

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指 数证券投资基金 2021 年中期报告

2021 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：2021 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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 2021 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	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
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	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58

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.....	58
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.....	58
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.....	58
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	59
7.12 投资组合报告附注.....	59
§ 8 基金份额持有人信息.....	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	61
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.....	61
§ 9 开放式基金份额变动.....	61
§ 10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	63
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§ 12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF
场内简称	浦银 MSCI
基金主代码	515780
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	137,785,155.00 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）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼	北京西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	200020	100818

法定代表人	谢伟	刘连舸
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	39,282,261.20
本期利润	24,618,710.07
加权平均基金份额本期利润	0.1641
本期加权平均净值利润率	10.73%
本期基金份额净值增长率	9.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	84,757,854.17
期末可供分配基金份额利润	0.6151
期末基金资产净值	222,543,009.17
期末基金份额净值	1.6151
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	61.51%

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

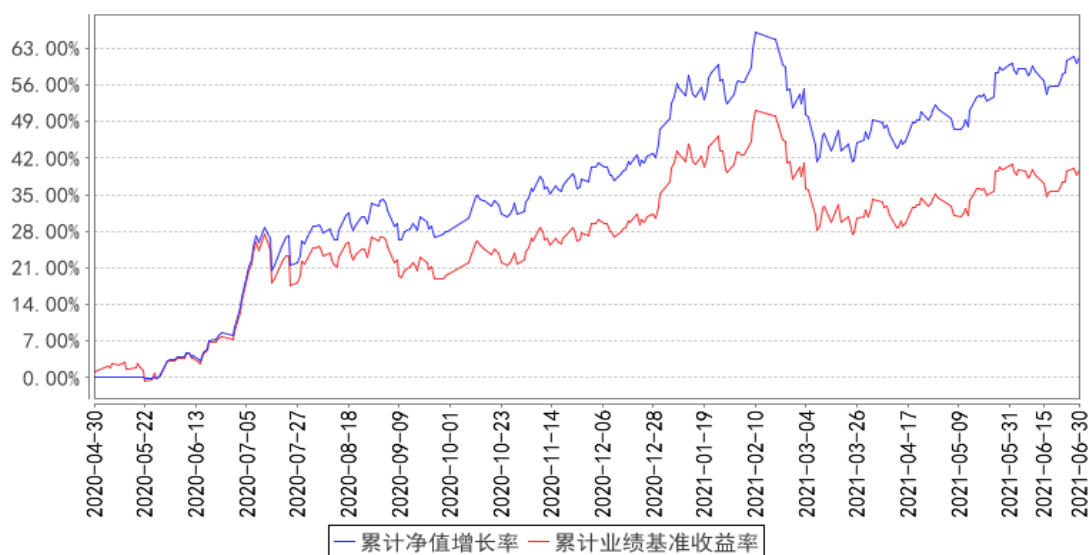
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	1.10%	0.82%	-0.55%	0.84%	1.65%	-0.02%
过去三个月	10.94%	0.96%	6.84%	0.98%	4.10%	-0.02%
过去六个月	9.59%	1.32%	3.38%	1.32%	6.21%	0.00%
过去一年	47.22%	1.31%	28.40%	1.33%	18.82%	-0.02%
自基金合同生效起至今	61.51%	1.24%	39.79%	1.28%	21.72%	-0.04%

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



注：根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为2020年4月30日至2020年10月29日。建仓期结束时符合相关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 74 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）、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛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、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚益 18 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛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、浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安久回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金（QDII）、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、

浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛煊 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、浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛科技创新优选三年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银安盛安远回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛价值精选混合型证券投资基金、浦银安盛普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛普天纯债债券型证券投资基金、浦银安盛普庆纯债债券型证券投资基金、浦银安盛睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金

(FOF)、浦银安盛中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银安盛盛毅一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型基金中基金 (FOF)、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统、XBRL 系统、反洗钱系统等。这些系统也主要是采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，我公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高钢杰	本基金的基金经理	2020年6月4日	-	11年	高钢杰先生，中国科学院天体物理博士。2010年10月至2014年3月在上海东证期货研究所、国泰君安期货研究所担任量化投资研究员。2014年3月至2018年10月在中国工商银行总行贵金属业务部工作，历任产品研发经理、代客交易经理。2018年10月加入浦银安盛基金管理有限公司，参与ETF业务筹备工作。2019年3月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年6月起担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金及浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020年7月起担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年9月起担任浦银安盛MSCI中国A股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
陈士俊	公司指数及量化投资部总监，公司职工监事，公司旗下部分基金基金经理。	2020年4月30日	-	20年	陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001年至2003年间曾在国泰君安证券有限公司研究所担任金融工程研究员2年；2003年至2007年10月在银河基金管理有限公司工作4年，先后担任金融工程部研究员、研究部主管。2007年10月加入浦银安盛基金管理有限公司，任本公司指数及量化投资部总监，并于2010年12月起担任浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金基金经理。2012年3月担任本公司职工监事。2012年5月起，担任浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金经理。2017年4月起，担任浦银安盛中证锐联沪港深基本面100指数证券投资基金（LOF）基金经理。2018年9月起，担任浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2019年1月起，担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。2020年4月起，担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金联接基金及浦银安盛MSCI中国

					A 股交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 6 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基金经理。2021 年 5 月起，担任浦银安盛鑫福混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、本基金基金经理的任职日期为公司决定的聘任日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，A 股市场整体波动较大，结构分化显著，板块轮动迅速。国内经济持续复苏，但复苏力度边际减弱。上半年，国内有部分地区因境外病毒输入导致少量感染病例发生，但均得到快速控制，对经济持续复苏并未产生明显影响。而境外新冠病毒持续扩散，导致出现多种变异毒株，并未见得到控制的迹象。美联储维持宽松的货币政策，但通胀水平持续攀升，货币刺激政策退出预期加强。A 股市场主要指数均录得上涨。其中，上证指数上涨 3.40%，沪深 300 指数上涨 0.24%，创业板指数上涨 17.22%。基金标的指数 MSCI 中国 A 股指数上涨 3.38%，超越沪深 300 指数 3.14%。

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 1.6151 元，本报告期基金份额净值增长率为 9.59%；同期业绩比较基准收益率为 3.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为国内经济有望持续复苏，货币政策将保持合理充裕，积极的财政政策将加大经济支持力度。境外疫苗接种率持续提升，但疫情控制仍存在较大不确定性，因此，国内出口仍将保持竞争力，投资有望发挥更大的支撑作用，消费复苏力度可能仍然较弱。而美联储宽松货币政策的推出预期可能对国内市场带来额外扰动，将加大市场的波动率水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。估值委员会成员由公司副总经理暨首席运营官、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、研究部负责人、产品估值部和注册登记部负责人组成。估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

本基金管理人与中央国债登记结算有限责任公司以及中债金融估值中心有限公司签订了《中债信息产品服务三方协议》。

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》第十八部分第三条约定，在符合有关基金分红条件的前提下，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，本基金每年收益分配次数最多为 6 次；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。

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规的规定及基金合同的约定。

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、本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人的情形。
- 2、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“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：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,145,610.87	9,513,875.11
结算备付金		1,642,559.98	3,450,977.16
存出保证金		610,334.64	875,524.65
交易性金融资产	6.4.7.2	216,383,506.78	290,469,758.46
其中：股票投资		216,281,506.78	290,469,758.46
基金投资		-	-
债券投资		102,000.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		328,682.49	6,908,446.41
应收利息	6.4.7.5	1,834.06	2,276.74
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		229,112,528.82	311,220,858.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		6,321,253.17	10,435,206.96
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		30,063.78	34,276.96
应付托管费		10,021.26	11,425.66
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	103,233.54	226,454.26
应交税费		10,728.35	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	94,219.55	180,000.00
负债合计		6,569,519.65	10,887,363.84
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	137,785,155.00	203,785,155.00
未分配利润	6.4.7.10	84,757,854.17	96,548,339.69
所有者权益合计		222,543,009.17	300,333,494.69
负债和所有者权益总计		229,112,528.82	311,220,858.53

注： 报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.6151 元，基金份额总额 137,785,155.00 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：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 30 日（基金 合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		25,441,243.71	46,240,753.26
1. 利息收入		32,259.27	369,093.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,252.12	307,692.97
债券利息收入		7.15	7.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	61,393.27
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		39,399,555.46	12,102,448.03
其中：股票投资收益	6.4.7.12	37,382,536.11	9,076,076.83
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收	6.4.7.13.5	-	-

益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	492,830.10	-
股利收益	6.4.7.16	1,524,189.25	3,026,371.20
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,663,551.13	33,487,029.84
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	672,980.11	282,181.85
减：二、费用		822,533.64	966,429.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	171,842.86	126,482.09
2. 托管费	6.4.10.2.2	57,280.94	42,160.69
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	429,819.85	708,815.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1,774.19	0.04
7. 其他费用	6.4.7.20	161,815.80	88,971.25
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		24,618,710.07	45,274,323.74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		24,618,710.07	45,274,323.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	203,785,155.00	96,548,339.69	300,333,494.69
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	24,618,710.07	24,618,710.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-66,000,000.00	-36,409,195.59	-102,409,195.59

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	111,000,000.00	60,054,866.88	171,054,866.88
2. 基金赎回款	-177,000,000.00	-96,464,062.47	-273,464,062.47
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	137,785,155.00	84,757,854.17	222,543,009.17
项目	上年度可比期间 2020年4月30日(基金合同生效日)至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	554,785,155.00	-	554,785,155.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	45,274,323.74	45,274,323.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-156,000,000.00	-6,542,749.25	-162,542,749.25
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	1,328,930.39	25,328,930.39
2. 基金赎回款	-180,000,000.00	-7,871,679.64	-187,871,679.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	398,785,155.00	38,731,574.49	437,516,729.49

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日期间的经营成果和基金净值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

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

收率缴纳增值税。

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	10,145,610.87
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	10,145,610.87

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	201,534,576.62	216,281,506.78	14,746,930.16

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	102,000.00	102,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	102,000.00	102,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	201,636,576.62	216,383,506.78	14,746,930.16

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	4,724,595.00	-	-	
其中：股指期货投资	4,724,595.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	4,724,595.00	-	-	

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。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	865.65

应收定期存款利息	
应收其他存款利息	
应收结算备付金利息	938.86
应收债券利息	7.15
应收资产支持证券利息	
应收买入返售证券利息	
应收申购款利息	
应收黄金合约拆借孳息	
应收出借证券利息	
其他	22.40
合计	1,834.06

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	103,233.54
银行间市场应付交易费用	-
合计	103,233.54

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
合计	94,219.55

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	203,785,155.00	203,785,155.00
本期申购	111,000,000.00	111,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-177,000,000.00	-177,000,000.00
- 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	137,785,155.00	137,785,155.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	107,864,835.35	-11,316,495.66	96,548,339.69
本期利润	39,282,261.20	-14,663,551.13	24,618,710.07
本期基金份额交易产生的变动数	-39,454,498.22	3,045,302.63	-36,409,195.59
其中：基金申购款	75,750,020.17	-15,695,153.29	60,054,866.88
基金赎回款	-115,204,518.39	18,740,455.92	-96,464,062.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	107,692,598.33	-22,934,744.16	84,757,854.17

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	12,843.39
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	18,792.05
其他	616.68
合计	32,252.12

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,137,434.02
股票投资收益——赎回差价收入	12,245,102.09
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	37,382,536.11

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	161,136,691.84
减：卖出股票成本总额	135,999,257.82
买卖股票差价收入	25,137,434.02

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	273,464,062.47
减：现金支付赎回款总额	123,450,517.47
减：赎回股票成本总额	137,768,442.91
赎回差价收入	12,245,102.09

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.12.5 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。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期间无债券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期间无债券投资收益—申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

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。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
股指期货投资收益	492,830.10

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,524,189.25
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	1,524,189.25

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
------	----------------------------

1. 交易性金融资产	-14,201,836.13
股票投资	-14,201,836.13
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	-461,715.00
权证投资	-
期货投资	-461,715.00
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	-14,663,551.13

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	672,980.11
合计	672,980.11

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。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	429,819.85
银行间市场交易费用	-
合计	429,819.85

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,009.00
指数使用费	65,587.25
合计	161,815.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金未发生需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

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无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 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年4月30日（基金 合同生效日）至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	171,842.86	126,482.09
其中：支付销售机构的客户维护费	1,604.10	572.33

注：支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年 6月30日	上年度可比期间 2020年4月30日（基金 合同生效日）至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	57,280.94	42,160.69

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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。

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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

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 2021年1月1日至2021年6月 30日		上年度可比期间 2020年4月30日（基金合同生效日）至 2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	10,145,610.87	12,843.39	12,601,344.56	143,905.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未有在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金截至2021年6月30日止持有143,200股浦发银行的A股普通股，成本总额为人民币1,440,959.20元，估值总额为人民币1,432,000.00元，占基金资产净值的比例为0.64%。

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(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

			25 日							
300926	博俊科技	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020 年 12 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股锁定	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300929	华骐环保	2021 年 1 月 12 日	2021 年 7 月 20 日	新股锁定	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300930	屹通新材	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300931	通用电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021 年 1 月 15 日	2021 年 7 月 22 日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月 9 日	新股锁定	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021 年 2 月 2 日	2021 年 8 月	新股锁定	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-

			9 日								
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-	
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-	
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-	
300952	恒辉安防	2021年3月3日	2021年9月13日	新股锁定	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-	
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股锁定	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-	
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-	
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-	
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	155	7,336.15	39,053.80	-	
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股锁定	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-	
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-	
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-	

			30 日								
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-	
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股锁定	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-	
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-	
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-	
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	791	5,434.17	9,547.37	-	
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股锁定	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-	
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	171	4,835.88	19,786.41	-	
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-	
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-	
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	259	8,603.98	22,662.50	-	
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-	

			27 日								
300986	志特新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-	
300991	创益通	2021 年 5 月 12 日	2021 年 11 月 22 日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-	
300992	泰福泵业	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 25 日	新股锁定	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-	
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-	
300996	普联软件	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 3 日	新股锁定	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-	
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-	
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-	
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-	
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定	12.54	27.89	537	6,733.98	14,976.93	-	
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-	
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-	

			17 日								
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20		-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81		-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46		-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50		-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年01月07日	新股流通受限	8.29	8.29	7,811	64,753.19	64,753.19		-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年01月06日	新股流通受限	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40		-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年01月06日	新股流通受限	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54		-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股流通受限	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年07月06日	新股流通受限	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股流通受限	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24		-
688113	联测科技	2021年4月26日	2021年11月	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35		-

			8 日								
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股流通受限	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688359	三孚新科	2021年5月14日	2021年11月22日	新股锁定	11.03	26.35	2,213	24,409.39	58,312.55		-
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	新股锁定	14.80	32.09	2,702	39,989.60	86,707.18		-
688616	西力科技	2021年3月10日	2021年9月22日	新股锁定	7.35	13.78	3,918	28,797.30	53,990.04		-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券											
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额		备注
113050	南银转债	2021年6月15日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	1,020	102,000.00	102,000.00		-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限

内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	6,500	167,234.17	366,275.00	-
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	46,505	367,658.53	259,962.95	-

注：本基金截至 2021 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生的重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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)。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

货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即 MSCI 中国 A 股人民币指数收益率。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行

存款存放在本基金的托管人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 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2021 年 6 月 30 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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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 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 2021 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 2021 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,145,610.87	-	-	-	10,145,610.87

结算备付金	1,642,559.98	-	-	-	1,642,559.98
存出保证金	610,334.64	-	-	-	610,334.64
交易性金融资产	102,000.00	-	-	-216,281,506.78	216,383,506.78
应收利息	-	-	-	1,834.06	1,834.06
应收证券清算款	-	-	-	381,197.49	381,197.49
其他资产	-	-	-	-52,515.00	-52,515.00
资产总计	12,500,505.49	-	-	-216,612,023.33	229,112,528.82
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	30,063.78	30,063.78
应付托管费	-	-	-	10,021.26	10,021.26
应付证券清算款	-	-	-	6,321,253.17	6,321,253.17
应付交易费用	-	-	-	103,233.54	103,233.54
应交税费	-	-	-	10,728.35	10,728.35
其他负债	-	-	-	94,219.55	94,219.55
负债总计	-	-	-	6,569,519.65	6,569,519.65
利率敏感度缺口	12,500,505.49	-	-	-210,042,503.68	222,543,009.17
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,513,875.11	-	-	-	9,513,875.11
结算备付金	3,450,977.16	-	-	-	3,450,977.16
存出保证金	875,524.65	-	-	-	875,524.65
交易性金融资产	-	-	-	-290,469,758.46	290,469,758.46
应收证券清算款	-	-	-	6,908,446.41	6,908,446.41
应收利息	-	-	-	2,276.74	2,276.74
资产总计	13,840,376.92	-	-	-297,380,481.61	311,220,858.53
负债	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	10,435,206.96	10,435,206.96
应付管理人报酬	-	-	-	34,276.96	34,276.96
应付托管费	-	-	-	11,425.66	11,425.66
应付交易费用	-	-	-	226,454.26	226,454.26
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	10,887,363.84	10,887,363.84
利率敏感度缺口	13,840,376.92	-	-	-286,493,117.77	300,333,494.69

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资或资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的股票投资比例不低于基金资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	216,281,506.78	97.19	290,469,758.46	96.72
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	-52,515.00	-0.02	—	—
合计	216,228,991.78	97.17	290,469,758.46	96.72

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	业绩比较基准上升 500 基点	10,541,463.91	14,127,844.27
	业绩比较基准下降 500 基点	-10,541,463.91	-14,127,844.27

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	216,281,506.78	94.40
	其中：股票	216,281,506.78	94.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	102,000.00	0.04
	其中：债券	102,000.00	0.04
	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	11,788,170.85	5.15
8	其他各项资产	940,851.19	0.41
9	合计	229,112,528.82	100.00

注：股票投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 合计项不含可退替代款估值增值，最终导致两者在金额上不相等。

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	2,352,133.36	1.06
B	采矿业	5,566,324.20	2.50
C	制造业	126,271,780.32	56.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,933,850.80	1.77
E	建筑业	2,786,403.00	1.25
F	批发和零售业	2,854,809.46	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	6,810,088.40	3.06
H	住宿和餐饮业	256,275.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,282,813.61	2.82
J	金融业	41,269,233.64	18.54
K	房地产业	4,674,456.20	2.10
L	租赁和商务服务业	3,936,014.00	1.77
M	科学研究和技术服务业	2,911,813.20	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	237,394.00	0.11
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	224,358.60	0.10
Q	卫生和社会工作	3,085,828.62	1.39
R	文化、体育和娱乐业	1,159,709.80	0.52
S	综合	-	-
	合计	214,613,286.21	96.44

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

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	11,290.28	0.01
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,139,017.73	0.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.01
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.02
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	71,747.89	0.03
J	金融业	34,721.10	0.02
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	280,997.08	0.13
N	水利、环境和公共设施管理业	35,554.25	0.02
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	1,668,220.57	0.75

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	5,903	12,140,700.10	5.46
2	300750	宁德时代	10,600	5,668,880.00	2.55
3	000858	五粮液	18,800	5,600,332.00	2.52
4	600036	招商银行	98,771	5,352,400.49	2.41
5	601318	中国平安	53,000	3,406,840.00	1.53
6	601888	中国中免	9,700	2,910,970.00	1.31
7	300760	迈瑞医疗	5,500	2,640,275.00	1.19
8	601012	隆基股份	25,900	2,300,956.00	1.03
9	600900	长江电力	110,600	2,282,784.00	1.03
10	603288	海天味业	17,436	2,248,372.20	1.01
11	600276	恒瑞医药	32,472	2,207,121.84	0.99
12	002594	比亚迪	8,650	2,171,150.00	0.98
13	000001	平安银行	93,000	2,103,660.00	0.95
14	601166	兴业银行	101,300	2,081,715.00	0.94
15	600809	山西汾酒	4,200	1,881,600.00	0.85
16	603259	药明康德	11,880	1,860,289.20	0.84
17	600309	万华化学	15,800	1,719,356.00	0.77

18	300015	爱尔眼科	24,169	1,715,515.62	0.77
19	000568	泸州老窖	7,200	1,698,768.00	0.76
20	300059	东方财富	50,432	1,653,665.28	0.74
21	601398	工商银行	306,900	1,586,673.00	0.71
22	002475	立讯精密	33,868	1,557,928.00	0.70
23	300122	智飞生物	8,300	1,549,859.00	0.70
24	002714	牧原股份	25,388	1,544,098.16	0.69
25	002352	顺丰控股	22,400	1,516,480.00	0.68
26	600436	片仔癀	3,300	1,479,390.00	0.66
27	600000	浦发银行	143,200	1,432,000.00	0.64
28	002304	洋河股份	6,909	1,431,544.80	0.64
29	601919	中远海控	45,800	1,398,732.00	0.63
30	603501	韦尔股份	4,200	1,352,400.00	0.61
31	600030	中信证券	51,900	1,294,386.00	0.58
32	600031	三一重工	42,256	1,228,381.92	0.55
33	000333	美的集团	16,100	1,149,057.00	0.52
34	000002	万科A	46,300	1,102,403.00	0.50
35	601288	农业银行	363,300	1,100,799.00	0.49
36	002142	宁波银行	28,100	1,095,057.00	0.49
37	600887	伊利股份	29,100	1,071,753.00	0.48
38	601816	京沪高铁	193,600	1,024,144.00	0.46
39	000725	京东方A	160,500	1,001,520.00	0.45
40	600438	通威股份	22,800	986,556.00	0.44
41	601899	紫金矿业	100,200	970,938.00	0.44
42	300014	亿纬锂能	9,202	956,363.86	0.43
43	601668	中国建筑	205,000	953,250.00	0.43
44	601601	中国太保	32,900	953,113.00	0.43
45	601328	交通银行	192,700	944,230.00	0.42
46	300124	汇川技术	12,450	924,537.00	0.42
47	002812	恩捷股份	3,800	889,580.00	0.40
48	002493	荣盛石化	49,100	847,957.00	0.38
49	600019	宝钢股份	109,000	832,760.00	0.37
50	600104	上汽集团	37,900	832,663.00	0.37
51	300274	阳光电源	7,200	828,432.00	0.37
52	600585	海螺水泥	19,500	800,475.00	0.36
53	600690	海尔智家	29,900	774,709.00	0.35
54	600346	恒力石化	29,200	766,208.00	0.34
55	601818	光大银行	202,100	763,938.00	0.34
56	600016	民生银行	172,900	762,489.00	0.34
57	002371	北方华创	2,700	748,926.00	0.34
58	000661	长春高新	1,900	735,300.00	0.33
59	600703	三安光电	22,600	724,330.00	0.33

60	300782	卓胜微	1,340	720,250.00	0.32
61	600893	航发动力	13,500	718,065.00	0.32
62	600196	复星医药	9,900	714,087.00	0.32
63	600048	保利地产	59,300	713,972.00	0.32
64	002241	歌尔股份	16,600	709,484.00	0.32
65	000538	云南白药	6,025	697,213.00	0.31
66	002230	科大讯飞	10,300	696,074.00	0.31
67	600999	招商证券	35,840	681,676.80	0.31
68	600028	中国石化	156,300	681,468.00	0.31
69	601066	中信建投	21,500	675,745.00	0.30
70	300759	康龙化成	3,100	672,669.00	0.30
71	300433	蓝思科技	22,800	670,548.00	0.30
72	002311	海大集团	8,100	660,960.00	0.30
73	002027	分众传媒	69,800	656,818.00	0.30
74	601658	邮储银行	129,800	651,596.00	0.29
75	603799	华友钴业	5,700	650,940.00	0.29
76	601088	中国神华	32,900	642,208.00	0.29
77	603486	科沃斯	2,800	638,624.00	0.29
78	600406	国电南瑞	27,240	633,057.60	0.28
79	002460	赣锋锂业	5,200	629,668.00	0.28
80	601211	国泰君安	36,568	626,775.52	0.28
81	000063	中兴通讯	18,600	618,078.00	0.28
82	601225	陕西煤业	49,800	590,130.00	0.27
83	300413	芒果超媒	8,600	589,960.00	0.27
84	600745	闻泰科技	6,000	581,400.00	0.26
85	600763	通策医疗	1,400	575,400.00	0.26
86	603986	兆易创新	3,060	574,974.00	0.26
87	601688	华泰证券	36,000	568,800.00	0.26
88	601229	上海银行	68,900	564,980.00	0.25
89	601857	中国石油	106,700	564,443.00	0.25
90	002129	中环股份	14,600	563,560.00	0.25
91	000625	长安汽车	21,100	554,508.00	0.25
92	600660	福耀玻璃	9,800	547,330.00	0.25
93	600837	海通证券	46,300	532,450.00	0.24
94	601988	中国银行	171,100	526,988.00	0.24
95	300601	康泰生物	3,516	523,884.00	0.24
96	601390	中国中铁	99,600	521,904.00	0.23
97	600588	用友网络	15,660	520,851.60	0.23
98	601100	恒立液压	6,016	516,894.72	0.23
99	000100	TCL 科技	67,500	516,375.00	0.23
100	600132	重庆啤酒	2,600	514,670.00	0.23
101	601009	南京银行	48,800	513,376.00	0.23

102	300999	金龙鱼	6,033	512,563.68	0.23
103	000338	潍柴动力	28,600	511,082.00	0.23
104	601006	大秦铁路	76,200	501,396.00	0.23
105	601169	北京银行	102,800	500,636.00	0.22
106	300142	沃森生物	8,100	499,770.00	0.22
107	000166	申万宏源	106,700	499,356.00	0.22
108	600919	江苏银行	69,580	494,018.00	0.22
109	600570	恒生电子	5,140	479,305.00	0.22
110	002049	紫光国微	3,100	477,989.00	0.21
111	601336	新华保险	10,200	468,282.00	0.21
112	601633	长城汽车	10,700	466,413.00	0.21
113	000895	双汇发展	14,600	464,280.00	0.21
114	601628	中国人寿	13,600	460,904.00	0.21
115	603806	福斯特	4,380	460,469.40	0.21
116	002709	天赐材料	4,320	460,425.60	0.21
117	603993	洛阳钼业	89,000	459,240.00	0.21
118	601989	中国重工	111,300	458,556.00	0.21
119	600760	中航沈飞	7,560	455,868.00	0.20
120	601155	新城控股	10,771	448,073.60	0.20
121	601138	工业富联	35,900	445,519.00	0.20
122	300454	深信服	1,700	441,116.00	0.20
123	300498	温氏股份	30,560	439,147.20	0.20
124	002050	三花智控	17,940	430,201.20	0.19
125	600926	杭州银行	29,000	427,750.00	0.19
126	000776	广发证券	28,000	423,920.00	0.19
127	603659	璞泰来	3,100	423,460.00	0.19
128	002841	视源股份	3,403	422,958.87	0.19
129	002179	中航光电	5,300	418,806.00	0.19
130	600989	宝丰能源	30,500	417,240.00	0.19
131	001979	招商蛇口	38,100	417,195.00	0.19
132	600600	青岛啤酒	3,600	416,340.00	0.19
133	300595	欧普康视	3,940	407,987.00	0.18
134	600741	华域汽车	15,400	404,558.00	0.18
135	000963	华东医药	8,700	400,287.00	0.18
136	600015	华夏银行	62,507	386,918.33	0.17
137	600111	北方稀土	18,600	385,020.00	0.17
138	000596	古井贡酒	1,600	383,200.00	0.17
139	603899	晨光文具	4,500	380,520.00	0.17
140	002568	百润股份	4,000	379,160.00	0.17
141	002601	龙佰集团	10,900	376,922.00	0.17
142	002821	凯莱英	1,011	376,698.60	0.17
143	300408	三环集团	8,865	376,053.30	0.17

144	601985	中国核电	72,800	368,368.00	0.17
145	600460	士兰微	6,500	366,275.00	0.16
146	300628	亿联网络	4,300	360,340.00	0.16
147	000768	中航西飞	13,700	360,036.00	0.16
148	601901	方正证券	38,372	359,161.92	0.16
149	002001	新和成	12,500	358,500.00	0.16
150	600150	中国船舶	21,400	353,314.00	0.16
151	600010	包钢股份	225,600	349,680.00	0.16
152	600547	山东黄金	18,120	348,266.40	0.16
153	601788	光大证券	19,300	345,277.00	0.16
154	601877	正泰电器	10,300	343,814.00	0.15
155	603833	欧派家居	2,420	343,543.20	0.15
156	600584	长电科技	9,100	342,888.00	0.15
157	300529	健帆生物	3,900	336,804.00	0.15
158	603882	金域医学	2,100	335,517.00	0.15
159	601600	中国铝业	63,200	334,960.00	0.15
160	000799	酒鬼酒	1,300	332,280.00	0.15
161	002271	东方雨虹	5,950	329,154.00	0.15
162	002736	国信证券	30,600	328,950.00	0.15
163	601916	浙商银行	82,000	325,540.00	0.15
164	000157	中联重科	35,200	325,248.00	0.15
165	600886	国投电力	33,840	325,202.40	0.15
166	600426	华鲁恒升	10,470	324,046.50	0.15
167	002064	华峰化学	22,800	323,760.00	0.15
168	002007	华兰生物	8,800	322,784.00	0.15
169	600176	中国巨石	20,788	322,421.88	0.14
170	000786	北新建材	8,200	321,850.00	0.14
171	002414	高德红外	11,454	315,901.32	0.14
172	300033	同花顺	2,800	315,784.00	0.14
173	000876	新希望	21,500	315,405.00	0.14
174	601377	兴业证券	32,500	313,950.00	0.14
175	601939	建设银行	47,100	313,215.00	0.14
176	688185	康希诺	400	311,108.00	0.14
177	603369	今世缘	5,700	308,712.00	0.14
178	000938	紫光股份	14,100	308,508.00	0.14
179	000301	东方盛虹	14,600	305,140.00	0.14
180	002600	领益智造	32,900	302,351.00	0.14
181	002236	大华股份	14,300	301,730.00	0.14
182	002648	卫星石化	7,660	300,195.40	0.13
183	300316	晶盛机电	5,900	297,950.00	0.13
184	600029	南方航空	49,300	296,786.00	0.13
185	603737	三棵树	1,680	295,680.00	0.13

186	600779	水井坊	2,300	290,605.00	0.13
187	300347	泰格医药	1,500	289,950.00	0.13
188	601669	中国电建	74,900	289,863.00	0.13
189	002916	深南电路	2,600	288,938.00	0.13
190	600845	宝信软件	5,650	287,585.00	0.13
191	601360	三六零	23,411	285,848.31	0.13
192	000069	华侨城 A	38,400	285,696.00	0.13
193	600958	东方证券	28,300	282,717.00	0.13
194	002938	鹏鼎控股	7,700	276,276.00	0.12
195	600061	国投资本	32,220	273,547.80	0.12
196	600143	金发科技	13,100	273,266.00	0.12
197	300003	乐普医疗	8,500	273,020.00	0.12
198	603160	汇顶科技	2,100	272,223.00	0.12
199	002791	坚朗五金	1,400	271,670.00	0.12
200	601799	星宇股份	1,200	270,864.00	0.12
201	600115	中国东航	53,300	270,764.00	0.12
202	603517	绝味食品	3,200	269,728.00	0.12
203	300496	中科创达	1,700	267,002.00	0.12
204	300146	汤臣倍健	8,100	266,490.00	0.12
205	300661	圣邦股份	1,050	265,366.50	0.12
206	601618	中国中冶	88,500	263,730.00	0.12
207	002024	苏宁易购	46,505	259,962.95	0.12
208	601966	玲珑轮胎	5,900	258,066.00	0.12
209	600754	锦江酒店	4,500	256,275.00	0.12
210	601021	春秋航空	4,500	256,050.00	0.12
211	601233	桐昆股份	10,600	255,354.00	0.11
212	603816	顾家家居	3,300	255,024.00	0.11
213	603345	安井食品	1,000	254,020.00	0.11
214	002074	国轩高科	5,800	252,648.00	0.11
215	300223	北京君正	2,500	252,300.00	0.11
216	601111	中国国航	32,400	252,072.00	0.11
217	601995	中金公司	4,000	246,000.00	0.11
218	601636	旗滨集团	13,200	244,992.00	0.11
219	600332	白云山	7,200	243,720.00	0.11
220	600183	生益科技	10,400	243,464.00	0.11
221	000425	徐工机械	38,000	242,060.00	0.11
222	002252	上海莱士	32,200	241,178.00	0.11
223	600885	宏发股份	3,800	238,260.00	0.11
224	600079	人福医药	8,300	234,641.00	0.11
225	002602	世纪华通	36,440	233,944.80	0.11
226	601878	浙商证券	17,700	231,516.00	0.10
227	002555	三七互娱	9,600	230,592.00	0.10

228	600362	江西铜业	10,300	230,514.00	0.10
229	002459	晶澳科技	4,700	230,300.00	0.10
230	600089	特变电工	17,900	230,015.00	0.10
231	300285	国瓷材料	4,700	229,125.00	0.10
232	601881	中国银河	21,200	228,536.00	0.10
233	600383	金地集团	22,300	228,352.00	0.10
234	601838	成都银行	18,000	227,520.00	0.10
235	600674	川投能源	18,300	225,639.00	0.10
236	002607	中公教育	10,740	224,358.60	0.10
237	600298	安琪酵母	4,111	223,556.18	0.10
238	002340	格林美	23,700	221,595.00	0.10
239	601727	上海电气	51,900	220,056.00	0.10
240	300144	宋城演艺	13,061	219,424.80	0.10
241	600606	绿地控股	40,100	218,545.00	0.10
242	300207	欣旺达	6,700	218,152.00	0.10
243	000066	中国长城	14,900	217,540.00	0.10
244	002625	光启技术	10,400	216,424.00	0.10
245	000703	恒逸石化	18,080	216,056.00	0.10
246	600352	浙江龙盛	15,700	215,718.00	0.10
247	601933	永辉超市	45,600	215,688.00	0.10
248	601117	中国化学	24,600	215,496.00	0.10
249	600018	上港集团	45,100	215,127.00	0.10
250	603939	益丰药房	3,830	214,824.70	0.10
251	002353	杰瑞股份	4,800	214,560.00	0.10
252	002624	完美世界	8,950	213,994.50	0.10
253	300676	华大基因	1,800	213,480.00	0.10
254	300699	光威复材	2,800	212,660.00	0.10
255	601216	君正集团	41,600	211,744.00	0.10
256	603233	大参林	4,120	210,573.20	0.09
257	600315	上海家化	3,500	210,490.00	0.09
258	000825	太钢不锈	28,000	209,720.00	0.09
259	002080	中材科技	8,000	209,360.00	0.09
260	600219	南山铝业	57,900	208,440.00	0.09
261	002185	华天科技	13,400	206,226.00	0.09
262	600489	中金黄金	23,900	206,018.00	0.09
263	601865	福莱特	5,200	205,556.00	0.09
264	000977	浪潮信息	7,300	205,349.00	0.09
265	601162	天风证券	42,200	205,092.00	0.09
266	601607	上海医药	9,700	204,961.00	0.09
267	600161	天坛生物	5,980	204,815.00	0.09
268	600862	中航高科	6,600	203,148.00	0.09
269	000932	华菱钢铁	30,700	202,620.00	0.09

270	600009	上海机场	4,200	202,146.00	0.09
271	002202	金风科技	16,600	201,856.00	0.09
272	601689	拓普集团	5,300	198,379.00	0.09
273	688009	中国通号	34,600	196,874.00	0.09
274	603185	上机数控	1,100	196,845.00	0.09
275	603589	口子窖	2,900	196,301.00	0.09
276	603638	艾迪精密	4,560	195,487.20	0.09
277	603658	安图生物	2,580	195,486.60	0.09
278	600188	兖州煤业	12,600	193,536.00	0.09
279	688008	澜起科技	3,100	193,378.00	0.09
280	000783	长江证券	26,400	193,248.00	0.09
281	002120	韵达股份	14,160	191,584.80	0.09
282	002013	中航机电	18,900	190,323.00	0.09
283	688002	睿创微纳	1,900	189,677.00	0.09
284	002690	美亚光电	3,400	189,584.00	0.09
285	601990	南京证券	18,000	189,360.00	0.09
286	600704	物产中大	24,000	188,880.00	0.08
287	300677	英科医疗	1,500	187,200.00	0.08
288	002920	德赛西威	1,700	187,136.00	0.08
289	002508	老板电器	4,000	186,000.00	0.08
290	600109	国金证券	14,600	185,274.00	0.08
291	603456	九洲药业	3,800	184,604.00	0.08
292	300558	贝达药业	1,700	184,008.00	0.08
293	601696	中银证券	8,900	183,251.00	0.08
294	002223	鱼跃医疗	4,800	183,024.00	0.08
295	300751	迈为股份	400	181,880.00	0.08
296	601108	财通证券	17,300	181,477.00	0.08
297	300357	我武生物	2,800	179,536.00	0.08
298	002032	苏泊尔	2,800	178,612.00	0.08
299	600068	葛洲坝	23,700	177,513.00	0.08
300	000807	云铝股份	14,900	177,310.00	0.08
301	002444	巨星科技	5,200	177,216.00	0.08
302	002384	东山精密	8,500	177,140.00	0.08
303	603605	珀莱雅	900	177,039.00	0.08
304	002673	西部证券	21,400	176,550.00	0.08
305	000830	鲁西化工	9,400	176,062.00	0.08
306	601872	招商轮船	37,980	175,467.60	0.08
307	000027	深圳能源	19,020	174,413.40	0.08
308	300724	捷佳伟创	1,500	174,015.00	0.08
309	002078	太阳纸业	12,900	172,215.00	0.08
310	601319	中国人保	29,000	171,970.00	0.08
311	601699	潞安环能	14,500	171,245.00	0.08

312	002157	正邦科技	14,300	170,885.00	0.08
313	600705	中航产融	44,100	170,667.00	0.08
314	300037	新宙邦	1,700	170,170.00	0.08
315	000050	深天马 A	12,000	170,160.00	0.08
316	601077	渝农商行	42,600	169,974.00	0.08
317	002044	美年健康	18,600	169,446.00	0.08
318	000728	国元证券	21,240	169,282.80	0.08
319	600872	中炬高新	4,000	168,080.00	0.08
320	002294	信立泰	5,100	167,790.00	0.08
321	002603	以岭药业	5,700	166,212.00	0.07
322	600655	豫园股份	14,300	165,737.00	0.07
323	603127	昭衍新药	900	165,375.00	0.07
324	002511	中顺洁柔	6,000	165,300.00	0.07
325	300450	先导智能	2,740	164,783.60	0.07
326	002180	纳思达	5,100	164,220.00	0.07
327	600038	中直股份	3,100	163,494.00	0.07
328	000800	一汽解放	15,100	163,382.00	0.07
329	000983	山西焦煤	19,620	163,042.20	0.07
330	002507	涪陵榨菜	4,300	161,938.00	0.07
331	000723	美锦能源	21,400	161,784.00	0.07
332	300253	卫宁健康	9,940	161,723.80	0.07
333	002152	广电运通	12,400	161,572.00	0.07
334	600699	均胜电子	6,300	160,776.00	0.07
335	600739	辽宁成大	7,701	160,257.81	0.07
336	002405	四维图新	10,900	160,230.00	0.07
337	000513	丽珠集团	3,200	160,064.00	0.07
338	600536	中国软件	2,800	159,404.00	0.07
339	002372	伟星新材	7,700	159,159.00	0.07
340	002430	杭氧股份	4,600	159,114.00	0.07
341	603444	吉比特	300	159,000.00	0.07
342	002156	通富微电	6,600	158,664.00	0.07
343	600369	西南证券	32,400	157,788.00	0.07
344	600521	华海药业	7,550	157,644.00	0.07
345	603707	健友股份	3,770	157,397.50	0.07
346	600372	中航电子	9,500	157,225.00	0.07
347	601555	东吴证券	18,800	156,792.00	0.07
348	600486	扬农化工	1,400	156,478.00	0.07
349	600549	厦门钨业	7,500	156,225.00	0.07
350	603338	浙江鼎力	2,660	156,115.40	0.07
351	600392	盛和资源	8,900	154,504.00	0.07
352	600233	圆通速递	15,300	153,153.00	0.07
353	600827	百联股份	7,600	153,140.00	0.07

354	000547	航天发展	8,100	152,847.00	0.07
355	300251	光线传媒	14,100	152,421.00	0.07
356	000656	金科股份	26,300	152,277.00	0.07
357	600803	新奥股份	9,200	151,892.00	0.07
358	002541	鸿路钢构	2,600	151,710.00	0.07
359	000739	普洛药业	5,150	151,410.00	0.07
360	002138	顺络电子	3,900	151,203.00	0.07
361	601615	明阳智能	9,300	150,567.00	0.07
362	600875	东方电气	13,700	150,289.00	0.07
363	002030	达安基因	7,052	149,784.48	0.07
364	600177	雅戈尔	22,680	149,461.20	0.07
365	600011	华能国际	35,400	149,388.00	0.07
366	000021	深科技	7,800	149,292.00	0.07
367	600522	中天科技	14,900	149,000.00	0.07
368	000860	顺鑫农业	3,516	148,304.88	0.07
369	600637	东方明珠	18,100	148,239.00	0.07
370	603866	桃李面包	4,740	147,888.00	0.07
371	601198	东兴证券	13,500	147,555.00	0.07
372	300136	信维通信	4,700	145,136.00	0.07
373	601058	赛轮轮胎	14,500	144,855.00	0.07
374	600487	亨通光电	12,700	144,780.00	0.07
375	688006	杭可科技	1,700	144,500.00	0.06
376	600516	方大炭素	19,380	144,187.20	0.06
377	600642	申能股份	23,400	143,676.00	0.06
378	600066	宇通客车	11,400	142,386.00	0.06
379	600039	四川路桥	22,500	141,075.00	0.06
380	002299	圣农发展	5,900	140,892.00	0.06
381	603712	七一二	3,900	140,790.00	0.06
382	600895	张江高科	7,700	140,679.00	0.06
383	603613	国联股份	1,400	139,958.00	0.06
384	600004	白云机场	12,500	139,750.00	0.06
385	002797	第一创业	19,500	139,230.00	0.06
386	600998	九州通	9,000	138,330.00	0.06
387	002939	长城证券	12,400	138,012.00	0.06
388	002409	雅克科技	1,700	137,700.00	0.06
389	000630	铜陵有色	50,500	137,360.00	0.06
390	600208	新湖中宝	44,600	135,584.00	0.06
391	002385	大北农	19,800	134,640.00	0.06
392	600380	健康元	9,700	133,181.00	0.06
393	600909	华安证券	23,700	132,009.00	0.06
394	300482	万孚生物	2,040	131,967.60	0.06
395	600415	小商品城	25,600	131,840.00	0.06

396	002422	科伦药业	6,600	131,670.00	0.06
397	002429	兆驰股份	21,600	131,112.00	0.06
398	300308	中际旭创	3,400	130,968.00	0.06
399	000975	银泰黄金	13,760	130,857.60	0.06
400	600988	赤峰黄金	8,700	130,413.00	0.06
401	002373	千方科技	7,800	130,260.00	0.06
402	600598	北大荒	8,700	130,152.00	0.06
403	002463	沪电股份	8,400	129,948.00	0.06
404	600511	国药股份	3,900	128,934.00	0.06
405	000709	河钢股份	52,300	128,658.00	0.06
406	603267	鸿远电子	1,000	127,920.00	0.06
407	002563	森马服饰	10,700	127,865.00	0.06
408	601231	环旭电子	7,600	127,756.00	0.06
409	002266	浙富控股	25,600	127,744.00	0.06
410	000999	华润三九	4,700	125,725.00	0.06
411	603858	步长制药	5,500	123,695.00	0.06
412	002242	九阳股份	3,800	123,462.00	0.06
413	601456	国联证券	8,000	123,200.00	0.06
414	600848	上海临港	6,880	123,152.00	0.06
415	300463	迈克生物	2,900	122,061.00	0.05
416	002926	华西证券	12,600	121,338.00	0.05
417	002146	荣盛发展	21,500	121,260.00	0.05
418	600170	上海建工	43,700	120,612.00	0.05
419	002153	石基信息	5,120	120,371.20	0.05
420	600977	中国电影	9,600	120,288.00	0.05
421	600160	巨化股份	13,600	120,224.00	0.05
422	600867	通化东宝	10,000	119,400.00	0.05
423	002127	南极电商	12,200	119,194.00	0.05
424	300773	拉卡拉	4,200	118,566.00	0.05
425	000423	东阿阿胶	3,300	118,503.00	0.05
426	002065	东华软件	14,800	117,364.00	0.05
427	000738	航发控制	5,633	117,335.39	0.05
428	002010	传化智联	15,200	117,192.00	0.05
429	002075	沙钢股份	10,700	116,737.00	0.05
430	002925	盈趣科技	3,000	116,730.00	0.05
431	002557	洽洽食品	2,700	116,370.00	0.05
432	002151	北斗星通	2,700	116,289.00	0.05
433	600688	上海石化	30,900	116,184.00	0.05
434	002456	欧菲光	13,000	115,440.00	0.05
435	002500	山西证券	17,170	115,210.70	0.05
436	002958	青农商行	26,700	114,276.00	0.05
437	600801	华新水泥	6,500	114,205.00	0.05

438	603218	日月股份	4,200	113,736.00	0.05
439	000750	国海证券	26,800	113,632.00	0.05
440	600153	建发股份	14,000	113,400.00	0.05
441	600256	广汇能源	34,000	113,220.00	0.05
442	000988	华工科技	4,800	112,896.00	0.05
443	600027	华电国际	32,700	112,488.00	0.05
444	601099	太平洋	33,100	112,209.00	0.05
445	601992	金隅集团	41,500	111,635.00	0.05
446	601598	中国外运	22,000	111,100.00	0.05
447	000987	越秀金控	8,700	110,142.00	0.05
448	603027	千禾味业	4,180	109,892.20	0.05
449	600859	王府井	3,800	109,744.00	0.05
450	300070	碧水源	15,000	109,650.00	0.05
451	002212	天融信	5,500	108,735.00	0.05
452	000961	中南建设	18,300	108,336.00	0.05
453	300383	光环新网	7,500	107,925.00	0.05
454	002558	巨人网络	8,100	107,730.00	0.05
455	600026	中远海能	17,100	105,336.00	0.05
456	600529	山东药玻	3,100	105,245.00	0.05
457	000671	阳光城	19,800	102,960.00	0.05
458	002081	金螳螂	13,000	102,960.00	0.05
459	002683	宏大爆破	3,700	102,749.00	0.05
460	002727	一心堂	3,100	102,641.00	0.05
461	600879	航天电子	13,600	102,272.00	0.05
462	002465	海格通信	10,800	102,168.00	0.05
463	600498	烽火通信	5,400	100,602.00	0.05
464	600340	华夏幸福	19,140	100,293.60	0.05
465	002019	亿帆医药	5,800	100,050.00	0.04
466	300088	长信科技	12,100	99,946.00	0.04
467	002705	新宝股份	3,800	99,750.00	0.04
468	600201	生物股份	5,700	99,465.00	0.04
469	300296	利亚德	12,700	99,314.00	0.04
470	600583	海油工程	21,900	98,550.00	0.04
471	000729	燕京啤酒	13,600	98,464.00	0.04
472	000998	隆平高科	6,100	97,844.00	0.04
473	002506	协鑫集成	27,800	96,744.00	0.04
474	000402	金融街	14,300	96,525.00	0.04
475	000686	东北证券	11,400	96,330.00	0.04
476	000629	攀钢钒钛	41,600	95,264.00	0.04
477	300418	昆仑万维	5,500	90,090.00	0.04
478	000540	中天金融	32,900	89,817.00	0.04
479	001914	招商积余	5,200	89,336.00	0.04

480	300212	易华录	3,280	88,264.80	0.04
481	603883	老百姓	1,660	87,448.80	0.04
482	000627	天茂集团	23,600	85,432.00	0.04
483	000581	威孚高科	4,100	85,403.00	0.04
484	000623	吉林敖东	5,400	83,646.00	0.04
485	601128	常熟银行	13,400	83,080.00	0.04
486	002399	海普瑞	5,000	79,650.00	0.04
487	601098	中南传媒	8,800	77,616.00	0.03
488	000401	冀东水泥	6,200	76,570.00	0.03
489	002131	利欧股份	32,300	75,582.00	0.03
490	002572	索菲亚	2,200	53,240.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688133	泰坦科技	884	280,997.08	0.13
2	688575	亚辉龙	2,702	86,707.18	0.04
3	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.03
4	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.03
5	688359	三孚新科	2,213	58,312.55	0.03
6	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.03
7	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.02
8	688616	西力科技	3,918	53,990.04	0.02
9	300919	中伟股份	320	52,160.00	0.02
10	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
11	300957	贝泰妮	155	39,053.80	0.02
12	300910	瑞丰新材	356	37,219.80	0.02
13	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
14	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
15	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
16	300979	华利集团	259	22,662.50	0.01
17	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
18	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.01
19	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
20	300973	立高食品	171	19,786.41	0.01
21	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.01
22	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
23	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.01
24	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
25	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
26	301009	可靠股份	537	14,976.93	0.01
27	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01

28	300884	狄耐克	531	14,273.28	0.01
29	300907	康平科技	473	13,915.66	0.01
30	002410	广联达	200	13,640.00	0.01
31	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
32	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
33	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
34	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
35	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
36	300908	仲景食品	214	12,752.26	0.01
37	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
38	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
39	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
40	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
41	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
42	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
43	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
44	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
45	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
46	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
47	300968	格林精密	791	9,547.37	0.00
48	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
49	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
50	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
51	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
52	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
53	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
54	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
55	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
56	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
57	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
58	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
59	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
60	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
61	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
62	300902	国安达	320	7,539.20	0.00
63	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
64	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
65	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
66	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
67	300900	广联航空	170	6,354.60	0.00
68	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
69	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
70	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00

71	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
72	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
73	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
74	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
75	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
76	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
77	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
78	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
79	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
80	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00
81	002216	三全食品	70	1,152.90	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	000858	五粮液	5,035,567.21	1.68
2	300750	宁德时代	4,685,044.50	1.56
3	000333	美的集团	2,539,321.00	0.85
4	000568	泸州老窖	2,413,165.06	0.80
5	300760	迈瑞医疗	2,033,144.00	0.68
6	000001	平安银行	2,007,571.00	0.67
7	002594	比亚迪	1,897,988.00	0.63
8	002352	顺丰控股	1,860,910.00	0.62
9	002304	洋河股份	1,790,541.00	0.60
10	300122	智飞生物	1,628,447.51	0.54
11	002714	牧原股份	1,589,444.80	0.53
12	600036	招商银行	1,555,354.00	0.52
13	300015	爱尔眼科	1,542,661.00	0.51
14	002475	立讯精密	1,422,786.00	0.47
15	300059	东方财富	1,350,468.99	0.45
16	000002	万科 A	1,255,102.00	0.42
17	600519	贵州茅台	1,253,190.00	0.42
18	002142	宁波银行	1,138,046.00	0.38
19	002371	北方华创	1,036,968.29	0.35
20	000725	京东方 A	986,340.00	0.33

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	000858	五 粮 液	7,617,986.00	2.54
2	300750	宁德时代	7,333,576.36	2.44
3	002415	海康威视	3,577,818.00	1.19
4	000568	泸州老窖	3,154,785.00	1.05
5	000001	平安银行	2,886,706.60	0.96
6	600519	贵州茅台	2,853,190.00	0.95
7	002594	比亚迪	2,820,178.00	0.94
8	300760	迈瑞医疗	2,702,345.00	0.90
9	002304	洋河股份	2,573,058.00	0.86
10	002714	牧原股份	2,468,621.30	0.82
11	300015	爱尔眼科	2,359,468.33	0.79
12	002475	立讯精密	2,302,527.00	0.77
13	002352	顺丰控股	2,267,388.00	0.75
14	300122	智飞生物	2,107,450.00	0.70
15	300059	东方财富	1,968,551.00	0.66
16	000002	万 科 A	1,910,593.99	0.64
17	002142	宁波银行	1,682,800.70	0.56
18	000725	京东方 A	1,457,876.19	0.49
19	300124	汇川技术	1,260,132.00	0.42
20	300014	亿纬锂能	1,208,070.00	0.40

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	125,464,382.18
卖出股票收入（成交）总额	161,136,691.84

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	102,000.00	0.05

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	102,000.00	0.05

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113050	南银转债	1,020	102,000.00	0.05

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

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
IF2107	沪深 300 期货 2107 合约	3	4,672,080.00	-52,515.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-52,515.00
股指期货投资本期收益（元）					492,830.10
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-461,715.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品。本基金投资股指期货是根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过建立股指期货多头或空头头寸进行套期保值，以对冲资产组合的系统性风险和流动性风险。本基金利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

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	610,334.64
2	应收证券清算款	328,682.49
3	应收股利	-
4	应收利息	1,834.06
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	940,851.19

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：本基金本报告期末前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688575	亚辉龙	86,707.18	0.04	流通受限
2	688113	联测科技	69,745.35	0.03	流通受限
3	301018	申菱环境	64,753.19	0.03	流通受限
4	688359	三孚新科	58,312.55	0.03	流通受限

§ 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 (%)
311	443,039.08	124,643,155.00	90.46	13,142,000.00	9.54

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	49,630,600.00	36.02

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	浦银安盛基金—中国 银行—浦银安盛和盈 1号集合资产管理计划	23,784,200.00	17.26
2	华安财保资管—兴业 银行—安泰固定收益 集合资产管理产品	10,002,700.00	7.26
3	太平养老金溢优混合 型养老金产品—中国 建设银行股份有限公司	6,452,050.00	4.68
4	交银施罗德基金—建 设银行—交银施罗德 固收增强1号集合资 产管理计划	6,214,000.00	4.51
5	浦银安盛基金—建信 期货有限责任公司— 浦银安盛盛明6号单 —资产管理计划	5,300,000.00	3.85
6	太平养老金溢鑫混合 型养老金产品—招商 银行股份有限公司	5,001,575.00	3.63
7	招商证券股份有限公 司	4,851,296.00	3.52
8	平安基金—财通证券	4,079,700.00	2.96

	股份有限公司—平安基金财固二号单一资产管理计划		
9	方正证券股份有限公司	3,578,400.00	2.60
10	中信证券股份有限公司	2,757,850.00	2.00
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	49,630,600.00	36.02

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	203,785,155.00
本报告期基金总申购份额	111,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	177,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	137,785,155.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	2	184,369,502.06	65.90%	134,830.81	60.28%	-
天风证券	1	54,998,548.62	19.66%	51,221.35	22.90%	-
国泰君安	1	40,386,051.94	14.44%	37,611.41	16.82%	-

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	-	-	-	-	-	-

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 2020 年第 4 季度报告	规定网站	2021 年 01 月 22 日
2	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号—指数基金指引》修改基金合同的公告	报刊及规定网站	2021 年 03 月 31 日
3	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同	规定网站	2021 年 03 月 31 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 2020 年年度报告	规定网站	2021 年 03 月 31 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）2021 年第 1 号	规定网站	2021 年 04 月 01 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	2021 年 04 月 01 日

7	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	规定网站	2021 年 04 月 22 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招募说明书（更新）2021 年第 2 号	规定网站	2021 年 04 月 30 日
9	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	2021 年 04 月 30 日
10	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金调整基金投资范围及（或）引入侧袋机制并相应修改法律文件的公告	报刊及规定网站	2021 年 06 月 24 日
11	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2021 年 06 月 24 日
12	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）2021 年第 3 号	规定网站	2021 年 06 月 24 日
13	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议	规定网站	2021 年 06 月 24 日
14	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同	规定网站	2021 年 06 月 24 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	2021 年 01 月 01 日-2021 年 06 月 30 日	77,079,400.00	53,518,800.00	80,967,600.00	49,630,600.00	36.02
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</p>							

终止等风险。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 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

上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼基金管理人办公场所。

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日