

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券 投资基金联接基金清算报告

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

清算报告出具日：2025 年 3 月 17 日

清算报告公告日：2025 年 4 月 3 日

§ 1 重要提示

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(以下简称“本基金”),系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[2020]210 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联接基金注册的批复》准予注册,于 2020 年 9 月 23 日成立并正式运作。

为顺应市场环境变化,保护基金份额持有人的利益,根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《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合同》(以下简称“基金合同”)的有关约定,本基金管理人经与本基金托管人中国银行股份有限公司协商一致,提议终止《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合同》,并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据基金管理人 2025 年 2 月 18 日公告的《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联接基金(二次召开)基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》(以下简称“《决议生效公告》”),本次基金份额持有人大会于 2025 年 2 月 17 日表决通过了《关于终止浦银安盛 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合同有关事项的议案》,本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》,本基金最后运作日为 2025 年 2 月 18 日,自 2025 年 2 月 19 日进入清算期。

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、毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)和国浩律师(上海)事务所于 2025 年 2 月 19 日组成基金财产清算小组履行基金财产清算程序,并由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)对清算报告进行审计,国浩律师(上海)事务所对清算报告出具法律意见。

§ 2 基金产品概况

基金简称	浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF 联接
基金主代码	009374
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 23 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（2025 年 2 月 18 日） 基金份额总额	4,877,542.83 份	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF 联接 A	浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	009374	009375
报告期末（2025 年 2 月 18 日） 下属分级基金的份额总额	2,907,691.61 份	1,969,851.22 份
投资目标	本基金主要通过投资于目标 ETF，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	<p>本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。</p> <p>在正常市场情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p>	
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	<p>本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征。</p> <p>本基金为被动式投资的股票型基金，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。</p>	

§ 3 基金运作情况概述

本基金经中国证券监督管理委员会证监许可[2020]210号准予注册，由基金管理人浦银安盛基金管理有限公司依照法律法规、《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合同》等规定于 2020 年 7 月 20 日至 2020 年 9 月 18 日向社会公开发行募集，基金合同于 2020 年 9 月 23 日生效。基金合同生效日的基金总份额为 219,712,331.86 份基金份额。

自本基金基金合同生效日至最后运作日期间，本基金正常运作。

为顺应市场环境变化，保护基金份额持有人的利益，基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规的规定和《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合同》的有关约定，经与本基金托管人协商一致，提议终止《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合同》，并召开基金份额持有人大会审议上述事项。根据基金管理人 2025 年 2 月 18 日公告的《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联接基金（二次召开）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本次基金份额持有人大会于 2025 年 2 月 17 日表决通过了《关于终止浦银安盛 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合同有关事项的议案》，本次基金份额持有人大会决议自该日起生效。根据《决议生效公告》，本基金最后运作日为 2025 年 2 月 18 日，自 2025 年 2 月 19 日进入清算期。

§ 4 财务报告

4.1 资产负债表（经审计）

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联接基金

报告截止日：2025 年 2 月 18 日

单位：人民币元

资 产	最后运作日 2025 年 2 月 18 日
资 产：	
货币资金	257,766.03

结算备付金	316.83
存出保证金	2,063.60
交易性金融资产	-
应收清算款	3,944,252.21
应收申购款	6,191.47
资产总计	4,210,590.14
负债和净资产	最后运作日 2025年2月18日
负 债:	
应付清算款	-
应付赎回款	7,785.62
应付管理人报酬	34.47
应付托管费	11.49
应付销售服务费	260.27
应交税费	33.24
其他负债	27,914.37
负债合计	36,039.46
净资产:	
实收基金	4,877,542.83
未分配利润	-702,992.15
净资产合计	4,174,550.68
负债和净资产总计	4,210,590.14

注:1、本清算报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《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联接基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作以清算基础编制。于基金最后运作日,所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量。由于报告性质所致,本清算报表并无比较期间的相关数据列示。

2、报告截止 2025 年 2 月 18 日（最后运作日），浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF 联接 A 份额净值 0.8606 元，基金份额总额 2,907,691.61 份，浦银安盛 MSCI 中国 A 股 ETF 联接 C 份额净值 0.8488 元，基金份额总额 1,969,851.22 份，总份额合计 4,877,542.83 份。

3、本财务报告已经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计，注册会计师叶凯韵、欧梦激签字出具了毕马威华振审字第 2500822 号标准无保留意见的审计报告。

§ 5 清算情况

自 2025 年 2 月 19 日至 2025 年 3 月 17 日止清算期间，基金财产清算小组对本基金的资产、负债进行清算，全部清算工作按清算原则和清算手续进行。具体清算情况如下：

5.1 资产处置情况

5.1.1 本基金最后运作日银行存款余额为人民币 257,766.03 元，其中活期存款人民币 257,611.40 元，应计活期存款利息人民币 154.63 元。于清算结束日银行存款余额为人民币 3,823,626.24 元，其中活期存款人民币 3,822,464.66 元，应计活期存款利息人民币 1,161.58 元。

5.1.2 本基金最后运作日结算备付金余额为人民币 316.83 元，其中存放在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司的最低备付金金额为人民币 316.83 元，无应计结算备付金利息，上述结算备付金清算期间调整入银行托管户人民币 316.83 元，未计提结算备付金利息，于清算结束日结算备付金余额为人民币 0.00 元。

5.1.3 本基金最后运作日存出保证金余额为人民币 2,063.60 元，其中存出保证金人民币 2,061.41 元，应计存出保证金利息人民币 2.19 元，上述存出保证金清算期间调整入银行托管户人民币 2,061.41 元，计提存出保证金利息收入人民币 0.26 元，于清算结束日存出保证金余额为人民币 2.45 元，均为应计存出保证金利息。

5.1.4 本基金最后运作日应收清算款余额为人民币 3,944,252.21 元，于清算期间确认应收清算款人民币 133,374.58 元，收回清算款人民币 4,077,626.79 元，于清算结束日应收清算款余额为人民币 0.00 元。

5.1.5 本基金最后运作日应收申购款余额为人民币 6,191.47 元，于清算期间确认应收申购款人民币 309.88 元，收回申购款人民币 6,501.35 元，于清算结束日应收申购款余额为人民币 0.00 元。

5.2 负债清偿情况

5.2.1 本基金最后运作日应付赎回款余额为人民币 7,785.62 元,于清算期间确认应付赎回款人民币 390,635.55 元,支付赎回款人民币 398,421.17 元,于清算结束日应付赎回款余额为人民币 0.00 元。

5.2.2 本基金最后运作日应付管理人报酬余额为人民币 34.47 元,于清算结束日应付管理人报酬余额为人民币 0.00 元。

5.2.3 本基金最后运作日应付托管费余额为人民币 11.49 元,于清算结束日应付托管费余额为人民币 0.00 元。

5.2.4 本基金最后运作日应付销售服务费余额为人民币 260.27 元,于清算结束日应付销售服务费余额为人民币 0.00 元。

5.2.5 本基金最后运作日应交税费余额为人民币 33.24 元,于清算结束日应交税费余额为人民币 0.00 元。

5.2.6 本基金最后运作日其他负债余额为人民币 27,914.37 元,包括应付交易费用人民币 504.37 元,预提审计费人民币 12,000.00 元,预提律师费人民币 15,000.00 元,预提银行汇款费人民币 410.00 元,于清算期间支付交易费用人民币 504.37 元,支付银行汇划费人民币 50.00 元,于清算结束日其他负债余额为人民币 27,360.00 元。

5.3 清算期间的清算损益情况

单位：人民币元

项目	自 2025 年 2 月 19 日至 2025 年 3 月 17 日止清算期间
一、收入	12,534.41
1、利息收入	1,007.21
2、投资收益（损失以“-”填列）	11,527.20
3、公允价值变动损益（损失以“-”填列）	-
二、费用	41.51
1、税金	41.51
三、清算期间净收益（损失以“-”填列）	12,492.90

5.4 资产处置及负债清偿后的剩余资产分配情况

单位：人民币元

项目	金额
一、最后运作日 2025 年 2 月 18 日基金净资产	4,174,550.68
加：清算期间净收益	12,492.90
减：清算期间净赎回	390,774.89
二、2025 年 3 月 17 日基金净资产	3,796,268.69

根据本基金的基金合同及《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联接基金（二次召开）基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》的约定，将基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳基金所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。自本次清算期结束日次日至基金财产返还投资人前一日利息归基金份额持有人所有，后续产生的各类划付手续费由基金份额持有人承担。

5.5 基金财产清算报告的告知安排

本清算报告已经基金托管人复核，在经会计师事务所审计、律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并向基金份额持有人公告。清算报告公告后，基金管理人将遵照法律法规的规定以及基金合同的约定及时分配。

§ 6 备查文件目录

6.1 备查文件目录

1、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清算财务报表及审计报告

2、国浩律师（上海）事务所关于浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金清算事宜之法律意见书

6.2 存放地点

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

6.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

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

基金财产清算小组

清算报告出具日：2025 年 3 月 17 日

清算报告公告日：2025 年 4 月 3 日