

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数
证券投资基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息内容的真实、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	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末上市基金前十名持有人	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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	17,785,155.00 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	许俊
	联系电话	021-23212888	010-66596688
	电子邮箱	compliance@py-axa.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	95566
传真		021-23212985	010-66594942
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区滨江大道 5189 号地下 1 层、地上 1 层至地上 4 层、地上 6 层至地上 7 层	北京西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层	北京西城区复兴门内大街 1 号

邮政编码	200127	100818
法定代表人	谢伟	葛海蛟

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	-4,459,848.19
本期利润	2,005,066.15
加权平均基金份额本期利润	0.0640
本期加权平均净值利润率	4.69%
本期基金份额净值增长率	-2.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	5,228,019.06
期末可供分配基金份额利润	0.2940
期末基金资产净值	23,013,174.06
期末基金份额净值	1.2940
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	29.40%

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

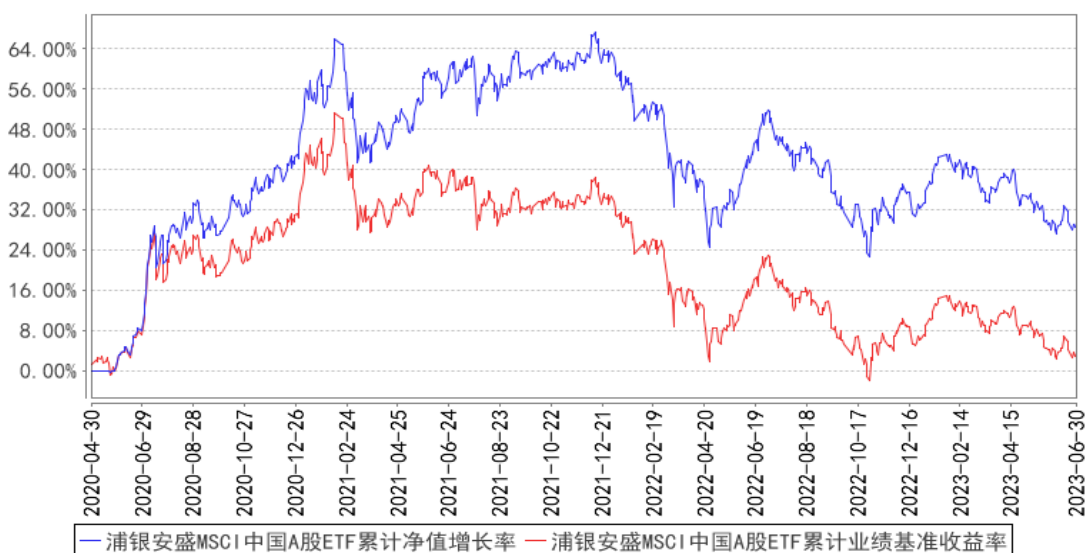
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	0.94%	0.84%	0.44%	0.86%	0.50%	-0.02%
过去三个月	-5.78%	0.77%	-6.34%	0.79%	0.56%	-0.02%
过去六个月	-2.45%	0.77%	-2.71%	0.79%	0.26%	-0.02%
过去一年	-14.41%	0.93%	-15.40%	0.95%	0.99%	-0.02%
过去三年	17.95%	1.17%	-4.83%	1.19%	22.78%	-0.02%
自基金合同生效起至今	29.40%	1.14%	3.61%	1.17%	25.79%	-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



§ 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2023年6月30日止，浦银安盛旗下共管理103只公募基金，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

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（原浦银安盛 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、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛日日丰货币市场基金、浦银安盛盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛日日鑫货币市场基金、浦银安盛盛达纯债债券型证券投资基金、浦银安盛经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银安盛安和回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金（QDII）、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛焯 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（原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基金中基金、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、浦银安盛养老目标日期 2040 三年持有期混合型发起式基金中基金（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、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛鑫福混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金、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、浦银安盛中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银安盛普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛中证沪港深消费龙头交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛兴耀优选一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普诚纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银安盛季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛普旭 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛光耀优选混合型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛安荣回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛景气优选混合型证券投资基金、浦银安盛普兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金。

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。当前公司顺利完成上交所金桥机房搬迁，新职场大楼信息技术相关系统建设，结合合肥异地灾备中心，初步形成两地三中心的布局，进一步完善了公司信息技术基础设施系统建设，这些系统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，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行业内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。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。近年，公司信息技术部以自主开发平台为基础，构建了数字化运营平台、大数据开发平台、创新研发平台、移动平台等业务应用平台，初步创建了公司自研团队。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	-	12年	高钢杰先生，中国科学院天体物理博士。2010年10月至2014年3月在上海东证期货研究所、国泰君安期货研究所担任量化投资研究员。2014年3月至2018年10月在中国工商银行总行贵金属业务部工作，历任产品研发经理、代客交易经理。2018年10月加入浦银安盛基金管理有限公司，参与ETF业务筹备工作，2023年6月起任指数与量化投资部业务主管兼基金经理。2019年3月至2023年1月担任浦银安盛中证高股息精选交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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。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及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 月起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。2022 年 6 月起担任浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 1 月起担任浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 3 月起担任浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在具体执行中，在投资决策流程上，构建统一的研究平台，为所有投资组合公平的提供研究支持。在投资决策过程中，严格遵守公司的各项投资管理制度和投资授权制度，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。在交易执行环节上，详细规定了面对多个投资组合交易执行的流程和规定，以保证投资执行交易过程的公平性。公司严格控制主动投资组合的同日反向交易，非经特别控制流程审批同意，不得进行。从事后监控角

度上，定期对组合间同一投资标的的临近交易日的同向交易和反向交易的合理性分析评估，以及不同时间窗口下（1日、3日、5日、10日）的季度公平性交易分析评估，对旗下投资组合及其各投资类别的收益率差异进行分析。公司定期对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行检查，季度公平交易分析报告按规定经基金经理或投资经理签字，并经督察长、总经理审阅签字后，归档保存。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2023 年上半年市场冲高回落，宏观经济复苏力度在二季度转弱，而较强的政策预期未能如期兑现，致使市场在报告中后期开始回调。从 2022 年 11 月疫情政策优化以来，参照欧美疫后复苏路径，国内经济随着多场景需求的恢复迎来快速复苏，市场在此预期下开始走势较强。然而，二季度以来，边际不断转弱的基本面数据提醒市场重新定价，而预期较强的稳增长政策亦迟迟未能及时推出，市场继续震荡走低。在经济基本面亮点不多的情况下，主题性行情此起彼伏，热情高涨，比如人工智能催化下的 TMT、“中特估”等，成为上半年市场的重要投资机会。随着上半年接近尾声，一方面，投资者预期边际走弱的经济复苏力度将提升 7 月政治局会议稳增长措施的概率；另一方面，市场业已反应基本面的悲观预期，且报告期末的库存周期有接近底部迹象，主要指数开始筑底震荡。报告期内，本基金保持对标的指数收益率的紧密跟踪，将跟踪误差控制在较低水平，较好地实现了基金的投资目标。

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 1.2940 元，本报告期基金份额净值增长率为-2.45%；同期业绩比较基准收益率为-2.71%。

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，我们认为市场相对上半年或有更为积极的表现，三个方面的催化因素值得关注：一是 7 月政治局会议稳增长定调与具体措施推进的力度与效果，特别是国内经济内生复苏动能有望在二季度的基础上环比增强，叠加政策发力共同作用将加大国内经济复苏斜率；二是近期通胀、就业数据显示美联储利率有望在三季度见顶，加息政策或已行至终点，接下去的降息预期将提振投资者对于全球流动性的信心，利好风险资产的估值上行，也为国内货币政策降息、降准打开空间；三是对于国内经济高质量转型发展的预期在不断加强，这要求资本市场有更好地表现，投资端、交易端、融资端共同优化带来资本市场创新发展机遇，推进落实“活跃资本市场，提振投资者信心”，将提升投资者的获得感，有望增加居民财产性收入，形成较好地正向循环。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会成员均具有 5 年以上专业工作经历，具备良好的专业经验、胜任能力和独立性。估值委员会的职责主要包括：保证基金估值的公平、合理；制订健全、有效的估值政策和程序；确保对投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性；定期对估值政策和程序进行评价等。

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

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

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规和基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本报告期内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、本报告期内超过连续六十个工作日基金资产净值低于五千万，本基金管理人已按规定向中国证监会进行了报告并提交了解决方案。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	857,523.26	1,434,442.93
结算备付金		33,278.20	1,110,455.39
存出保证金		21,517.01	319,929.82
交易性金融资产	6.4.7.2	22,227,215.40	76,689,099.78
其中：股票投资		22,227,215.40	76,689,099.78
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		23,139,533.87	79,553,927.92
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,543.78	10,435.11
应付托管费		1,181.26	3,478.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	121,634.77	233,407.92
负债合计		126,359.81	247,321.36
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	17,785,155.00	59,785,155.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,228,019.06	19,521,451.56
净资产合计		23,013,174.06	79,306,606.56
负债和净资产总计		23,139,533.87	79,553,927.92

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2940 元，基金份额总额 17,785,155.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,187,393.17	-28,477,178.97
1. 利息收入		4,282.03	21,585.26
其中：存款利息收入	6.4.7.13	4,282.03	21,585.26
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,363,896.90	-12,443,904.85
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,754,603.77	-13,897,446.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	21,636.46
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	92,562.51	-278,848.33
股利收益	6.4.7.19	298,144.36	1,710,753.06
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	6,464,914.34	-16,167,805.95
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	82,093.70	112,946.57
减：二、营业总支出		182,327.02	395,689.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	32,075.15	176,563.20
2. 托管费	6.4.10.2.2	10,691.75	58,854.38
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		333.43	-
8. 其他费用	6.4.7.23	139,226.69	160,271.58
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,005,066.15	-28,872,868.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,005,066.15	-28,872,868.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,005,066.15	-28,872,868.13

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	59,785,155.00	-	19,521,451.56	79,306,606.56
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基	59,785,155.00	-	19,521,451.56	79,306,606.56

金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-42,000,000.00	-	-14,293,432.50	-56,293,432.50
(一)、综合收益总额	-	-	2,005,066.15	2,005,066.15
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-42,000,000.00	-	-16,298,498.65	-58,298,498.65
其中:1.基金申购款	21,000,000.00	-	6,902,592.06	27,902,592.06
2.基金赎回款	-63,000,000.00	-	-23,201,090.71	-86,201,090.71
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净	17,785,155.00	-	5,228,019.06	23,013,174.06

资产(基金净值)				
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	206,785,155.00	-	130,943,316.21	337,728,471.21
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	206,785,155.00	-	130,943,316.21	337,728,471.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-63,000,000.00	-	-57,348,562.43	-120,348,562.43
(一)、综合收益总额	-	-	-28,872,868.13	-28,872,868.13
(二)、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)	-63,000,000.00	-	-28,475,694.30	-91,475,694.30
其中:1.基金申购款	39,000,000.00	-	18,980,373.81	57,980,373.81
2	-102,000,000.00	-	-47,456,068.11	-149,456,068.11

基金赎回款				
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	143,785,155.00	-	73,594,753.78	217,379,908.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

郁蓓华

顾佳

钱琨

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1746 号《关于准予浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由浦银安盛基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 554,709,330.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0316 号验资报告予以验证。经向中国证监会备

案,《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 4 月 30 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 554,785,155.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 75,825.00 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银安盛基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]141 号核准,本基金 554,785,155.00 份基金份额于 2020 年 5 月 29 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金主要投资于标的指数(即 MSCI 中国 A 股人民币指数)的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	857,523.26
等于：本金	857,438.80
加：应计利息	84.46
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	857,523.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	24,002,780.97	-	22,227,215.40	-1,775,565.57
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	24,002,780.97	-	22,227,215.40	-1,775,565.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金在本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金在本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末均未按预期信用损失一般模型计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期期末不存在其他权益工具投资情况。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金在本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	17,210.41
其中：交易所市场	17,210.41
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	69,424.36
应付指数使用费	35,000.00
合计	121,634.77

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,785,155.00	59,785,155.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-63,000,000.00	-63,000,000.00
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	17,785,155.00	17,785,155.00

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	29,695,107.63	-10,173,656.07	19,521,451.56
本期利润	-4,459,848.19	6,464,914.34	2,005,066.15
本期基金份额交易产生的变动数	-19,086,055.75	2,787,557.10	-16,298,498.65
其中：基金申购款	8,417,577.11	-1,514,985.05	6,902,592.06
基金赎回款	-27,503,632.86	4,302,542.15	-23,201,090.71
本期已分配利润	-	-	-

本期末	6,149,203.69	-921,184.63	5,228,019.06
-----	--------------	-------------	--------------

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
活期存款利息收入		1,981.37
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		1,938.58
其他		362.08
合计		4,282.03

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-3,274,012.76
股票投资收益——赎回差价收入		-1,480,591.01
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		-4,754,603.77

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
卖出股票成交总额		42,752,976.00
减：卖出股票成本总额		45,932,070.55
减：交易费用		94,918.21
买卖股票差价收入		-3,274,012.76

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
赎回基金份额对价总额		86,201,090.71
减：现金支付赎回款总额		37,970,282.71
减：赎回股票成本总额		49,711,399.01
减：交易费用		-
赎回差价收入		-1,480,591.01

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益—申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益—证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益—买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券投资收益—申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益—买卖贵金属差价收入。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益—赎回差价收入。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

6.4.7.18 衍生工具收益**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	92,562.51

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	298,144.36
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	298,144.36

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	6,426,514.34
股票投资	6,426,514.34
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	6,464,914.34

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	82,093.70
合计	82,093.70

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	487.26
指数使用费	69,315.07
合计	139,226.69

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

注：截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

注：截至财务报表报出日，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

注：本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
浦银安盛基金管理有限公司（“浦银安盛”）	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
上海浦东发展银行股份有限公司（“上海浦东发展银行”）	基金管理人的股东
浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	32,075.15	176,563.20
其中：支付销售机构的客户维护费	9.92	4,442.80

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,691.75	58,854.38

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

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：本基金在本报告期末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：本基金本报告期内未发生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。

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：本基金本报告期内未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	5,591,900.00	31.44	13,010,100.00	21.76

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	857,523.26	1,981.37	6,924,789.96	10,622.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金在本报告期与上年度可比期间均无其他关联交易事项。

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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场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

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数 MSCI China A RMB Index (MSCI 中国 A 股人民币指数) 的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资于标的指数（即 MSCI 中国 A 股人民币指数）的成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货等及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，现金不包括结算备付金、存出

保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或变更投资品种的比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以将其新投资品种纳入投资范围或根据变更后的比例限制调整上述投资比例。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制再限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无债券投资和资产支持证券投资(2022 年 12 月 31 日：无)。

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2023 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(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 2023 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 2023 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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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	857,523.26	-	-	-	857,523.26
结算备付金	33,278.20	-	-	-	33,278.20
存出保证金	21,517.01	-	-	-	21,517.01
交易性金融资产	-	-	-	22,227,215.40	22,227,215.40
资产总计	912,318.47	-	-	22,227,215.40	23,139,533.87

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,543.78	3,543.78
应付托管费	-	-	-	1,181.26	1,181.26
其他负债	-	-	-	121,634.77	121,634.77
负债总计	-	-	-	126,359.81	126,359.81
利率敏感度缺口	912,318.47	-	-	22,100,855.59	23,013,174.06
上年度末 2022 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	1,434,442.93	-	-	-	1,434,442.93
结算备付金	1,110,455.39	-	-	-	1,110,455.39
存出保证金	319,929.82	-	-	-	319,929.82
交易性金融资产	-	-	-	76,689,099.78	76,689,099.78
资产总计	2,864,828.14	-	-	76,689,099.78	79,553,927.92
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	10,435.11	10,435.11
应付托管费	-	-	-	3,478.33	3,478.33
其他负债	-	-	-	233,407.92	233,407.92
负债总计	-	-	-	247,321.36	247,321.36
利率敏感度缺口	2,864,828.14	-	-	76,441,778.42	79,306,606.56

注：

表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2022 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（2022 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪 MSCI 中国 A 股人民币指数，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金股票组合

根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	22,227,215.40	96.58	76,689,099.78	96.70
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	22,227,215.40	96.58	76,689,099.78	96.70

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（附注 6.4.1）以外的其他市场变量保持不变		
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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）	
分析	业绩比较基准上升 500 基点	1,095,208.89	3,825,469.83
	业绩比较基准下降 500 基点	-1,095,208.89	-3,825,469.83

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	22,227,215.40	76,392,319.98
第二层次	-	100,447.20
第三层次	-	196,332.60
合计	22,227,215.40	76,689,099.78

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2022年12月31日：同）。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

注：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	22,227,215.40	96.06
	其中：股票	22,227,215.40	96.06
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	890,801.46	3.85
8	其他各项资产	21,517.01	0.09
9	合计	23,139,533.87	100.00

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	227,417.20	0.99
B	采矿业	928,337.60	4.03
C	制造业	13,050,148.52	56.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	769,228.16	3.34
E	建筑业	450,193.40	1.96
F	批发和零售业	234,617.03	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	689,401.60	3.00
H	住宿和餐饮业	32,540.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,192,009.93	5.18
J	金融业	3,697,537.75	16.07
K	房地产业	305,372.11	1.33
L	租赁和商务服务业	197,223.00	0.86

M	科学研究和技术服务业	151,370.40	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	27,035.60	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	13,630.00	0.06
Q	卫生和社会工作	157,382.70	0.68
R	文化、体育和娱乐业	77,029.40	0.33
S	综合	26,741.00	0.12
	合计	22,227,215.40	96.58

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	703	1,188,773.00	5.17
2	300750	宁德时代	2,380	544,520.20	2.37
3	600036	招商银行	10,971	359,409.96	1.56
4	000858	五粮液	2,100	343,497.00	1.49
5	600900	长江电力	12,400	273,544.00	1.19
6	002594	比亚迪	1,050	271,183.50	1.18
7	601318	中国平安	5,800	269,120.00	1.17
8	300760	迈瑞医疗	700	209,860.00	0.91
9	000568	泸州老窖	900	188,613.00	0.82
10	601166	兴业银行	10,800	169,020.00	0.73
11	600276	恒瑞医药	3,372	161,518.80	0.70
12	600309	万华化学	1,800	158,112.00	0.69
13	601398	工商银行	32,700	157,614.00	0.68
14	601288	农业银行	43,500	153,555.00	0.67
15	688111	金山办公	300	141,666.00	0.62
16	601012	隆基绿能	4,560	130,735.20	0.57
17	002371	北方华创	400	127,060.00	0.55
18	600030	中信证券	6,410	126,789.80	0.55
19	300059	东方财富	8,905	126,451.00	0.55
20	002714	牧原股份	2,988	125,944.20	0.55

21	600809	山西汾酒	680	125,847.60	0.55
22	601668	中国建筑	21,700	124,558.00	0.54
23	601899	紫金矿业	10,900	123,933.00	0.54
24	002475	立讯精密	3,768	122,271.60	0.53
25	601888	中国中免	1,100	121,583.00	0.53
26	603288	海天味业	2,560	119,936.00	0.52
27	002304	洋河股份	909	119,397.15	0.52
28	002352	顺丰控股	2,600	117,234.00	0.51
29	000001	平安银行	10,400	116,792.00	0.51
30	600436	片仔癀	400	114,544.00	0.50
31	601328	交通银行	19,500	113,100.00	0.49
32	600000	浦发银行	15,300	110,772.00	0.48
33	601088	中国神华	3,600	110,700.00	0.48
34	688032	禾迈股份	298	105,834.70	0.46
35	300274	阳光电源	900	104,967.00	0.46
36	601225	陕西煤业	5,700	103,683.00	0.45
37	601138	工业富联	4,100	103,320.00	0.45
38	300015	爱尔眼科	5,414	100,429.70	0.44
39	600028	中国石化	15,600	99,216.00	0.43
40	600887	伊利股份	3,500	99,120.00	0.43
41	603444	吉比特	200	98,222.00	0.43
42	601601	中国太保	3,700	96,126.00	0.42
43	600406	国电南瑞	4,066	93,924.60	0.41
44	300124	汇川技术	1,450	93,104.50	0.40
45	603986	兆易创新	860	91,375.00	0.40
46	300896	爱美客	200	88,990.00	0.39
47	002142	宁波银行	3,500	88,550.00	0.38
48	601816	京沪高铁	16,600	87,316.00	0.38
49	603259	药明康德	1,380	85,987.80	0.37
50	600438	通威股份	2,500	85,775.00	0.37
51	002459	晶澳科技	1,972	82,232.40	0.36
52	600690	海尔智家	3,500	82,180.00	0.36
53	600048	保利发展	6,300	82,089.00	0.36
54	000063	中兴通讯	1,800	81,972.00	0.36
55	002230	科大讯飞	1,200	81,552.00	0.35
56	600905	三峡能源	14,900	80,013.00	0.35
57	601857	中国石油	10,600	79,182.00	0.34
58	688301	奕瑞科技	280	79,080.40	0.34
59	603833	欧派家居	820	78,556.00	0.34
60	688012	中微公司	500	78,225.00	0.34
61	002129	TCL 中环	2,350	78,020.00	0.34
62	600050	中国联通	16,200	77,760.00	0.34
63	600031	三一重工	4,656	77,429.28	0.34

64	000725	京东方 A	18,600	76,074.00	0.33
65	601390	中国中铁	10,000	75,800.00	0.33
66	600150	中国船舶	2,300	75,693.00	0.33
67	601658	邮储银行	15,200	74,328.00	0.32
68	000596	古井贡酒	300	74,214.00	0.32
69	601766	中国中车	11,400	74,100.00	0.32
70	601818	光大银行	24,000	73,680.00	0.32
71	688036	传音控股	500	73,500.00	0.32
72	601988	中国银行	18,300	71,553.00	0.31
73	300033	同花顺	400	70,112.00	0.30
74	000002	万 科 A	5,000	70,100.00	0.30
75	600016	民生银行	18,600	69,750.00	0.30
76	300014	亿纬锂能	1,102	66,671.00	0.29
77	600019	宝钢股份	11,800	66,316.00	0.29
78	601985	中国核电	9,300	65,565.00	0.28
79	300498	温氏股份	3,560	65,326.00	0.28
80	002493	荣盛石化	5,600	65,184.00	0.28
81	688169	石头科技	200	64,136.00	0.28
82	601919	中远海控	6,820	64,108.00	0.28
83	603659	璞泰来	1,660	63,445.20	0.28
84	002466	天齐锂业	900	62,919.00	0.27
85	002920	德赛西威	400	62,324.00	0.27
86	000792	盐湖股份	3,200	61,344.00	0.27
87	600893	航发动力	1,400	59,164.00	0.26
88	300308	中际旭创	400	58,980.00	0.26
89	300122	智飞生物	1,300	57,460.00	0.25
90	600919	江苏银行	7,780	57,183.00	0.25
91	300316	晶盛机电	800	56,720.00	0.25
92	600104	上汽集团	4,000	56,680.00	0.25
93	601066	中信建投	2,300	55,660.00	0.24
94	000625	长安汽车	4,302	55,624.86	0.24
95	603501	韦尔股份	565	55,392.60	0.24
96	601006	大秦铁路	7,400	54,982.00	0.24
97	603806	福斯特	1,477	54,929.63	0.24
98	000651	格力电器	1,500	54,765.00	0.24
99	601211	国泰君安	3,868	54,113.32	0.24
100	601688	华泰证券	3,900	53,703.00	0.23
101	000166	申万宏源	11,600	53,592.00	0.23
102	600999	招商证券	3,940	53,465.80	0.23
103	600346	恒力石化	3,700	53,021.00	0.23
104	600989	宝丰能源	4,200	52,962.00	0.23
105	601100	恒立液压	816	52,493.28	0.23
106	601669	中国电建	9,100	52,234.00	0.23

107	600585	海螺水泥	2,200	52,228.00	0.23
108	002027	分众传媒	7,600	51,756.00	0.22
109	001979	招商蛇口	3,900	50,817.00	0.22
110	601169	北京银行	10,900	50,467.00	0.22
111	603993	洛阳钼业	9,400	50,102.00	0.22
112	002460	赣锋锂业	820	49,987.20	0.22
113	601628	中国人寿	1,400	48,944.00	0.21
114	002812	恩捷股份	500	48,175.00	0.21
115	600886	国投电力	3,800	48,070.00	0.21
116	002709	天赐材料	1,140	46,956.60	0.20
117	300782	卓胜微	484	46,768.92	0.20
118	688390	固德威	280	46,720.80	0.20
119	000895	双汇发展	1,900	46,531.00	0.20
120	600132	重庆啤酒	500	46,080.00	0.20
121	688008	澜起科技	800	45,936.00	0.20
122	000538	云南白药	875	45,920.00	0.20
123	000776	广发证券	3,100	45,601.00	0.20
124	601009	南京银行	5,700	45,600.00	0.20
125	600111	北方稀土	1,900	45,562.00	0.20
126	300751	迈为股份	268	45,393.84	0.20
127	600837	海通证券	4,900	45,178.00	0.20
128	600188	兖矿能源	1,500	44,880.00	0.20
129	000338	潍柴动力	3,600	44,856.00	0.19
130	600703	三安光电	2,600	44,824.00	0.19
131	600089	特变电工	2,000	44,580.00	0.19
132	603799	华友钴业	970	44,532.70	0.19
133	300223	北京君正	500	44,155.00	0.19
134	600570	恒生电子	991	43,891.39	0.19
135	600010	宝钢股份	24,400	43,676.00	0.19
136	688536	思瑞浦	200	43,600.00	0.19
137	000963	华东医药	1,000	43,370.00	0.19
138	603392	万泰生物	647	43,200.19	0.19
139	603290	斯达半导	200	43,040.00	0.19
140	600845	宝信软件	846	42,985.26	0.19
141	601360	三六零	3,411	42,773.94	0.19
142	600547	山东黄金	1,820	42,733.60	0.19
143	000425	徐工机械	6,300	42,651.00	0.19
144	688599	天合光能	1,000	42,610.00	0.19
145	601229	上海银行	7,400	42,550.00	0.18
146	688223	晶科能源	3,000	42,180.00	0.18
147	002311	海大集团	900	42,156.00	0.18
148	688396	华润微	800	41,928.00	0.18
149	600600	青岛啤酒	400	41,452.00	0.18

150	000301	东方盛虹	3,500	41,370.00	0.18
151	002049	紫光国微	440	41,030.00	0.18
152	000661	长春高新	300	40,890.00	0.18
153	601336	新华保险	1,100	40,447.00	0.18
154	601689	拓普集团	500	40,350.00	0.18
155	600085	同仁堂	700	40,292.00	0.18
156	601633	长城汽车	1,600	40,272.00	0.17
157	688063	派能科技	200	39,650.00	0.17
158	600660	福耀玻璃	1,100	39,435.00	0.17
159	601868	中国能建	16,800	39,312.00	0.17
160	601995	中金公司	1,100	39,072.00	0.17
161	600011	华能国际	4,200	38,892.00	0.17
162	600926	杭州银行	3,300	38,775.00	0.17
163	002555	三七互娱	1,100	38,368.00	0.17
164	000733	振华科技	400	38,340.00	0.17
165	600958	东方证券	3,944	38,256.80	0.17
166	000938	紫光股份	1,200	38,220.00	0.17
167	600588	用友网络	1,860	38,130.00	0.17
168	688188	柏楚电子	200	37,712.00	0.16
169	688516	奥特维	200	37,680.00	0.16
170	688256	寒武纪	200	37,600.00	0.16
171	300769	德方纳米	340	37,478.20	0.16
172	600015	华夏银行	6,907	37,366.87	0.16
173	600196	复星医药	1,200	37,080.00	0.16
174	603369	今世缘	700	36,960.00	0.16
175	600029	南方航空	6,100	36,783.00	0.16
175	601600	中国铝业	6,700	36,783.00	0.16
176	002409	雅克科技	500	36,440.00	0.16
177	601916	浙商银行	13,800	36,432.00	0.16
178	600674	川投能源	2,400	36,120.00	0.16
179	000100	TCL 科技	9,140	36,011.60	0.16
180	601618	中国中冶	9,000	35,730.00	0.16
181	600039	四川路桥	3,640	35,708.40	0.16
182	002236	大华股份	1,800	35,550.00	0.15
183	601865	福莱特	900	34,659.00	0.15
184	601111	中国国航	4,200	34,608.00	0.15
185	600745	闻泰科技	700	34,230.00	0.15
186	300413	芒果超媒	1,000	34,210.00	0.15
187	300454	深信服	300	33,975.00	0.15
188	000977	浪潮信息	700	33,950.00	0.15
189	300999	金龙鱼	833	33,311.67	0.14
190	601877	正泰电器	1,200	33,180.00	0.14
191	601127	赛力斯	900	33,093.00	0.14

192	600795	国电电力	8,600	32,938.00	0.14
193	600426	华鲁恒升	1,070	32,774.10	0.14
194	688303	大全能源	800	32,360.00	0.14
195	603737	三棵树	492	32,186.64	0.14
196	002241	歌尔股份	1,800	31,950.00	0.14
197	600522	中天科技	2,000	31,820.00	0.14
198	600009	上海机场	700	31,794.00	0.14
199	601788	光大证券	2,000	31,780.00	0.14
200	600741	华域汽车	1,700	31,382.00	0.14
201	601607	上海医药	1,400	31,374.00	0.14
202	601939	建设银行	5,000	31,300.00	0.14
203	603486	科沃斯	400	31,108.00	0.14
204	600176	中国巨石	2,188	30,982.08	0.13
205	300433	蓝思科技	2,600	30,576.00	0.13
206	002738	中矿资源	600	30,564.00	0.13
207	600221	海航控股	19,300	30,494.00	0.13
208	000876	新希望	2,600	30,368.00	0.13
209	000999	华润三九	500	30,330.00	0.13
210	002916	深南电路	400	30,148.00	0.13
211	002821	凯莱英	255	30,054.30	0.13
212	605117	德业股份	200	29,910.00	0.13
213	002736	国信证券	3,400	29,682.00	0.13
214	600779	水井坊	500	29,495.00	0.13
215	600872	中炬高新	800	29,432.00	0.13
216	603345	安井食品	200	29,360.00	0.13
217	300661	圣邦股份	357	29,320.41	0.13
218	002648	卫星化学	1,945	29,097.20	0.13
219	600115	中国东航	6,100	29,036.00	0.13
220	300496	中科创达	300	28,905.00	0.13
221	601021	春秋航空	500	28,735.00	0.12
222	601319	中国人保	4,900	28,616.00	0.12
223	000983	山西焦煤	3,120	28,392.00	0.12
224	300408	三环集团	965	28,322.75	0.12
225	301236	软通动力	1,036	28,189.56	0.12
226	002756	永兴材料	450	28,174.50	0.12
227	603260	合盛硅业	400	28,008.00	0.12
228	600875	东方电气	1,500	27,975.00	0.12
229	601825	沪农商行	5,100	27,795.00	0.12
230	002001	新和成	1,800	27,720.00	0.12
231	600233	圆通速递	1,900	27,664.00	0.12
232	002074	国轩高科	1,000	27,620.00	0.12
233	601377	兴业证券	4,510	27,601.20	0.12
234	600563	法拉电子	200	27,460.00	0.12

235	600256	广汇能源	4,000	27,440.00	0.12
236	601727	上海电气	6,000	27,420.00	0.12
237	002180	纳思达	800	27,400.00	0.12
238	600023	浙能电力	5,400	27,378.00	0.12
239	002050	三花智控	900	27,234.00	0.12
240	600803	新奥股份	1,432	27,179.36	0.12
241	688126	沪硅产业	1,300	27,170.00	0.12
242	601238	广汽集团	2,600	27,092.00	0.12
243	002841	视源股份	403	26,936.52	0.12
244	002602	世纪华通	3,540	26,868.60	0.12
245	688363	华熙生物	300	26,748.00	0.12
246	601881	中国银河	2,300	26,703.00	0.12
247	300957	贝泰妮	300	26,664.00	0.12
248	601117	中国化学	3,200	26,496.00	0.12
249	002850	科达利	200	26,450.00	0.11
250	600918	中泰证券	3,800	26,258.00	0.11
251	601699	潞安环能	1,600	26,112.00	0.11
252	300763	锦浪科技	250	26,025.00	0.11
253	300628	亿联网络	740	25,951.80	0.11
254	688561	奇安信	500	25,905.00	0.11
255	600732	爱旭股份	840	25,830.00	0.11
256	600489	中金黄金	2,500	25,825.00	0.11
257	600536	中国软件	550	25,784.00	0.11
258	603338	浙江鼎力	460	25,764.60	0.11
259	603198	迎驾贡酒	400	25,520.00	0.11
260	688099	晶晨股份	300	25,296.00	0.11
261	603939	益丰药房	682	25,234.00	0.11
262	688385	复旦微电	500	25,050.00	0.11
263	300487	蓝晓科技	400	24,968.00	0.11
264	600584	长电科技	800	24,936.00	0.11
265	300037	新宙邦	480	24,907.20	0.11
266	601872	招商轮船	4,300	24,897.00	0.11
267	002600	领益智造	3,600	24,876.00	0.11
268	600702	舍得酒业	200	24,790.00	0.11
269	002252	上海莱士	3,300	24,783.00	0.11
270	600027	华电国际	3,700	24,753.00	0.11
271	601799	星宇股份	200	24,720.00	0.11
272	601838	成都银行	2,000	24,420.00	0.11
273	000157	中联重科	3,600	24,300.00	0.11
274	002938	鹏鼎控股	1,000	24,290.00	0.11
275	600460	士兰微	800	24,216.00	0.11
276	000807	云铝股份	1,900	24,187.00	0.11
277	300418	昆仑万维	600	24,168.00	0.11

278	300919	中伟股份	400	24,100.00	0.10
279	600026	中远海能	1,900	24,016.00	0.10
280	600415	小商品城	2,800	23,884.00	0.10
281	603596	伯特利	300	23,778.00	0.10
282	002422	科伦药业	800	23,744.00	0.10
283	300832	新产业	400	23,600.00	0.10
284	600061	国投资本	3,300	23,496.00	0.10
285	688122	西部超导	420	23,406.60	0.10
286	002384	东山精密	900	23,310.00	0.10
287	002601	龙佰集团	1,400	23,100.00	0.10
288	601901	方正证券	3,500	22,890.00	0.10
289	603688	石英股份	200	22,768.00	0.10
290	603613	国联股份	616	22,748.88	0.10
291	603882	金城医学	300	22,650.00	0.10
292	002603	以岭药业	880	22,607.20	0.10
293	300724	捷佳伟创	200	22,470.00	0.10
294	603185	弘元绿能	300	22,365.00	0.10
295	603899	晨光股份	500	22,320.00	0.10
296	600332	白云山	700	22,316.00	0.10
297	000066	中国长城	1,600	22,128.00	0.10
298	000786	北新建材	900	22,059.00	0.10
299	601615	明阳智能	1,300	21,944.00	0.10
300	600161	天坛生物	800	21,720.00	0.09
301	600079	人福医药	800	21,552.00	0.09
302	000423	东阿阿胶	400	21,380.00	0.09
303	600754	锦江酒店	500	21,170.00	0.09
304	300142	沃森生物	800	21,160.00	0.09
305	002568	百润股份	580	21,083.00	0.09
306	688187	时代电气	500	20,930.00	0.09
307	600362	江西铜业	1,100	20,878.00	0.09
308	603658	安图生物	400	20,692.00	0.09
309	600160	巨化股份	1,500	20,670.00	0.09
310	300003	乐普医疗	900	20,349.00	0.09
311	002156	通富微电	900	20,340.00	0.09
312	600515	海南机场	5,000	20,300.00	0.09
313	002202	金风科技	1,900	20,178.00	0.09
314	002007	华兰生物	900	20,169.00	0.09
315	300073	当升科技	400	20,132.00	0.09
316	002032	苏泊尔	400	20,000.00	0.09
317	601878	浙商证券	2,000	19,760.00	0.09
318	603589	口子窖	400	19,740.00	0.09
319	600884	杉杉股份	1,300	19,682.00	0.09
320	300395	菲利华	400	19,680.00	0.09

321	603606	东方电缆	400	19,612.00	0.09
322	600763	通策医疗	200	19,372.00	0.08
323	300347	泰格医药	300	19,362.00	0.08
324	002340	格林美	2,800	19,348.00	0.08
325	688180	君实生物	500	19,270.00	0.08
326	603233	大参林	685	19,186.85	0.08
327	300146	汤臣倍健	800	19,184.00	0.08
328	600487	亨通光电	1,300	19,058.00	0.08
329	000988	华工科技	500	19,005.00	0.08
330	300604	长川科技	400	18,996.00	0.08
331	600018	上港集团	3,600	18,900.00	0.08
332	002463	沪电股份	900	18,846.00	0.08
333	600219	南山铝业	6,200	18,724.00	0.08
334	002294	信立泰	600	18,714.00	0.08
335	000729	燕京啤酒	1,500	18,705.00	0.08
336	002028	思源电气	400	18,688.00	0.08
337	002064	华峰化学	2,700	18,522.00	0.08
338	603885	吉祥航空	1,200	18,516.00	0.08
339	600298	安琪酵母	511	18,503.31	0.08
340	000069	华侨城 A	4,200	18,480.00	0.08
341	002080	中材科技	900	18,468.00	0.08
342	002414	高德红外	2,359	18,329.43	0.08
343	002625	光启技术	1,200	18,312.00	0.08
344	688777	中控技术	290	18,206.20	0.08
345	000723	美锦能源	2,400	18,096.00	0.08
346	000408	藏格矿业	800	18,056.00	0.08
347	601216	君正集团	4,400	18,040.00	0.08
348	000799	酒鬼酒	200	18,030.00	0.08
349	300676	华大基因	300	17,997.00	0.08
350	002223	鱼跃医疗	500	17,995.00	0.08
351	000738	航发控制	733	17,885.20	0.08
352	601958	金钼股份	1,600	17,840.00	0.08
353	601966	玲珑轮胎	800	17,776.00	0.08
354	600705	中航产融	4,600	17,618.00	0.08
355	601108	财通证券	2,430	17,593.20	0.08
356	600486	扬农化工	200	17,484.00	0.08
357	600383	金地集团	2,400	17,304.00	0.08
358	603156	养元饮品	700	17,290.00	0.08
359	601555	东吴证券	2,490	17,280.60	0.08
360	300759	康龙化成	450	17,226.00	0.07
361	601233	桐昆股份	1,300	17,225.00	0.07
362	600004	白云机场	1,200	17,208.00	0.07
363	000629	钒钛股份	4,400	17,204.00	0.07

364	300390	天华新能	480	17,184.00	0.07
365	002430	杭氧股份	500	17,180.00	0.07
366	000932	华菱钢铁	3,600	17,172.00	0.07
367	601058	赛轮轮胎	1,500	17,085.00	0.07
368	002939	长城证券	2,100	17,073.00	0.07
369	600183	生益科技	1,200	17,040.00	0.07
370	601155	新城控股	1,171	16,874.11	0.07
371	000783	长江证券	2,900	16,820.00	0.07
371	688009	中国通号	2,900	16,820.00	0.07
372	600642	申能股份	2,400	16,776.00	0.07
373	601077	渝农商行	4,600	16,514.00	0.07
374	600606	绿地控股	6,000	16,500.00	0.07
375	600109	国金证券	1,900	16,473.00	0.07
376	600157	永泰能源	11,600	16,472.00	0.07
377	000032	深桑达 A	500	16,450.00	0.07
378	002372	伟星新材	800	16,432.00	0.07
379	002056	横店东磁	900	16,389.00	0.07
380	600153	建发股份	1,500	16,365.00	0.07
381	300207	欣旺达	1,000	16,320.00	0.07
382	300595	欧普康视	540	16,302.60	0.07
383	601577	长沙银行	2,100	16,296.00	0.07
384	300373	扬杰科技	400	16,228.00	0.07
385	688005	容百科技	300	16,206.00	0.07
386	600985	淮北矿业	1,400	16,128.00	0.07
387	603529	爱玛科技	500	16,110.00	0.07
388	002624	完美世界	950	16,045.50	0.07
389	002078	太阳纸业	1,500	16,035.00	0.07
390	002518	科士达	400	16,004.00	0.07
391	000021	深科技	800	15,992.00	0.07
392	002240	盛新锂能	500	15,935.00	0.07
393	600038	中直股份	400	15,928.00	0.07
394	600546	山煤国际	1,100	15,917.00	0.07
395	000975	银泰黄金	1,360	15,912.00	0.07
396	000630	铜陵有色	5,500	15,895.00	0.07
396	600352	浙江龙盛	1,700	15,895.00	0.07
397	002128	电投能源	1,200	15,864.00	0.07
398	600348	华阳股份	2,000	15,820.00	0.07
399	300144	宋城演艺	1,261	15,636.40	0.07
400	000933	神火股份	1,200	15,600.00	0.07
400	601880	辽港股份	10,000	15,600.00	0.07
401	000513	丽珠集团	400	15,564.00	0.07
402	601990	南京证券	1,900	15,542.00	0.07
403	600511	国药股份	400	15,540.00	0.07

404	002153	石基信息	1,102	15,428.00	0.07
405	300118	东方日升	600	15,378.00	0.07
405	600481	双良节能	1,100	15,378.00	0.07
406	600970	中材国际	1,200	15,300.00	0.07
407	600848	上海临港	1,280	15,296.00	0.07
408	000027	深圳能源	2,320	15,288.80	0.07
409	603816	顾家家居	400	15,260.00	0.07
410	000728	国元证券	2,340	15,256.80	0.07
411	002673	西部证券	2,400	15,240.00	0.07
412	002531	天顺风能	1,000	15,230.00	0.07
413	600549	厦门钨业	800	15,224.00	0.07
414	002385	大北农	2,300	15,180.00	0.07
415	002353	杰瑞股份	600	15,078.00	0.07
415	688220	翱捷科技	200	15,078.00	0.07
416	603568	伟明环保	860	15,058.60	0.07
417	600378	昊华科技	400	15,056.00	0.07
418	002405	四维图新	1,300	15,054.00	0.07
419	002739	万达电影	1,200	15,048.00	0.07
420	600177	雅戈尔	2,380	15,017.80	0.07
421	002044	美年健康	2,100	14,931.00	0.06
422	601696	中银证券	1,400	14,924.00	0.06
423	002120	韵达股份	1,560	14,913.60	0.06
424	300601	康泰生物	586	14,878.54	0.06
425	603517	绝味食品	400	14,860.00	0.06
426	000831	中国稀土	500	14,800.00	0.06
427	002185	华天科技	1,600	14,720.00	0.06
428	601933	永辉超市	4,700	14,711.00	0.06
429	605358	立昂微	400	14,692.00	0.06
430	603893	瑞芯微	200	14,570.00	0.06
431	600566	济川药业	500	14,520.00	0.06
432	000009	中国宝安	1,200	14,484.00	0.06
433	000519	中兵红箭	800	14,472.00	0.06
434	300438	鹏辉能源	300	14,412.00	0.06
435	300558	贝达药业	300	14,409.00	0.06
436	688521	芯原股份	200	14,384.00	0.06
437	002532	天山铝业	2,400	14,376.00	0.06
438	002558	巨人网络	800	14,344.00	0.06
439	000800	一汽解放	1,700	14,229.00	0.06
440	300699	光威复材	460	14,191.00	0.06
441	002244	滨江集团	1,600	14,112.00	0.06
442	002152	广电运通	1,200	14,064.00	0.06
443	600021	上海电力	1,300	14,001.00	0.06
444	002268	电科网安	500	13,935.00	0.06

445	600998	九州通	1,341	13,919.58	0.06
446	000987	越秀资本	2,188	13,893.80	0.06
447	600521	华海药业	750	13,807.50	0.06
448	600655	豫园股份	2,000	13,720.00	0.06
449	603456	九洲药业	500	13,690.00	0.06
450	601168	西部矿业	1,300	13,663.00	0.06
451	000683	远兴能源	1,900	13,661.00	0.06
452	600096	云天化	800	13,656.00	0.06
453	601198	东兴证券	1,700	13,634.00	0.06
454	002607	中公教育	2,900	13,630.00	0.06
455	000591	太阳能	2,000	13,560.00	0.06
456	002541	鸿路钢构	470	13,540.70	0.06
457	601231	环旭电子	900	13,464.00	0.06
458	300357	我武生物	400	13,452.00	0.06
459	688002	睿创微纳	300	13,440.00	0.06
460	002299	圣农发展	700	13,405.00	0.06
461	600885	宏发股份	420	13,377.00	0.06
462	002192	融捷股份	200	13,366.00	0.06
463	600704	物产中大	2,700	13,338.00	0.06
464	600141	兴发集团	600	13,332.00	0.06
465	000739	普洛药业	750	13,305.00	0.06
466	300212	易华录	400	13,292.00	0.06
467	601991	大唐发电	4,000	13,240.00	0.06
468	000155	川能动力	900	12,960.00	0.06
469	002791	坚朗五金	200	12,942.00	0.06
470	600583	海油工程	2,200	12,870.00	0.06
471	000703	恒逸石化	1,880	12,746.40	0.06
472	600380	健康元	1,000	12,710.00	0.06
473	688728	格科微	800	12,656.00	0.05
474	002508	老板电器	500	12,645.00	0.05
475	601866	中远海发	5,100	12,597.00	0.05
476	002797	第一创业	2,200	12,584.00	0.05
477	600499	科达制造	1,100	12,496.00	0.05
478	601016	节能风电	3,400	12,478.00	0.05
479	002507	涪陵榨菜	680	12,450.80	0.05
480	002966	苏州银行	1,900	12,445.00	0.05
481	000960	锡业股份	800	12,440.00	0.05
482	600369	西南证券	3,400	12,410.00	0.05
483	002465	海格通信	1,200	12,408.00	0.05
484	603858	步长制药	600	12,354.00	0.05
485	600699	均胜电子	700	12,348.00	0.05
486	002487	大金重工	400	12,336.00	0.05
487	600516	方大炭素	1,980	12,276.00	0.05

488	600673	东阳光	1,700	12,257.00	0.05
489	600559	老白干酒	500	12,255.00	0.05
490	000709	河钢股份	5,400	12,204.00	0.05
491	002831	裕同科技	500	12,195.00	0.05
492	603077	和邦生物	5,000	12,150.00	0.05
493	300251	光线传媒	1,500	12,135.00	0.05
494	600688	上海石化	3,900	12,129.00	0.05
495	000937	冀中能源	1,900	12,122.00	0.05
496	600988	赤峰黄金	900	12,114.00	0.05
497	600170	上海建工	4,500	12,105.00	0.05
498	603712	七一二	400	12,084.00	0.05
499	601636	旗滨集团	1,400	12,068.00	0.05
500	600598	北大荒	900	11,997.00	0.05
501	002266	浙富控股	2,900	11,977.00	0.05
502	600056	中国医药	920	11,941.60	0.05
503	000050	深天马 A	1,300	11,934.00	0.05
504	300568	星源材质	694	11,929.86	0.05
505	002145	中核钛白	2,020	11,897.80	0.05
506	300363	博腾股份	400	11,836.00	0.05
507	601456	国联证券	1,300	11,830.00	0.05
508	600873	梅花生物	1,300	11,609.00	0.05
509	600392	盛和资源	900	11,583.00	0.05
510	002407	多氟多	580	11,518.80	0.05
511	000893	亚钾国际	500	11,470.00	0.05
512	603218	日月股份	600	11,394.00	0.05
513	600258	首旅酒店	600	11,370.00	0.05
514	601666	平煤股份	1,500	11,310.00	0.05
515	002065	东华软件	1,600	11,296.00	0.05
516	000825	太钢不锈	2,900	11,223.00	0.05
517	603707	健友股份	805	10,867.50	0.05
518	002926	华西证券	1,300	10,803.00	0.05
519	603127	昭衍新药	264	10,797.60	0.05
520	000998	隆平高科	700	10,745.00	0.05
521	002176	江特电机	900	10,728.00	0.05
522	002497	雅化集团	600	10,668.00	0.05
523	000830	鲁西化工	1,000	10,560.00	0.05
524	002408	齐翔腾达	1,600	10,192.00	0.04
525	688779	长远锂科	900	10,143.00	0.04
526	600801	华新水泥	800	9,880.00	0.04
527	002500	山西证券	1,770	9,876.60	0.04
528	601992	金隅集团	4,400	9,592.00	0.04
529	000401	冀东水泥	1,300	9,581.00	0.04
530	002138	顺络电子	400	9,564.00	0.04

531	300529	健帆生物	400	9,272.00	0.04
532	600338	西藏珠峰	500	9,130.00	0.04
533	002092	中泰化学	1,400	9,030.00	0.04
534	603866	桃李面包	811	8,207.32	0.04
535	002030	达安基因	752	7,497.44	0.03

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	939,820.00	1.19
2	000858	五粮液	505,293.00	0.64
3	002594	比亚迪	433,318.00	0.55
4	000568	泸州老窖	424,611.00	0.54
5	002371	北方华创	390,654.00	0.49
6	002304	洋河股份	222,792.00	0.28
7	600436	片仔癀	214,145.00	0.27
8	300760	迈瑞医疗	213,314.00	0.27
9	300782	卓胜微	200,592.00	0.25
10	300033	同花顺	200,326.00	0.25
11	300059	东方财富	200,140.00	0.25
12	300274	阳光电源	200,085.00	0.25
13	002714	牧原股份	198,434.00	0.25
14	000001	平安银行	175,961.00	0.22
15	002352	顺丰控股	175,325.00	0.22
16	002920	德赛西威	161,369.00	0.20
17	300122	智飞生物	160,568.00	0.20
18	300015	爱尔眼科	159,764.40	0.20
19	002475	立讯精密	147,745.00	0.19
20	002466	天齐锂业	143,160.00	0.18

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,426,346.40	3.06
2	000858	五粮液	1,627,966.00	2.05
3	002594	比亚迪	1,114,570.00	1.41
4	000568	泸州老窖	897,184.00	1.13

5	300760	迈瑞医疗	786,658.00	0.99
6	002304	洋河股份	620,050.00	0.78
7	300059	东方财富	587,720.00	0.74
8	002352	顺丰控股	572,491.00	0.72
9	000001	平安银行	570,334.00	0.72
10	002714	牧原股份	566,314.00	0.71
11	002371	北方华创	559,733.00	0.71
12	300015	爱尔眼科	466,406.00	0.59
13	002475	立讯精密	459,867.00	0.58
14	300274	阳光电源	438,688.00	0.55
15	603986	兆易创新	437,926.00	0.55
16	002142	宁波银行	437,746.00	0.55
17	601816	京沪高铁	377,468.00	0.48
18	603833	欧派家居	373,703.00	0.47
19	300124	汇川技术	367,806.00	0.46
20	300122	智飞生物	366,501.00	0.46

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	19,036,404.00
卖出股票收入（成交）总额	42,689,953.16

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

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	21,517.01
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	21,517.01

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：本基金本报告期末指数投资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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

§ 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 (%)
199	89,372.64	9,818,555.00	55.21	7,966,600.00	44.79

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易 型开放式指数证券投资基金 联接基金	5,591,900.00	31.44

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	中信证券股份有限公司	2,127,539.00	11.96
2	周建华	1,857,800.00	10.45
3	广发证券股份有限公司	1,780,921.00	10.01
4	孟京	1,502,800.00	8.45
5	孙奇峰	521,100.00	2.93
6	沈晨波	330,000.00	1.86
7	华泰证券股份有限公司	318,145.00	1.79
8	孙民军	300,000.00	1.69
9	项玉燕	283,300.00	1.59
10	王琳	209,300.00	1.18

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

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年4月30日） 基金份额总额	554,785,155.00
本报告期期初基金份额总额	59,785,155.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	63,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,785,155.00

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

2023年6月13日至2023年7月12日，基金管理人以通讯方式召开了基金份额持有人大会，并于2023年7月13日表决通过了《关于持续运作浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金的议案》，本次大会决议自该日起生效。详见本基金管理人于2023年6月7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。

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，本基金管理人重大人事变动如下：

2023年4月4日，本基金管理人发布了《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》，经本基金管理人董事会审议通过，聘任顾佳女士担任本基金管理人副总经理兼财务负责人，聘任蒋佳良先生担任本基金管理人总经理助理兼首席权益投资官。

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：

2023年8月12日，本基金管理人发布了《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》，经本基金管理人董事会审议通过，邓列军先生不再担任本基金管理人副总经理兼首席信息官。

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本基金本报告期内无托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
华泰证券	2	50,595,071.87	81.97	37,000.60	78.11	-
天风证券	1	11,131,285.29	18.03	10,366.79	21.89	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准

财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；

具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为基金提供研究服务支持；

佣金费率合理；

本基金管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序

本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；

基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增开源证券交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	规定网站	2023 年 1 月 20 日
2	浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站	2023 年 3 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 2023 年第 1 季度报告	规定网站	2023 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	2023 年 4 月 28 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) 2023 年第 1 号	规定网站	2023 年 4 月 28 日
6	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公告	报刊及规定网站	2023 年 6 月 7 日

7	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	2023 年 6 月 8 日
8	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	2023 年 6 月 9 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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	20230614	322,600.00	16,860,721.00	15,402,400.00	1,780,921.00	10.01
	2	20230302	10,004,434.00	27,400,000.00	37,086,289.00	318,145.00	1.79
	3	20230101-20230111, 20230119-20230207, 20230213-20230228, 20230302-20230613, 20230615-20230630	13,010,100.00	8,738,000.00	16,156,200.00	5,591,900.00	31.44
	4	20230101-20230301	12,787,700.00	0.00	12,787,700.00	0.00	0.00

产品特有风险

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。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金合同

- 3、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照、公司章程
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、本报告期内在中国证监会规定媒介上披露的各项公告
- 8、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日