资产合计		11,597,016.02	17,238,790.94
负债和净资产总计		11,644,651.80	17,338,216.39

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3201 元，基金份额总额 8,785,155.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		2,176,592.32	406,656.22
1. 利息收入		2,319.72	6,008.42
其中：存款利息收入	7.4.7.13	2,319.72	6,008.42
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）		-900,567.94	-5,028,862.49
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-1,317,473.81	-5,644,819.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	92,562.51
股利收益	7.4.7.19	416,905.87	523,394.18
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	3,066,110.04	5,344,158.31
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	8,730.50	85,351.98
<b>减：二、营业总支出</b>		217,939.17	309,827.15
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	23,119.17	46,307.27
2. 托管费	7.4.10.2.2	7,706.51	15,435.79
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	333.43
8. 其他费用	7.4.7.23	187,113.49	247,750.66
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,958,653.15	96,829.07
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,958,653.15	96,829.07
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		1,958,653.15	96,829.07

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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)	-6,000,000.00	358,225.08	-5,641,774.92
(一)、综合收益总额	-	1,958,653.15	1,958,653.15
(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)	-6,000,000.00	-1,600,428.07	-7,600,428.07
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-1,600,428.07	-7,600,428.07
(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	8,785,155.00	2,811,861.02	11,597,016.02
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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)	-45,000,000.00	-17,067,815.62	-62,067,815.62
(一)、综合收益总额	-	96,829.07	96,829.07
(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)	-45,000,000.00	-17,164,644.69	-62,164,644.69
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	-66,000,000.00	-24,067,236.75	-90,067,236.75

(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	14,785,155.00	2,453,635.94	17,238,790.94

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

本财务报表由本基金的基金管理人浦银安盛基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

由于本基金预计在清算时资产按照公允价值处置,因此本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

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

#### 债务工具

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

##### 以摊余成本计量：

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

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期

损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值

并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金：

- 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；
- 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配,本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(c) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税〔2008〕1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2016〕36 号文《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 号文《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 号文《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》、财税〔2023〕39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

(b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

对基金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。

(d) 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。自

2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	300,652.48	652,565.29
等于：本金	300,620.47	652,495.55
加：应计利息	32.01	69.74
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	300,652.48	652,565.29

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	11,155,076.29	-	11,324,864.73	169,788.44
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	11,155,076.29	-	11,324,864.73	169,788.44



项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	19,570,953.85	-	16,674,632.25	-2,896,321.60
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	19,570,953.85	-	16,674,632.25	-2,896,321.60

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何衍生金融资产 / 负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有期货合约。

##### 7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有黄金衍生品。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有任何买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末及上年度末均未按预期信用损失一般模型计提减值准备。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未计提债权投资减值准备。

#### 7.4.7.6 其他债权投资

##### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

##### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未计提其他债权投资减值准备。

#### 7.4.7.7 其他权益工具投资

##### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

##### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	656.36	1,531.51
其中：交易所市场	656.36	1,531.51
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	10,000.00	60,000.00
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
合计	45,656.36	96,531.51

#### 7.4.7.10 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12月31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）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
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	8,785,155.00	8,785,155.00
-----	--------------	--------------

注：申购含红利再投资、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
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	-1,107,456.89	3,066,110.04	1,958,653.15
本期基金份额交易产生的变动数	-1,366,743.18	-233,684.89	-1,600,428.07
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,366,743.18	-233,684.89	-1,600,428.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,846,230.61	965,630.41	2,811,861.02

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	2,255.86	3,424.30
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	48.58	2,120.24
其他	15.28	463.88
合计	2,319.72	6,008.42

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,327,962.62	-4,033,587.78
股票投资收益——赎回差价收入	10,488.81	-1,611,231.40
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	-1,317,473.81	-5,644,819.18

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
卖出股票成交总额	4,830,729.02	46,418,228.07
减：卖出股票成本总额	6,152,579.37	50,348,858.26
减：交易费用	6,112.27	102,957.59
买卖股票差价收入	-1,327,962.62	-4,033,587.78

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	7,600,428.07	90,067,236.75
减：现金支付赎回款总额	2,858,070.07	39,603,018.75
减：赎回股票成本总额	4,731,869.19	52,075,449.40
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	10,488.81	-1,611,231.40

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

**7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-买卖债券差价收入。

**7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益-申购差价收入。

**7.4.7.16 资产支持证券投资收益****7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益-申购差价收入。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-	92,562.51

#### 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	416,905.87	523,394.18
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	416,905.87	523,394.18

#### 7.4.7.20 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	3,066,110.04	5,305,758.31
股票投资	3,066,110.04	5,305,758.31
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	-	38,400.00
权证投资	-	-
期货投资	-	38,400.00
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	3,066,110.04	5,344,158.31

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	8,730.50	85,351.98
合计	8,730.50	85,351.98

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	10,000.00	60,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	295.00	652.26
指数使用费	141,818.49	142,098.40
持有人大会律师费	25,000.00	35,000.00
持有人大会公证费	10,000.00	10,000.00
合计	187,113.49	247,750.66

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《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（二次召开）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金最后运作日为 2025 年 2 月 25 日，已于 2025 年 2 月 26 日起进入清算期。2025 年 2 月 26 日起，本基金进入基金财产清算程序。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）	基金管理人
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
法国安盛投资管理有限公司	基金管理人的股东
上海国盛集团资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海浦银安盛资产管理有限公司	基金管理人的子公司
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：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,119.17	46,307.27
其中：应支付销售机构的客户维护费	298.17	17.56
应支付基金管理人的净管理费	22,821.00	46,289.71

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：

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

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,706.51	15,435.79

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金无销售服务费。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年12月31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	3,089,700.00	35.17	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。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	300,652.48	2,255.86	652,565.29	3,424.30

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。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

1. 于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有 9,800 股托管人中国银行的普通股，成本总额为人民币 38,137.37 元，估值总额为人民币 53,998.00 元，占基金净资产的比例为 0.47% (于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 15,600 股托管人中国银行的普通股，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 12 月 31 日，本基金持有 8,200 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 64,922.72 元，估值总额为人民币 84,378.00 元，占基金资产净值的比例为 0.73% (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%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票减持还需根据交易所相关规定执行。此外，证券投资基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002252	上海莱士	2024年12月23日	重大事项停牌	7.22	2025年01月07日	6.93	1,900	12,781.27	13,718.00	-

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

**7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

**7.4.13 金融工具风险及管理**

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国银行股份有限公司，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。

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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 12 月 31 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。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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	300,652.48	-	-	-	300,652.48
结算备付金	16,053.94	-	-	-	16,053.94
存出保证金	3,080.65	-	-	-	3,080.65
交易性金融资产	-	-	-	11,324,864.73	11,324,864.73
资产总计	319,787.07	-	-	11,324,864.73	11,644,651.80
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	1,484.56	1,484.56
应付托管费	-	-	-	494.86	494.86
其他负债	-	-	-	45,656.36	45,656.36
负债总计	-	-	-	47,635.78	47,635.78
利率敏感度缺口	319,787.07	-	-	11,277,228.95	11,597,016.02
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账面价值，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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪 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，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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31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	11,324,864.73	97.65	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	11,324,864.73	97.65	16,674,632.25	96.73

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 7.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
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12月31日）	上年度末（2023年12月31日）
	业绩比较基准上升 500 基点	578,443.46	839,666.20



	业绩比较基准下降 500 基点	-578,443.46	-839,666.20
--	--------------------	-------------	-------------

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	11,311,146.73	16,674,632.25
第二层次	13,718.00	-
第三层次	-	-
合计	11,324,864.73	16,674,632.25

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

###### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-

转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	196,332.60	196,332.60
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	234,493.70	234,493.70
当期利得或损失总额	-	38,161.10	38,161.10
其中：计入损益的利得或损失	-	38,161.10	38,161.10
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有第三层次以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：同)。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	-	不适用	不适用	不适用	不适用

注：于 2024 年 12 月 31 日，本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况。

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,324,864.73	97.25
	其中：股票	11,324,864.73	97.25
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	316,706.42	2.72
8	其他各项资产	3,080.65	0.03
9	合计	11,644,651.80	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	99,126.32	0.85
B	采矿业	579,961.95	5.00
C	制造业	6,052,766.21	52.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	519,802.36	4.48
E	建筑业	202,957.20	1.75
F	批发和零售业	60,865.06	0.52
G	交通运输、仓储和邮政业	424,800.00	3.66
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	501,556.52	4.32
J	金融业	2,559,769.11	22.07
K	房地产业	108,714.00	0.94
L	租赁和商务服务业	99,250.00	0.86
M	科学研究和技术服务业	59,315.70	0.51
N	水利、环境和公共设施管理业	12,112.80	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	34,635.50	0.30
R	文化、体育和娱乐业	9,232.00	0.08
S	综合	-	-
	合计	11,324,864.73	97.65

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

### 8.2.3 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	---------	--------------

1	600519	贵州茅台	303	461,772.00	3.98
2	300750	宁德时代	1,280	340,480.00	2.94
3	600036	招商银行	5,771	226,800.30	1.96
4	600900	长江电力	6,800	200,940.00	1.73
5	601318	中国平安	3,000	157,950.00	1.36
6	002594	比亚迪	550	155,463.00	1.34
7	000858	五粮液	1,100	154,044.00	1.33
8	688256	寒武纪	200	131,600.00	1.13
9	601288	农业银行	23,600	126,024.00	1.09
10	601398	工商银行	17,500	121,100.00	1.04
11	300059	东方财富	4,405	113,737.10	0.98
12	601166	兴业银行	5,800	111,128.00	0.96
13	688041	海光信息	700	104,853.00	0.90
14	600030	中信证券	3,410	99,469.70	0.86
15	601899	紫金矿业	5,800	87,696.00	0.76
16	601328	交通银行	10,900	84,693.00	0.73
17	600000	浦发银行	8,200	84,378.00	0.73
18	002475	立讯精密	2,068	84,291.68	0.73
19	601816	京沪高铁	13,600	83,776.00	0.72
20	601088	中国神华	1,900	82,612.00	0.71
21	600276	恒瑞医药	1,772	81,334.80	0.70
22	601138	工业富联	3,700	79,550.00	0.69
23	002371	北方华创	200	78,200.00	0.67
24	300760	迈瑞医疗	300	76,500.00	0.66
25	000333	美的集团	1,000	75,220.00	0.65
26	600809	山西汾酒	380	69,999.80	0.60
27	601668	中国建筑	11,600	69,600.00	0.60
28	601127	赛力斯	500	66,695.00	0.58
29	601601	中国太保	1,900	64,752.00	0.56
30	600309	万华化学	900	64,215.00	0.55
31	000001	平安银行	5,400	63,180.00	0.54
32	601225	陕西煤业	2,700	62,802.00	0.54
33	000568	泸州老窖	500	62,600.00	0.54
34	603288	海天味业	1,360	62,424.00	0.54
35	002714	牧原股份	1,588	61,042.72	0.53
36	600028	中国石化	9,000	60,120.00	0.52
37	300033	同花顺	200	57,500.00	0.50
38	600406	国电南瑞	2,266	57,148.52	0.49
39	601766	中国中车	6,800	56,984.00	0.49
40	688012	中微公司	300	56,748.00	0.49
41	002352	顺丰控股	1,400	56,420.00	0.49
42	601919	中远海控	3,620	56,110.00	0.48
43	601985	中国核电	5,300	55,279.00	0.48

44	600887	伊利股份	1,800	54,324.00	0.47
45	601988	中国银行	9,800	53,998.00	0.47
46	601857	中国石油	6,000	53,640.00	0.46
47	600690	海尔智家	1,800	51,246.00	0.44
48	600919	江苏银行	5,180	50,867.60	0.44
49	601818	XD 光大银	12,900	49,923.00	0.43
50	000063	中兴通讯	1,200	48,480.00	0.42
51	688036	传音控股	500	47,500.00	0.41
52	600050	中国联通	8,900	47,259.00	0.41
53	600150	中国船舶	1,300	46,748.00	0.40
54	002142	宁波银行	1,900	46,189.00	0.40
55	601658	邮储银行	8,100	46,008.00	0.40
56	600104	上汽集团	2,200	45,672.00	0.39
57	000725	京东方 A	10,300	45,217.00	0.39
58	300308	中际旭创	360	44,463.60	0.38
59	603259	药明康德	780	42,931.20	0.37
60	600436	片仔癀	200	42,900.00	0.37
61	300274	阳光电源	580	42,821.40	0.37
62	600019	宝钢股份	6,100	42,700.00	0.37
63	002304	洋河股份	509	42,516.77	0.37
64	600999	招商证券	2,140	41,002.40	0.35
65	600016	民生银行	9,900	40,887.00	0.35
66	601211	国泰君安	2,168	40,433.20	0.35
67	601888	中国中免	600	40,206.00	0.35
68	688777	中控技术	790	39,239.30	0.34
69	600031	三一重工	2,356	38,826.88	0.33
70	603501	韦尔股份	365	38,109.65	0.33
71	600660	福耀玻璃	600	37,440.00	0.32
72	601688	华泰证券	2,100	36,939.00	0.32
73	601229	上海银行	4,000	36,600.00	0.32
74	601390	中国中铁	5,700	36,423.00	0.31
75	000651	格力电器	800	36,360.00	0.31
76	601169	北京银行	5,900	36,285.00	0.31
77	600989	宝丰能源	2,100	35,364.00	0.30
78	600905	三峡能源	8,000	34,960.00	0.30
79	600886	国投电力	2,100	34,902.00	0.30
80	300015	爱尔眼科	2,614	34,635.50	0.30
81	601006	大秦铁路	5,100	34,578.00	0.30
82	000538	云南白药	575	34,471.25	0.30
83	601012	隆基绿能	2,160	33,933.60	0.29
84	000166	申万宏源	6,300	33,705.00	0.29
85	601628	中国人寿	800	33,536.00	0.29
86	600893	航发动力	800	33,160.00	0.29

87	603993	洛阳钼业	4,900	32,585.00	0.28
88	605499	东鹏饮料	130	32,307.60	0.28
89	601881	中国银河	2,100	31,983.00	0.28
90	601009	南京银行	3,000	31,950.00	0.28
91	601066	中信建投	1,200	30,900.00	0.27
92	000625	长安汽车	2,302	30,754.72	0.27
93	300498	温氏股份	1,860	30,708.60	0.26
94	600346	恒力石化	2,000	30,700.00	0.26
95	300433	蓝思科技	1,400	30,660.00	0.26
96	601995	中金公司	900	30,321.00	0.26
97	600048	保利发展	3,400	30,124.00	0.26
98	600837	海通证券	2,700	30,024.00	0.26
99	601336	新华保险	600	29,820.00	0.26
100	600015	XD 华夏银	3,707	29,693.07	0.26
101	601727	上海电气	3,600	29,196.00	0.25
102	002230	科大讯飞	600	28,992.00	0.25
103	600438	通威股份	1,300	28,743.00	0.25
104	002625	光启技术	600	28,680.00	0.25
105	688111	金山办公	100	28,639.00	0.25
106	600585	海螺水泥	1,200	28,536.00	0.25
107	300014	亿纬锂能	602	28,137.48	0.24
108	002027	分众传媒	4,000	28,120.00	0.24
109	603986	兆易创新	260	27,768.00	0.24
110	000776	广发证券	1,700	27,557.00	0.24
111	601600	中国铝业	3,700	27,195.00	0.23
112	688008	澜起科技	400	27,160.00	0.23
113	001979	招商蛇口	2,600	26,624.00	0.23
114	688047	龙芯中科	200	26,456.00	0.23
115	000100	TCL 科技	5,240	26,357.20	0.23
116	000792	盐湖股份	1,600	26,336.00	0.23
117	002493	荣盛石化	2,900	26,245.00	0.23
118	601669	中国电建	4,800	26,208.00	0.23
119	000425	徐工机械	3,300	26,169.00	0.23
120	601111	中国国航	3,300	26,103.00	0.23
121	000338	潍柴动力	1,900	26,030.00	0.22
122	000895	双汇发展	1,000	25,960.00	0.22
123	000977	浪潮信息	500	25,940.00	0.22
124	300394	天孚通信	280	25,580.80	0.22
125	300782	卓胜微	284	25,474.80	0.22
126	300866	安克创新	260	25,386.40	0.22
127	688271	联影医疗	200	25,280.00	0.22
128	002916	深南电路	200	25,000.00	0.22
129	600926	杭州银行	1,700	24,837.00	0.21

130	688169	石头科技	112	24,560.48	0.21
131	002311	海大集团	500	24,525.00	0.21
132	603392	万泰生物	347	24,449.62	0.21
133	600674	川投能源	1,400	24,150.00	0.21
134	002463	沪电股份	600	23,790.00	0.21
135	605117	德业股份	280	23,744.00	0.20
136	601939	建设银行	2,700	23,733.00	0.20
137	601689	拓普集团	480	23,520.00	0.20
138	600010	包钢股份	12,600	23,436.00	0.20
139	600111	北方稀土	1,100	23,342.00	0.20
140	002241	歌尔股份	900	23,229.00	0.20
141	300502	新易盛	200	23,116.00	0.20
142	600547	山东黄金	1,020	23,082.60	0.20
143	601825	沪农商行	2,700	22,977.00	0.20
144	600795	国电电力	5,000	22,900.00	0.20
145	600958	东方证券	2,144	22,640.64	0.20
146	600418	江淮汽车	600	22,500.00	0.19
147	001965	招商公路	1,600	22,320.00	0.19
148	000938	紫光股份	800	22,264.00	0.19
149	002920	德赛西威	200	22,022.00	0.19
150	002938	鹏鼎控股	600	21,888.00	0.19
151	688072	拓荆科技	142	21,821.14	0.19
152	002028	思源电气	300	21,810.00	0.19
153	300408	三环集团	565	21,758.15	0.19
154	600415	小商品城	1,600	21,456.00	0.19
155	603296	华勤技术	300	21,285.00	0.18
156	300832	新产业	300	21,255.00	0.18
157	601360	三六零	2,011	20,813.85	0.18
158	600029	南方航空	3,200	20,768.00	0.18
159	688223	晶科能源	2,900	20,619.00	0.18
160	600188	兖矿能源	1,455	20,617.35	0.18
161	601868	中国能建	9,000	20,610.00	0.18
162	601319	中国人保	2,700	20,574.00	0.18
163	300124	汇川技术	350	20,503.00	0.18
164	600584	长电科技	500	20,430.00	0.18
165	603195	公牛集团	290	20,369.60	0.18
166	600221	海航控股	11,900	20,230.00	0.17
167	002736	国信证券	1,800	20,160.00	0.17
168	688082	盛美上海	200	20,000.00	0.17
169	601788	光大证券	1,100	19,921.00	0.17
170	002001	新和成	900	19,773.00	0.17
171	301236	软通动力	336	19,726.56	0.17
172	000002	万科 A	2,700	19,602.00	0.17



173	600160	巨化股份	800	19,296.00	0.17
174	600115	中国东航	4,800	19,200.00	0.17
175	601901	方正证券	2,300	19,159.00	0.17
176	688396	华润微	400	18,876.00	0.16
177	601838	成都银行	1,100	18,821.00	0.16
178	601633	长城汽车	700	18,431.00	0.16
179	300122	智飞生物	700	18,410.00	0.16
180	002460	赣锋锂业	520	18,205.20	0.16
181	003816	中国广核	4,400	18,172.00	0.16
182	600845	宝信软件	615	17,994.90	0.16
183	600089	特变电工	1,400	17,836.00	0.15
184	002648	卫星化学	945	17,756.55	0.15
185	600011	华能国际	2,600	17,602.00	0.15
186	600023	浙能电力	3,100	17,546.00	0.15
187	601916	浙商银行	6,000	17,460.00	0.15
188	300999	金龙鱼	533	17,381.13	0.15
189	000596	古井贡酒	100	17,330.00	0.15
190	601021	春秋航空	300	17,301.00	0.15
191	000963	华东医药	500	17,300.00	0.15
192	600703	三安光电	1,400	17,038.00	0.15
193	600489	中金黄金	1,400	16,842.00	0.15
194	600183	生益科技	700	16,835.00	0.15
195	601607	上海医药	800	16,800.00	0.14
196	603338	浙江鼎力	260	16,775.20	0.14
197	601100	恒立液压	316	16,675.32	0.14
198	603260	合盛硅业	300	16,668.00	0.14
199	600570	恒生电子	591	16,542.09	0.14
200	000617	中油资本	2,400	16,536.00	0.14
201	002466	天齐锂业	500	16,500.00	0.14
201	601618	中国中冶	5,000	16,500.00	0.14
202	600600	青岛啤酒	200	16,184.00	0.14
203	300413	芒果超媒	600	16,134.00	0.14
204	603160	汇顶科技	200	16,108.00	0.14
205	002600	领益智造	2,000	16,000.00	0.14
206	688120	华海清科	98	15,973.02	0.14
207	600803	新奥股份	732	15,869.76	0.14
208	600741	华域汽车	900	15,849.00	0.14
209	600066	宇通客车	600	15,828.00	0.14
210	002281	光迅科技	300	15,651.00	0.13
211	000301	东方盛虹	1,900	15,599.00	0.13
212	300442	润泽科技	300	15,588.00	0.13
213	002049	紫光国微	240	15,448.80	0.13
214	603833	欧派家居	220	15,166.80	0.13

215	000786	北新建材	500	15,155.00	0.13
216	601077	渝农商行	2,500	15,125.00	0.13
217	601377	兴业证券	2,410	15,086.60	0.13
218	002595	豪迈科技	300	15,057.00	0.13
219	002422	科伦药业	500	14,965.00	0.13
220	600196	复星医药	600	14,910.00	0.13
221	002156	通富微电	500	14,775.00	0.13
222	601872	招商轮船	2,300	14,743.00	0.13
223	002384	东山精密	500	14,600.00	0.13
224	600426	华鲁恒升	670	14,478.70	0.12
225	000157	中联重科	2,000	14,460.00	0.12
226	002236	大华股份	900	14,400.00	0.12
227	688187	时代电气	300	14,376.00	0.12
228	600025	华能水电	1,500	14,265.00	0.12
229	600233	圆通速递	1,000	14,190.00	0.12
230	000999	华润三九	320	14,188.80	0.12
231	002050	三花智控	600	14,106.00	0.12
232	601117	中国化学	1,700	14,093.00	0.12
233	601877	正泰电器	600	14,046.00	0.12
234	000408	藏格矿业	500	13,865.00	0.12
235	603799	华友钴业	470	13,752.20	0.12
236	002252	上海莱士	1,900	13,718.00	0.12
237	603369	今世缘	300	13,569.00	0.12
238	600061	国投资本	1,800	13,536.00	0.12
239	600176	中国巨石	1,188	13,531.32	0.12
240	000807	云铝股份	1,000	13,530.00	0.12
241	600027	华电国际	2,400	13,464.00	0.12
241	601878	浙商证券	1,100	13,464.00	0.12
242	600895	张江高科	500	13,400.00	0.12
243	300207	欣旺达	600	13,386.00	0.12
244	600096	云天化	600	13,380.00	0.12
245	002459	晶澳科技	972	13,365.00	0.12
246	000983	山西焦煤	1,620	13,348.80	0.12
247	601799	星宇股份	100	13,348.00	0.12
248	600642	申能股份	1,400	13,286.00	0.11
249	000975	山金国际	860	13,218.20	0.11
250	601136	首创证券	600	13,200.00	0.11
251	688126	沪硅产业	700	13,174.00	0.11
252	600918	中泰证券	2,000	13,140.00	0.11
253	300628	亿联网络	340	13,124.00	0.11
254	000066	中国长城	900	13,113.00	0.11
255	601238	广汽集团	1,400	13,076.00	0.11
256	600460	士兰微	500	13,010.00	0.11

257	000988	华工科技	300	12,990.00	0.11
258	601699	潞安环能	900	12,924.00	0.11
259	600219	南山铝业	3,300	12,903.00	0.11
260	601058	赛轮轮胎	900	12,897.00	0.11
261	600522	中天科技	900	12,888.00	0.11
262	300661	圣邦股份	157	12,839.46	0.11
263	600733	北汽蓝谷	1,600	12,800.00	0.11
264	600256	广汇能源	1,900	12,787.00	0.11
265	600875	东方电气	800	12,712.00	0.11
266	300476	胜宏科技	300	12,627.00	0.11
267	601216	君正集团	2,400	12,624.00	0.11
268	000423	东阿阿胶	200	12,544.00	0.11
269	688009	中国通号	2,000	12,520.00	0.11
270	603596	伯特利	280	12,485.20	0.11
271	600362	江西铜业	600	12,384.00	0.11
272	002601	龙佰集团	700	12,369.00	0.11
273	600161	天坛生物	600	12,300.00	0.11
274	600085	同仁堂	300	12,177.00	0.11
275	603568	伟明环保	560	12,112.80	0.10
276	301269	华大九天	100	12,110.00	0.10
277	600515	海南机场	3,200	12,096.00	0.10
278	600487	亨通光电	700	12,054.00	0.10
279	600039	四川路桥	1,640	11,939.20	0.10
280	002078	太阳纸业	800	11,896.00	0.10
281	601865	福莱特	600	11,814.00	0.10
282	002128	电投能源	600	11,748.00	0.10
283	600079	人福医药	500	11,690.00	0.10
284	000876	新希望	1,300	11,674.00	0.10
285	600536	中国软件	250	11,672.50	0.10
286	688065	凯赛生物	300	11,640.00	0.10
287	600745	闻泰科技	300	11,634.00	0.10
288	000630	铜陵有色	3,600	11,628.00	0.10
289	600026	中远海能	1,000	11,600.00	0.10
290	688599	天合光能	600	11,580.00	0.10
291	600038	中直股份	300	11,568.00	0.10
292	300919	中伟股份	320	11,558.40	0.10
293	300418	昆仑万维	300	11,544.00	0.10
294	002064	华峰化学	1,400	11,452.00	0.10
295	600177	雅戈尔	1,280	11,392.00	0.10
296	601179	中国西电	1,500	11,385.00	0.10
297	002085	万丰奥威	600	11,370.00	0.10
298	600985	淮北矿业	800	11,256.00	0.10
299	601168	西部矿业	700	11,249.00	0.10

300	600298	安琪酵母	311	11,211.55	0.10
301	002353	杰瑞股份	300	11,097.00	0.10
302	603806	福斯特	748	11,070.40	0.10
303	603893	瑞芯微	100	11,006.00	0.09
304	002223	鱼跃医疗	300	10,947.00	0.09
305	300759	康龙化成	425	10,922.50	0.09
306	000783	长江证券	1,600	10,912.00	0.09
307	601108	财通证券	1,330	10,866.10	0.09
308	601555	东吴证券	1,390	10,842.00	0.09
309	603198	迎驾贡酒	200	10,788.00	0.09
310	002456	欧菲光	900	10,782.00	0.09
311	601162	天风证券	2,400	10,752.00	0.09
312	601577	长沙银行	1,200	10,668.00	0.09
313	002709	天赐材料	540	10,648.80	0.09
314	002032	苏泊尔	200	10,642.00	0.09
315	002074	国轩高科	500	10,610.00	0.09
316	600157	永泰能源	6,200	10,602.00	0.09
317	002673	西部证券	1,300	10,595.00	0.09
318	603606	东方电缆	200	10,510.00	0.09
319	603659	璞泰来	660	10,500.60	0.09
320	600398	海澜之家	1,400	10,500.00	0.09
321	300037	新宙邦	280	10,483.20	0.09
322	002185	华天科技	900	10,449.00	0.09
323	000728	国元证券	1,240	10,366.40	0.09
324	002202	金风科技	1,000	10,330.00	0.09
325	600588	用友网络	960	10,300.80	0.09
326	000708	中信特钢	900	10,269.00	0.09
327	600511	国药股份	300	10,266.00	0.09
328	600009	上海机场	300	10,245.00	0.09
329	002532	天山铝业	1,300	10,231.00	0.09
330	002129	TCL 中环	1,150	10,200.50	0.09
331	000933	神火股份	600	10,140.00	0.09
332	002007	华兰生物	600	10,110.00	0.09
333	601991	大唐发电	3,500	9,975.00	0.09
334	000661	长春高新	100	9,944.00	0.09
335	601198	东兴证券	900	9,909.00	0.09
336	601231	环旭电子	600	9,900.00	0.09
337	002939	长城证券	1,200	9,840.00	0.08
338	002340	格林美	1,500	9,795.00	0.08
339	002444	巨星科技	300	9,705.00	0.08
340	688303	大全能源	400	9,656.00	0.08
341	000729	燕京啤酒	800	9,632.00	0.08
342	600109	国金证券	1,100	9,603.00	0.08

343	002812	恩捷股份	300	9,597.00	0.08
344	300316	晶盛机电	300	9,570.00	0.08
345	601990	南京证券	1,100	9,526.00	0.08
346	600153	建发股份	900	9,468.00	0.08
347	601456	国联证券	700	9,464.00	0.08
348	688122	XD 西部超	220	9,420.40	0.08
349	603486	科沃斯	200	9,400.00	0.08
350	002555	三七互娱	600	9,384.00	0.08
351	002414	高德红外	1,259	9,354.37	0.08
352	002294	信立泰	300	9,279.00	0.08
353	600352	浙江龙盛	900	9,261.00	0.08
354	601928	凤凰传媒	800	9,232.00	0.08
355	601567	三星医疗	300	9,228.00	0.08
356	300763	锦浪科技	150	9,160.50	0.08
357	603939	益丰药房	378	9,121.14	0.08
358	603899	晨光股份	300	9,075.00	0.08
359	601958	金钼股份	900	9,054.00	0.08
360	300699	光威复材	260	9,009.00	0.08
361	601880	辽港股份	5,200	8,996.00	0.08
362	601696	中银证券	800	8,928.00	0.08
363	002966	苏州银行	1,100	8,921.00	0.08
364	600369	西南证券	1,900	8,873.00	0.08
365	603658	安图生物	200	8,728.00	0.08
366	600566	济川药业	300	8,724.00	0.08
367	000921	海信家电	300	8,670.00	0.07
368	000027	深圳能源	1,320	8,553.60	0.07
369	600332	白云山	300	8,526.00	0.07
370	002180	纳思达	300	8,451.00	0.07
371	600282	南钢股份	1,800	8,442.00	0.07
372	000831	中国稀土	300	8,415.00	0.07
373	000932	华菱钢铁	2,000	8,360.00	0.07
374	600497	驰宏锌锗	1,500	8,355.00	0.07
375	601233	桐昆股份	700	8,260.00	0.07
376	603885	吉祥航空	600	8,220.00	0.07
377	002152	广电运通	700	8,162.00	0.07
378	603345	安井食品	100	8,148.00	0.07
379	600968	海油发展	1,900	8,113.00	0.07
380	688728	格科微	600	8,064.00	0.07
381	600873	梅花生物	800	8,024.00	0.07
382	300765	新诺威	300	7,977.00	0.07
383	600988	赤峰黄金	500	7,805.00	0.07
384	600549	厦门钨业	400	7,708.00	0.07
385	002465	海格通信	700	7,686.00	0.07

386	002603	以岭药业	480	7,684.80	0.07
387	600970	中材国际	800	7,584.00	0.07
388	000629	钒钛股份	2,600	7,488.00	0.06
389	688538	和辉光电	3,200	7,424.00	0.06
390	600582	天地科技	1,200	7,416.00	0.06
391	000738	航发控制	333	7,405.92	0.06
392	000800	一汽解放	900	7,380.00	0.06
393	600998	九州通	1,441	7,377.92	0.06
394	600598	北大荒	500	7,375.00	0.06
395	600021	上海电力	800	7,336.00	0.06
396	002262	恩华药业	300	7,305.00	0.06
397	300896	爱美客	40	7,300.00	0.06
398	603979	金诚信	200	7,260.00	0.06
399	300751	迈为股份	68	7,150.20	0.06
400	600546	山煤国际	600	7,098.00	0.06
401	600348	华阳股份	1,000	7,090.00	0.06
402	000960	锡业股份	500	7,015.00	0.06
403	601666	平煤股份	700	7,014.00	0.06
404	600848	上海临港	680	6,868.00	0.06
404	688099	晶晨股份	100	6,868.00	0.06
405	603156	养元饮品	300	6,852.00	0.06
406	300223	北京君正	100	6,820.00	0.06
407	600132	重庆啤酒	100	6,302.00	0.05
408	600521	华海药业	350	6,254.50	0.05
409	002409	雅克科技	100	5,795.00	0.05
410	300347	泰格医药	100	5,462.00	0.05
411	601966	玲珑轮胎	300	5,412.00	0.05
412	688363	华熙生物	100	5,104.00	0.04
413	002821	凯莱英	55	4,184.95	0.04
414	002271	东方雨虹	300	3,894.00	0.03

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	115,036.00	0.67
2	002371	北方华创	30,871.00	0.18
3	300760	迈瑞医疗	29,624.00	0.17
4	001965	招商公路	28,880.00	0.17
5	688047	龙芯中科	28,760.00	0.17

6	300033	同花顺	28,290.00	0.16
7	002594	比亚迪	28,279.00	0.16
8	000858	五粮液	27,059.00	0.16
9	601398	工商银行	26,414.00	0.15
10	300750	宁德时代	26,227.00	0.15
11	601127	赛力斯	25,878.00	0.15
12	600036	招商银行	24,765.00	0.14
13	000708	中信特钢	23,923.00	0.14
14	600809	山西汾酒	23,050.00	0.13
15	600025	华能水电	22,670.00	0.13
16	605499	东鹏饮料	21,816.00	0.13
17	600900	长江电力	21,674.00	0.13
18	603979	金诚信	21,184.00	0.12
19	601138	工业富联	21,114.00	0.12
20	688777	中控技术	21,065.00	0.12

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	181,876.00	1.06
2	600519	贵州茅台	150,553.00	0.87
3	000858	五粮液	113,284.00	0.66
4	002594	比亚迪	108,264.00	0.63
5	300760	迈瑞医疗	82,698.00	0.48
6	002371	北方华创	75,865.00	0.44
7	300059	东方财富	61,187.00	0.35
8	688111	金山办公	57,666.00	0.33
9	000333	美的集团	54,120.00	0.31
10	002475	立讯精密	53,438.00	0.31
11	300033	同花顺	53,209.00	0.31
12	002714	牧原股份	47,229.00	0.27
13	000001	平安银行	43,526.00	0.25
14	002352	顺丰控股	39,175.00	0.23
15	688120	华海清科	36,334.00	0.21
16	002916	深南电路	35,038.00	0.20
17	002920	德赛西威	32,897.00	0.19
18	000625	长安汽车	32,754.00	0.19
19	000725	京东方 A	31,398.00	0.18
20	002142	宁波银行	30,845.00	0.18

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,468,571.00
卖出股票收入（成交）总额	4,830,729.02

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。

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，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中国人民银行的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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



### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,080.65
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	3,080.65

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末不存在指数投资前十名股票流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
170	51,677.38	6,668,355.00	75.90	2,116,800.00	24.10

#### 9.1.2 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	3,089,700.00	35.17

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中信证券股份有限公司	1,933,339.00	22.01
2	广发证券股份有限公司	1,022,321.00	11.64
3	华泰证券股份有限公司	616,695.00	7.02
4	沈晨波	330,000.00	3.76
5	戴克阳	150,000.00	1.71
6	宗兰	100,000.00	1.14
7	陈祥东	73,700.00	0.84
8	曾莉萍	70,000.00	0.80
8	董佳佳	70,000.00	0.80
10	吴德勤	60,000.00	0.68
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	3,089,700.00	35.17

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。

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,785,155.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

2024 年 9 月 19 日至 2024 年 10 月 18 日,基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会,因本次大会本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一,故未达到法定的基金份额持有人大会召开条件,详见本基金管理人于 2024 年 9 月 11 日发布的《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以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告》及其后续公告。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,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》。

2024 年 12 月 13 日,张健先生新任公司董事长,谢伟先生离任公司董事长。具体信息请参见基金管理人于 2024 年 12 月 14 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事长变更的公告》。

2024 年 12 月 16 日,李宏宇先生离任公司副总经理兼首席市场营销官。具体信息请参见基金管理人于 2024 年 12 月 18 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

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:

浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第一次股东会会议审议通过,选举张健先生、Pierre-Axel Margulies 先生、杨志敏先生、侯林先生、林忠汉先生、袁涛先生、张弛先生、韩启蒙先生(独立董事)、赵晓菊女士(独立董事)、寇宗来先生(独立董事)和王少飞先生(独立董事)担任公司第六届董事会董事。其中,寇宗来先生、王少飞先生为新任公司独立董事。原第五届董事会成员董叶顺先生、霍佳震先生不再担任公司独立董事。具体信息请参见基金管理人于 2025 年 3 月 5 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告》。

2025 年 3 月 6 日,赵婷女士新任公司副总经理。具体信息请参见基金管理人于 2025 年 3 月 8 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

2025 年 3 月 18 日,浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第二次股东会会议审议通过,批准

屠旋旋先生接替袁涛先生续任公司第六届董事会董事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）改为聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 10,000.00 元人民币。目前该会计师事务所已为本基金提供 0 年审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	4,535,609.24	62.14	2,035.28	63.04	-
天风证券	1	2,763,690.78	37.86	1,193.32	36.96	-
国泰君安证券	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

①基本情况：包括但不限于资本充足、近三年财务状况良好；主要股东经营稳健；具备高效、

安全的通讯条件，能够提供有效交易执行服务。

②公司治理：公司治理完善，经营行为规范，具备健全的内控制度，合规管理体系，风险管理稳健。

③研究实力：有固定的研究机构和数量足够的专职研究团队；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、公司等各项领域；研究报告分析严谨，观点独立、客观，并有完善的研究报告质量和合规保障机制。

#### (2) 选择证券经营机构交易单元的程序

对于符合选择证券公司参与证券交易标准的证券公司，经公司研究部评估，并递交公司券商佣金考核委员会审议批准后，可纳入公司备选池。在备选池中的证券公司方可参加券商考核，并被选择参与证券交易。公司会与被选中的证券公司签订协议，督察长及法律合规部在上述过程中履行合规审查职责。

2、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致。本公司网站披露的《浦银安盛基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年下半年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

#### 3、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期间无交易单元变更。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛 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	规定网站	2024 年 1 月 22 日

	告		
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
7	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤海证券为一级交易商代理机构的公告	报刊及规定网站	2024 年 7 月 1 日
8	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 2 季度报告	规定网站	2024 年 7 月 19 日
9	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国金证券为一级交易商代理机构的公告	报刊及规定网站	2024 年 7 月 23 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 2024 年中期报告	规定网站	2024 年 8 月 31 日
11	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以通讯方式召开基金份额持有人大会的公告	报刊及规定网站	2024 年 9 月 11 日
12	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以通讯方式召开基金份额持有人大会的第一次提示性公告	报刊及规定网站	2024 年 9 月 12 日
13	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以通讯方式召开基金份额持有人大会的第二次提示性公告	报刊及规定网站	2024 年 9 月 13 日
14	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基金份额持有人大会计票日开始停牌及暂停申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2024 年 10 月 19 日
15	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基金份额持有人大会会议情况的公告	报刊及规定网站	2024 年 10 月 22 日

16	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复牌及恢复申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2024 年 10 月 22 日
17	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 3 季度报告	规定网站	2024 年 10 月 25 日
18	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所公告	报刊及规定网站	2024 年 12 月 21 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20240101-20241231	5,357,900.00	1,332,900.00	3,601,100.00	3,089,700.00	35.17
	2	20241107-20241119, 20241125-20241231	982,639.00	14,426,939.00	13,476,239.00	1,933,339.00	22.01
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>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛 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

### 13.2 存放地点

上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层 基金管理人办公场所。

### 13.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2025 年 3 月 31 日