

浦银安盛 MSCI 中国 A 股交易型开放式指数  
证券投资基金  
2022 年中期报告

2022 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：2022 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 2022 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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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	15
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	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>47</b>
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63

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.....	63
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.....	63
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.....	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	63
7.12 投资组合报告附注.....	63
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>64</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	64
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	65
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.....	66
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>66</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	66
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.....	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	66
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
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.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	67
10.8 其他重大事件.....	68
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>68</b>
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 .....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

## § 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	143,785,155.00 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前提下，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	上海市淮海中路 381 号中环广场	北京西城区复兴门内大街 1 号

	38 楼	
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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-12,705,062.18
本期利润	-28,872,868.13
加权平均基金份额本期利润	-0.1785
本期加权平均净值利润率	-12.32%
本期基金份额净值增长率	-7.43%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	73,594,753.78
期末可供分配基金份额利润	0.5118
期末基金资产净值	217,379,908.78
期末基金份额净值	1.5118
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	51.18%

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

。

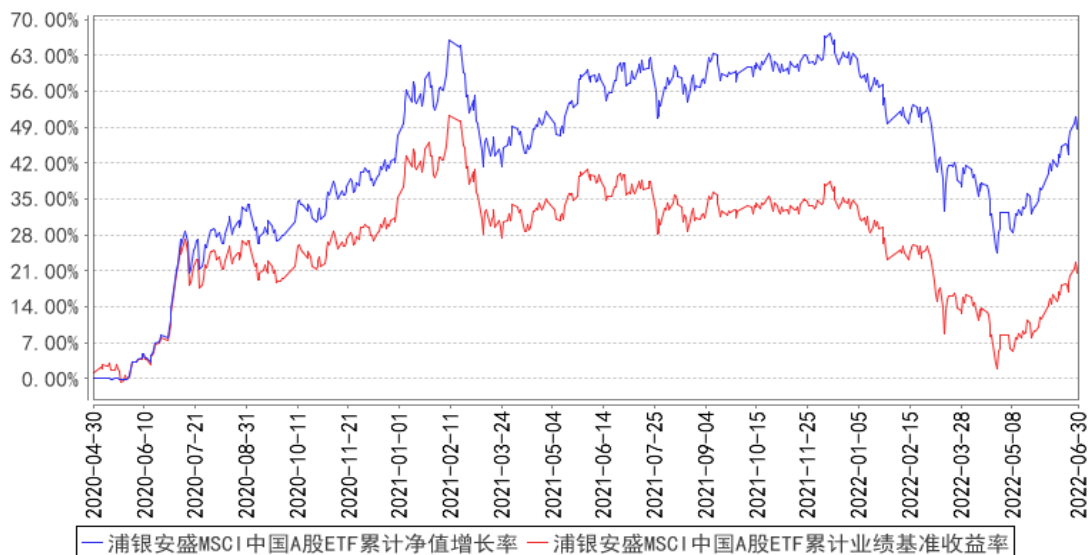
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.30%	1.05%	9.38%	1.07%	0.92%	-0.02%
过去三个月	8.01%	1.43%	6.60%	1.46%	1.41%	-0.03%
过去六个月	-7.43%	1.43%	-9.07%	1.46%	1.64%	-0.03%
过去一年	-6.40%	1.21%	-12.39%	1.24%	5.99%	-0.03%
自基金合同生效起至今	51.18%	1.23%	22.47%	1.26%	28.71%	-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管理有限公司，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 2022 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 100 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基金中基金（FOF）、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、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛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基金中基金（FOF）、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛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基金中基金（FOF）、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、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基金中基金（FOF）

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。

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。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 3 月起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。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。
陈士俊	公司指数及量化投资部总监，公司职工监事，公司旗下部分基金经理。	2020 年 4 月 30 日	-	21 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。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 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及浦银安盛鑫锐混合型证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起担任浦银安盛创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

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，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

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2022 年上半年，市场波动较大，走势探底回升。开年以来，市场在美联储鹰派加息预期、俄乌地缘冲突、中美博弈加剧、新冠疫情等多因素影响下逐级回调。此后，管理层多频次、多领域释放稳增长信号，包括加大基建投资、降息降准、消费刺激、房地产政策边际放松等，叠加疫情在动态清零政策坚决执行下出现明显改善，市场对于经济增长预期从极度悲观发生扭转，投资者情绪也是从恐慌边际修复改善，市场从 4 月中下旬触底后爬坑走高，光伏、新能源车等基本面较好、确定性高的景气赛道表现亮眼。

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 1.5118 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.43%；同期业绩比较基准收益率为-9.07%。

## 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，我们认为国内经济仍将维持复苏态势，国内货币政策继续保持合理充裕，财政政策仍将继续发力稳增长。尽管全年 GDP 量化增长目标有所弱化，但稳增长方向不会变化，有条件的经济大省将承担更多发展任务。此外，部分地产企业暴露的问题及其处理方式将是市场关注的重点，而下半年周边地缘政治问题及其走向将影响市场的整体风险偏好。我们判断下半年市场走势震荡上行，结构性行情将延续，景气板块仍具长期配置价值。

## 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产品估值条线分管领导、风险管理部负责人、指数与量化投资部负责人、产品估值部负责人以及所涉及投资品种的投

研部门负责人（包括但不限于权益投资部、研究部、权益专户部、固定收益投资部、固定收益专户部、信用研究部等）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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

## 5.3 托管人对本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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	6,924,789.96	5,801,305.01
结算备付金		1,281,591.12	1,768,049.09
存出保证金		370,895.82	247,930.04
交易性金融资产	6.4.7.2	209,018,991.57	330,215,564.53
其中：股票投资		209,018,991.57	330,094,878.13
基金投资		-	-
债券投资		-	120,686.40
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		-	73,350.56
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	1,510.24
资产总计		217,596,268.47	338,107,709.47
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		24,612.07	44,355.59
应付托管费		8,204.03	14,785.20
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	183,543.59	320,097.47
负债合计		216,359.69	379,238.26
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	143,785,155.00	206,785,155.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	73,594,753.78	130,943,316.21
净资产合计		217,379,908.78	337,728,471.21
负债和净资产总计		217,596,268.47	338,107,709.47

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5118 元，基金份额总额 143,785,155.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-28,477,178.97	25,441,243.71
1. 利息收入		21,585.26	32,259.27
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,585.26	32,252.12
债券利息收入		-	7.15



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）		-12,443,904.85	39,399,555.46
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-13,897,446.04	37,382,536.11
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	-278,848.33	492,830.10
股利收益	6.4.7.19	1,710,753.06	1,524,189.25
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	-16,167,805.95	-14,663,551.13
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	112,946.57	672,980.11
<b>减：二、营业总支出</b>		395,689.16	822,533.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	176,563.20	171,842.86
2. 托管费	6.4.10.2.2	58,854.38	57,280.94
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		-	1,774.19
8. 其他费用	6.4.7.23	160,271.58	591,635.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-28,872,868.13	24,618,710.07
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-28,872,868.13	24,618,710.07
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-28,872,868.13	24,618,710.07

### 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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. 基金赎回款	-102,000,000.00	-	-47,456,068.11	-149,456,068.11
(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
项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	203,785,155.00	-	96,548,339.69	300,333,494.69
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期初净	203,785,155.00	-	96,548,339.69	300,333,494.69

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-66,000,000.00	-	-11,790,485.52	-77,790,485.52
(一)、综合收益总额	-	-	24,618,710.07	24,618,710.07
(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)	-66,000,000.00	-	-36,409,195.59	-102,409,195.59
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
(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)	137,785,155.00	-	84,757,854.17	222,543,009.17
----------------	----------------	---	---------------	----------------

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。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 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

除 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明中所述以外，其余会计政策、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

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

新金融工具准则：

金融资产和金融负债的分类：

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

#### (1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### (2) 金融负债

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

#### (3) 衍生金融工具

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

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认：

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。



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

收入/(损失)的确认和计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产和金融负债的分类：

#### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的其

他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认：

金融资产和金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

收入/(损失)的确认和计量：

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收

利息和应收证券清算款，金额分别为 5,801,305.01 元、1,768,049.09 元、247,930.04 元、1,510.24 元和 95,670.56 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 5,801,923.00 元、1,768,816.83 元、247,965.13 元、0.00 元和 95,670.56 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 330,215,564.53 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 330,215,653.95 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 44,355.59 元、14,785.20 元和 130,097.47 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 44,355.59 元、14,785.20 元和 130,097.47 元。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	6,924,789.96
等于：本金	6,924,156.43
加：应计利息	633.53
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	6,924,789.96

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	217,892,065.63	-	209,018,991.57	-8,873,074.06
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	217,892,065.63	-	209,018,991.57	-8,873,074.06

## 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	2,480,700.00	-	-	
其中：股指期货投资	2,480,700.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	2,480,700.00	-	-	

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2207	IF2207	2.00	2,683,920.00	203,220.00
合计				203,220.00
减：可抵销期货暂收款				203,220.00
净额				-

**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。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

本基金本报告期末不存在按预期信用损失一般模型计提减值准备的情况。

**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：本基金本报告期末不存在债权投资减值准备计提情况。

**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：本基金本报告期末不存在其他债权投资减值准备计提情况。

**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：本基金本报告期不存在其他权益工具投资情况。

**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 2022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	24,283.44
其中：交易所市场	24,283.44
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应付指数使用费	70,000.00
合计	183,543.59

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,785,155.00	206,785,155.00
本期申购	39,000,000.00	39,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-102,000,000.00	-102,000,000.00
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	143,785,155.00	143,785,155.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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
本期期初	175,867,948.54	-44,924,632.33	130,943,316.21
本期利润	-12,705,062.18	-16,167,805.95	-28,872,868.13
本期基金份额交易产生的变动数	-52,672,087.11	24,196,392.81	-28,475,694.30
其中：基金申购款	31,940,653.89	-12,960,280.08	18,980,373.81
基金赎回款	-84,612,741.00	37,156,672.89	-47,456,068.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	110,490,799.25	-36,896,045.47	73,594,753.78

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
	活期存款利息收入
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	10,507.12
其他	456.02
合计	21,585.26

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,946,509.29
股票投资收益——赎回差价收入	-4,950,936.75
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	-13,897,446.04

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	80,782,160.69
减：卖出股票成本总额	89,536,212.37
减：交易费用	192,457.61
买卖股票差价收入	-8,946,509.29

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	149,456,068.11
减：现金支付赎回款总额	67,951,990.11
减：赎回股票成本总额	86,455,014.75
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,950,936.75

##### 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

单位：人民币元



项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	40.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	21,595.77
债券投资收益——赎回差价收入	—
债券投资收益——申购差价收入	—
合计	21,636.46

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	123,726.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	102,000.00
减：应计利息总额	130.11
减：交易费用	0.12
买卖债券差价收入	21,595.77

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期间无债券投资收益——赎回差价收入。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期间无债券投资收益——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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**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
	2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-278,848.33

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,710,753.06
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	1,710,753.06

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-16,393,345.95
股票投资	-16,374,659.55
债券投资	-18,686.40
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	225,540.00
权证投资	-
期货投资	225,540.00
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	-16,167,805.95

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	112,946.57
合计	112,946.57

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 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,011.43
指数使用费	70,000.00
合计	160,271.58

#### 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

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
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	基金管理人管理的其他基金

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	176,563.20	171,842.86
其中：支付销售机构的客户维护费	4,442.80	1,604.10

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 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	58,854.38	57,280.94

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：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 2022年6月30日		上年度末 2021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	48,520,700.00	33.75	85,588,200.00	41.39

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	6,924,789.96	10,622.12	10,145,610.87	12,843.39

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

1、于2022年6月30日，本基金持有159,700.00股托管人中国银行的A股普通股，成本总额为人民币499,992.14元，估值总额为人民币520,622.00元，占基金资产净值的比例为0.24%。

2、于2022年6月30日，本基金持有138,900.00股浦发银行的A股普通股，成本总额为人民币1,274,979.35元，估值总额为人民币1,112,589.00元，占基金资产净值的比例为0.51%。

#### 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(2022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	受限期	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
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股锁定	55.57	30.03	195	10,836.15	5,855.85	-
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股锁定	39.88	31.09	234	9,331.92	7,275.06	-
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股锁定	42.50	32.02	261	8,542.50	8,357.22	-
301109	军信股份	2022年4月6日	6个月	新股锁定	34.81	16.14	294	6,822.76	4,745.16	-
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股锁定	63.10	39.85	136	8,581.60	5,419.60	-
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股锁定	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301151	冠龙节	2022年	6个月	新股锁	30.82	21.46	211	6,503.02	4,528.06	-

	能	3月30日		定							
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02		-
301160	翔楼新材	2022年5月25日	6个月	新股锁定	31.56	37.66	288	9,089.28	10,846.08		-
301201	诚达药业	2022年1月12日	6个月	新股锁定	72.69	71.54	172	12,502.68	12,304.88		-
301207	华兰疫苗	2022年2月10日	6个月	新股锁定	56.88	56.42	138	7,849.44	7,785.96		-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股锁定	35.68	29.84	243	8,670.24	7,251.12		-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股锁定	173.98	87.82	65	6,263.28	5,708.30		-
301228	实朴检测	2022年1月21日	6个月	新股锁定	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82		-
301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股锁定	39.30	37.93	322	12,654.60	12,213.46		-
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股锁定	72.88	31.38	291	14,138.72	9,131.58		-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股锁定	56.69	41.86	118	6,689.42	4,939.48		-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定	48.30	41.68	148	7,148.40	6,168.64		-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股锁定	28.50	34.87	220	6,270.00	7,671.40		-
688115	思林杰	2022年3月7日	6个月	新股锁定	65.65	38.46	1,378	90,465.70	52,997.88		-
688171	纬德信息	2022年1月20日	6个月	新股锁定	28.68	22.77	2,821	80,906.28	64,234.17		-
688175	高凌信息	2022年3月8日	6个月	新股锁定	51.68	32.23	1,710	88,372.80	55,113.30		-

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

注：本基金本报告期末未持有的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在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

#### 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 2022 年 6 月 30 日，本基金无债券和资产支持证券投资(2021 年 12 月 31 日：本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.04%)。

#### 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 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约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 2022 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。

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、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 2022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	6,924,789.96	-	-	-	6,924,789.96
结算备付金	1,281,591.12	-	-	-	1,281,591.12
存出保证金	370,895.82	-	-	-	370,895.82
交易性金融资产	-	-	-	-209,018,991.57	209,018,991.57
资产总计	8,577,276.90	-	-	-209,018,991.57	217,596,268.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	24,612.07	24,612.07
应付托管费	-	-	-	8,204.03	8,204.03
其他负债	-	-	-	589,983.59	589,983.59

负债总计	-	-	-	622,799.69	622,799.69
利率敏感度缺口	8,577,276.90	-	-	-208,396,191.88	216,973,468.78
上年度末 2021 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	5,801,305.01	-	-	-	5,801,305.01
结算备付金	1,768,049.09	-	-	-	1,768,049.09
存出保证金	247,930.04	-	-	-	247,930.04
交易性金融资产	-	-	120,686.40	330,094,878.13	330,215,564.53
应收利息	-	-	-	1,510.24	1,510.24
应收证券清算款	-	-	-	73,350.56	73,350.56
资产总计	7,817,284.14	-	120,686.40	330,169,738.93	338,107,709.47
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	44,355.59	44,355.59
应付托管费	-	-	-	14,785.20	14,785.20
应付交易费用	-	-	-	130,097.47	130,097.47
其他负债	-	-	-	190,000.00	190,000.00
负债总计	-	-	-	379,238.26	379,238.26
利率敏感度缺口	7,817,284.14	-	120,686.40	329,790,500.67	337,728,471.21

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 2022 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（2021 年 12 月 31 日：本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.04%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2021 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 2022年6月30日		上年度末 2021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	209,018,991.57	96.15	330,094,878.13	97.74
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	209,018,991.57	96.15	330,094,878.13	97.74

#### 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 (2022年6月30日)	上年度末 (2021年12月31日)	
分析	业绩比较基准上升 500 基点	10,507,852.91	16,025,319.06
	业绩比较基准下降 500 基点	-10,507,852.91	-16,025,319.06

## 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	208,699,328.11	328,545,472.96
第二层次	-	5,504.49
第三层次	319,663.46	1,664,587.08
合计	209,018,991.57	330,215,564.53

#### 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、债券和基金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 2022 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（2021 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

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	209,018,991.57	96.06
	其中：股票	209,018,991.57	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	8,206,381.08	3.77
8	其他各项资产	370,895.82	0.17
9	合计	217,596,268.47	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	2,590,931.16	1.19
B	采矿业	7,800,079.40	3.59
C	制造业	126,953,587.70	58.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,771,921.20	2.66
E	建筑业	3,544,810.00	1.63
F	批发和零售业	1,501,006.50	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	6,157,255.60	2.83
H	住宿和餐饮业	428,220.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,739,335.82	3.10
J	金融业	34,893,697.47	16.05
K	房地产业	3,468,725.33	1.60
L	租赁和商务服务业	2,898,255.00	1.33

M	科学研究和技术服务业	2,599,417.80	1.20
N	水利、环境和公共设施管理业	405,274.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,926,146.13	0.89
R	文化、体育和娱乐业	599,970.35	0.28
S	综合	160,531.00	0.07
	合计	208,439,164.46	95.89

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	427,745.99	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,794.40	0.00
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	89,676.79	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,275.06	0.00
M	科学研究和技术服务业	19,800.28	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	17,177.37	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	8,357.22	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	579,827.11	0.27

### 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	6,403	13,094,135.00	6.02
2	300750	宁德时代	10,300	5,500,200.00	2.53
3	600036	招商银行	94,171	3,974,016.20	1.83
4	000858	五粮液	17,900	3,614,547.00	1.66
5	002594	比亚迪	8,950	2,984,735.50	1.37
6	600900	长江电力	107,700	2,490,024.00	1.15
7	601012	隆基绿能	36,660	2,442,655.80	1.12
8	601318	中国平安	51,300	2,395,197.00	1.10
9	601888	中国中免	9,400	2,189,542.00	1.01
10	600809	山西汾酒	6,380	2,072,224.00	0.95
11	300760	迈瑞医疗	6,600	2,067,120.00	0.95
12	601166	兴业银行	98,300	1,956,170.00	0.90
13	603288	海天味业	18,450	1,667,142.00	0.77
14	300059	东方财富	61,638	1,565,605.20	0.72
15	600309	万华化学	16,100	1,561,539.00	0.72
16	000568	泸州老窖	6,100	1,503,894.00	0.69
17	002714	牧原股份	25,688	1,419,775.76	0.65
18	000001	平安银行	93,400	1,399,132.00	0.64
19	601398	工商银行	293,000	1,397,610.00	0.64
20	600438	通威股份	22,900	1,370,794.00	0.63
21	002352	顺丰控股	24,100	1,345,021.00	0.62
22	002142	宁波银行	37,100	1,328,551.00	0.61
23	603259	药明康德	11,580	1,204,204.20	0.55
24	600030	中信证券	54,910	1,189,350.60	0.55
25	002812	恩捷股份	4,600	1,152,070.00	0.53
26	600276	恒瑞医药	30,972	1,148,751.48	0.53
27	002304	洋河股份	6,209	1,137,178.35	0.52
28	300015	爱尔眼科	25,269	1,131,293.13	0.52
29	600887	伊利股份	28,600	1,113,970.00	0.51
30	600000	浦发银行	138,900	1,112,589.00	0.51
31	002475	立讯精密	32,768	1,107,230.72	0.51
32	600436	片仔癀	3,000	1,070,190.00	0.49
33	601668	中国建筑	200,700	1,067,724.00	0.49
34	601288	农业银行	347,200	1,048,544.00	0.48
35	601088	中国神华	30,800	1,025,640.00	0.47
36	600048	保利发展	56,600	988,236.00	0.45
37	601816	京沪高铁	195,100	979,402.00	0.45

38	002129	TCL 中环	16,100	948,129.00	0.44
39	601225	陕西煤业	44,600	944,628.00	0.43
40	002460	赣锋锂业	6,300	936,810.00	0.43
41	601899	紫金矿业	100,300	935,799.00	0.43
42	000002	万 科 A	45,300	928,650.00	0.43
43	603659	璞泰来	11,000	928,400.00	0.43
44	601328	交通银行	186,300	927,774.00	0.43
45	300896	爱美客	1,500	900,015.00	0.41
46	300014	亿纬锂能	9,102	887,445.00	0.41
47	600406	国电南瑞	32,088	866,376.00	0.40
48	601919	中远海控	61,420	853,738.00	0.39
49	002459	晶澳科技	10,780	850,542.00	0.39
50	002371	北方华创	3,000	831,360.00	0.38
51	600690	海尔智家	30,200	829,292.00	0.38
52	600905	三峡能源	130,400	820,216.00	0.38
53	300124	汇川技术	12,450	820,081.50	0.38
54	603799	华友钴业	8,470	809,901.40	0.37
55	600031	三一重工	42,256	805,399.36	0.37
56	300122	智飞生物	7,100	788,171.00	0.36
57	002493	荣盛石化	50,100	771,039.00	0.35
58	601601	中国太保	32,300	760,019.00	0.35
59	603986	兆易创新	5,160	733,803.60	0.34
60	000596	古井贡酒	2,900	724,014.00	0.33
61	000625	长安汽车	41,002	710,154.64	0.33
62	603501	韦尔股份	4,100	709,423.00	0.33
63	000725	京东方 A	178,600	703,684.00	0.32
64	600585	海螺水泥	19,900	702,072.00	0.32
65	300498	温氏股份	32,060	682,557.40	0.31
66	600104	上汽集团	38,200	680,342.00	0.31
67	601658	邮储银行	125,900	678,601.00	0.31
68	000661	长春高新	2,900	676,918.00	0.31
69	600346	恒力石化	29,400	653,856.00	0.30
70	603392	万泰生物	4,205	653,036.50	0.30
71	600016	民生银行	169,800	631,656.00	0.29
72	300274	阳光电源	6,400	628,800.00	0.29
73	300751	迈为股份	1,280	628,352.00	0.29
74	600028	中国石化	150,700	614,856.00	0.28
75	600019	宝钢股份	101,900	613,438.00	0.28
76	601766	中国中车	117,800	612,560.00	0.28
77	002709	天赐材料	9,840	610,670.40	0.28
78	300763	锦浪科技	2,850	607,050.00	0.28
79	600893	航发动力	13,000	591,630.00	0.27

80	601818	光大银行	196,200	590,562.00	0.27
81	000538	云南白药	9,775	590,312.25	0.27
82	601669	中国电建	74,600	587,102.00	0.27
83	601066	中信建投	20,300	586,873.00	0.27
84	601390	中国中铁	95,200	584,528.00	0.27
85	603833	欧派家居	3,820	575,597.60	0.26
86	002049	紫光国微	3,000	569,160.00	0.26
87	601211	国泰君安	36,468	554,313.60	0.25
88	688111	金山办公	2,800	551,936.00	0.25
89	600111	北方稀土	15,600	548,496.00	0.25
90	002241	歌尔股份	16,300	547,680.00	0.25
91	601857	中国石油	100,300	531,590.00	0.24
92	600745	闻泰科技	6,200	527,682.00	0.24
93	688012	中微公司	4,500	525,375.00	0.24
94	000776	广发证券	28,000	523,600.00	0.24
95	601988	中国银行	159,700	520,622.00	0.24
96	300316	晶盛机电	7,600	513,684.00	0.24
97	600050	中国联通	146,800	507,928.00	0.23
98	600089	特变电工	18,400	503,976.00	0.23
99	600919	江苏银行	70,780	503,953.60	0.23
100	688599	天合光能	7,700	502,425.00	0.23
101	601688	华泰证券	35,300	501,260.00	0.23
102	601009	南京银行	48,000	500,160.00	0.23
103	600999	招商证券	34,140	491,957.40	0.23
104	601985	中国核电	71,700	491,862.00	0.23
105	300782	卓胜微	3,584	483,840.00	0.22
106	000063	中兴通讯	18,900	482,517.00	0.22
107	002230	科大讯飞	11,700	482,274.00	0.22
108	600010	宝钢股份	205,000	481,750.00	0.22
109	603993	洛阳钼业	83,100	476,163.00	0.22
110	002821	凯莱英	1,611	465,579.00	0.21
111	000651	格力电器	13,800	465,336.00	0.21
112	002027	分众传媒	69,100	465,043.00	0.21
113	000166	申万宏源	108,200	464,178.00	0.21
114	603290	斯达半导	1,200	463,080.00	0.21
115	600837	海通证券	46,700	458,127.00	0.21
116	002756	永兴材料	3,000	456,630.00	0.21
117	001979	招商蛇口	33,700	452,591.00	0.21
118	300661	圣邦股份	2,475	450,499.50	0.21
119	600196	复星医药	10,200	449,718.00	0.21
120	601006	大秦铁路	68,200	449,438.00	0.21
121	603806	福斯特	6,812	446,322.24	0.21

122	601169	北京银行	98,100	445,374.00	0.20
123	601229	上海银行	67,900	444,745.00	0.20
124	002311	海大集团	7,400	444,074.00	0.20
125	002920	德赛西威	3,000	444,000.00	0.20
126	600132	重庆啤酒	3,000	439,800.00	0.20
127	000895	双汇发展	15,000	439,500.00	0.20
128	601100	恒立液压	7,116	439,199.52	0.20
129	600926	杭州银行	29,300	438,914.00	0.20
130	601633	长城汽车	11,800	437,072.00	0.20
131	603185	上机数控	2,800	436,772.00	0.20
132	600660	福耀玻璃	10,300	430,643.00	0.20
133	688036	传音控股	4,800	428,304.00	0.20
134	000799	酒鬼酒	2,300	427,363.00	0.20
135	000338	潍柴动力	34,000	423,980.00	0.20
136	300759	康龙化成	4,450	423,729.00	0.19
137	601628	中国人寿	13,400	416,472.00	0.19
138	600989	宝丰能源	28,200	413,130.00	0.19
139	600150	中国船舶	21,600	409,968.00	0.19
140	000733	振华科技	3,000	407,910.00	0.19
141	601877	正泰电器	11,400	407,892.00	0.19
142	300496	中科创达	3,100	404,488.00	0.19
143	601689	拓普集团	5,900	403,737.00	0.19
144	600188	兖矿能源	10,200	402,696.00	0.19
145	600763	通策医疗	2,300	401,212.00	0.18
146	603260	合盛硅业	3,300	389,268.00	0.18
147	601111	中国国航	32,900	381,969.00	0.18
148	600522	中天科技	16,500	381,150.00	0.18
149	000963	华东医药	8,400	379,344.00	0.17
150	688180	君实生物	5,000	376,700.00	0.17
151	600741	华域汽车	16,300	374,900.00	0.17
152	603486	科沃斯	3,000	365,670.00	0.17
153	688008	澜起科技	6,000	363,480.00	0.17
154	601238	广汽集团	23,700	361,188.00	0.17
155	600029	南方航空	49,200	359,652.00	0.17
156	688396	华润微	6,000	354,420.00	0.16
157	600176	中国巨石	20,188	351,473.08	0.16
158	601868	中国能建	148,300	351,471.00	0.16
159	688005	容百科技	2,700	349,488.00	0.16
160	600563	法拉电子	1,700	348,772.00	0.16
161	300999	金龙鱼	6,433	347,510.66	0.16
162	000876	新希望	22,700	347,310.00	0.16
163	603605	珀莱雅	2,100	346,878.00	0.16

164	603737	三棵树	2,680	346,872.40	0.16
165	600256	广汇能源	32,900	346,766.00	0.16
166	600958	东方证券	33,744	344,526.24	0.16
167	601799	星宇股份	2,000	342,000.00	0.16
168	601138	工业富联	34,400	338,496.00	0.16
169	601336	新华保险	10,500	337,995.00	0.16
170	300628	亿联网络	4,400	335,060.00	0.15
171	601615	明阳智能	9,900	334,620.00	0.15
172	603369	今世缘	6,500	331,500.00	0.15
173	600845	宝信软件	6,050	330,330.00	0.15
174	603613	国联股份	3,725	330,035.00	0.15
175	600886	国投电力	31,340	329,070.00	0.15
176	600795	国电电力	83,700	327,267.00	0.15
177	300769	德方纳米	800	326,944.00	0.15
178	000100	TCL 科技	67,900	325,241.00	0.15
179	600547	山东黄金	17,520	325,171.20	0.15
180	600588	用友网络	14,960	324,781.60	0.15
181	600460	士兰微	6,200	322,400.00	0.15
182	002001	新 和 成	14,100	321,621.00	0.15
183	600426	华鲁恒升	10,970	320,324.00	0.15
184	600015	华夏银行	61,307	319,409.47	0.15
185	300223	北京君正	3,000	318,750.00	0.15
186	600600	青岛啤酒	3,000	311,760.00	0.14
187	300454	深信服	3,000	311,340.00	0.14
188	300347	泰格医药	2,700	309,015.00	0.14
189	002180	纳思达	6,100	308,782.00	0.14
190	688122	西部超导	3,300	304,260.00	0.14
191	600884	杉杉股份	10,200	303,144.00	0.14
192	300142	沃森生物	6,200	300,018.00	0.14
193	601618	中国中冶	85,700	299,950.00	0.14
194	601155	新城控股	11,771	299,336.53	0.14
195	300037	新宙邦	5,680	298,540.80	0.14
196	002791	坚朗五金	2,300	298,356.00	0.14
197	300919	中伟股份	2,400	297,360.00	0.14
198	002736	国信证券	31,000	296,670.00	0.14
199	601600	中国铝业	61,800	293,550.00	0.14
200	600486	扬农化工	2,200	293,216.00	0.13
201	601788	光大证券	18,600	293,136.00	0.13
202	002192	融捷股份	1,900	292,030.00	0.13
203	600383	金地集团	21,600	290,304.00	0.13
204	002648	卫星化学	11,218	289,985.30	0.13
205	600754	锦江酒店	4,600	289,340.00	0.13

206	603882	金域医学	3,500	288,925.00	0.13
207	601838	成都银行	17,400	288,492.00	0.13
208	300033	同花顺	3,000	288,450.00	0.13
209	601360	三六零	33,711	287,217.72	0.13
210	603345	安井食品	1,700	285,379.00	0.13
211	300413	芒果超媒	8,500	283,560.00	0.13
212	603606	东方电缆	3,700	283,420.00	0.13
213	300957	贝泰妮	1,300	282,789.00	0.13
214	002916	深南电路	3,000	281,130.00	0.13
215	600233	圆通速递	13,700	279,343.00	0.13
216	600779	水井坊	3,000	277,620.00	0.13
217	601939	建设银行	45,600	276,336.00	0.13
218	600570	恒生电子	6,316	274,998.64	0.13
219	002074	国轩高科	6,000	273,600.00	0.13
220	300433	蓝思科技	24,700	273,429.00	0.13
221	300408	三环集团	9,065	272,856.50	0.13
222	600009	上海机场	4,800	272,160.00	0.13
223	601117	中国化学	28,900	271,949.00	0.13
224	300073	当升科技	3,000	271,020.00	0.12
225	002850	科达利	1,700	270,300.00	0.12
226	000938	紫光股份	13,900	269,660.00	0.12
227	600141	兴发集团	6,100	268,339.00	0.12
228	600018	上港集团	45,600	265,848.00	0.12
229	000301	东方盛虹	15,600	263,796.00	0.12
230	000786	北新建材	7,600	263,112.00	0.12
231	300390	天华超净	3,000	262,200.00	0.12
232	601727	上海电气	63,700	261,807.00	0.12
233	601916	浙商银行	78,800	261,616.00	0.12
234	002240	盛新锂能	4,300	259,548.00	0.12
235	603899	晨光股份	4,600	257,968.00	0.12
236	603127	昭衍新药	2,260	257,188.00	0.12
237	605358	立昂微	3,800	256,044.00	0.12
238	600039	四川路桥	24,200	254,826.00	0.12
239	000069	华侨城 A	39,200	254,408.00	0.12
240	605117	德业股份	900	251,901.00	0.12
241	002236	大华股份	15,300	251,226.00	0.12
242	002120	韵达股份	14,560	248,393.60	0.11
243	002555	三七互娱	11,700	248,391.00	0.11
244	688169	石头科技	400	246,680.00	0.11
245	600011	华能国际	34,900	245,696.00	0.11
246	002202	金风科技	16,400	242,720.00	0.11
247	000723	美锦能源	19,800	241,560.00	0.11

248	688126	沪硅产业	10,500	241,290.00	0.11
249	601995	中金公司	5,400	240,246.00	0.11
250	600115	中国东航	43,500	238,815.00	0.11
251	000983	山西焦煤	17,720	237,270.80	0.11
252	300207	欣旺达	7,500	237,000.00	0.11
253	601377	兴业证券	33,100	233,355.00	0.11
254	300595	欧普康视	4,040	231,047.60	0.11
255	300450	先导智能	3,640	229,975.20	0.11
256	002013	中航机电	18,600	229,710.00	0.11
257	600875	东方电气	13,900	228,655.00	0.11
258	601865	福莱特	6,000	228,600.00	0.11
259	600584	长电科技	8,400	226,800.00	0.10
260	002841	视源股份	3,003	226,185.96	0.10
261	601901	方正证券	33,572	225,268.12	0.10
262	300724	捷佳伟创	2,500	223,375.00	0.10
263	603816	顾家家居	3,900	220,857.00	0.10
264	000999	华润三九	4,900	220,500.00	0.10
265	002080	中材科技	8,000	220,000.00	0.10
266	300676	华大基因	3,000	215,100.00	0.10
267	603267	鸿远电子	1,600	214,928.00	0.10
268	601699	潞安环能	14,700	214,914.00	0.10
269	600499	科达制造	10,400	214,656.00	0.10
270	601878	浙商证券	18,800	213,944.00	0.10
271	300373	扬杰科技	3,000	213,750.00	0.10
272	002176	江特电机	8,500	212,840.00	0.10
273	002601	龙佰集团	10,600	212,530.00	0.10
274	002497	雅化集团	6,500	212,225.00	0.10
275	600918	中泰证券	27,700	211,905.00	0.10
276	000738	航发控制	7,533	211,677.30	0.10
277	603568	伟明环保	6,300	210,231.00	0.10
278	000157	中联重科	34,000	209,440.00	0.10
279	002340	格林美	23,000	209,300.00	0.10
280	600674	川投能源	17,500	208,600.00	0.10
281	600219	南山铝业	56,400	208,116.00	0.10
282	300601	康泰生物	4,586	207,195.48	0.10
283	002268	卫士通	4,800	205,968.00	0.09
284	000425	徐工机械	38,200	205,898.00	0.09
285	688006	杭可科技	2,900	203,174.00	0.09
286	002938	鹏鼎控股	6,700	202,407.00	0.09
287	688099	晶晨股份	2,000	202,000.00	0.09
288	601216	君正集团	41,000	200,080.00	0.09
289	688363	华熙生物	1,400	199,052.00	0.09

290	002007	华兰生物	8,700	198,360.00	0.09
291	002252	上海莱士	33,200	196,876.00	0.09
292	603198	迎驾贡酒	3,000	195,420.00	0.09
293	601881	中国银河	20,200	195,334.00	0.09
294	002738	中矿资源	2,100	194,481.00	0.09
295	603444	吉比特	500	194,000.00	0.09
296	600885	宏发股份	4,620	193,347.00	0.09
297	600803	新奥股份	10,400	193,336.00	0.09
298	002064	华峰化学	22,600	190,744.00	0.09
299	000683	远兴能源	18,100	190,231.00	0.09
300	688202	美迪西	560	190,181.60	0.09
301	600332	白云山	6,000	189,540.00	0.09
302	002353	杰瑞股份	4,700	189,410.00	0.09
303	300144	宋城演艺	12,161	186,671.35	0.09
304	002603	以岭药业	7,680	186,624.00	0.09
305	603456	九洲药业	3,600	186,120.00	0.09
306	000703	恒逸石化	17,680	185,816.80	0.09
307	600362	江西铜业	10,400	185,432.00	0.09
308	688188	柏楚电子	840	184,833.60	0.09
309	002625	光启技术	10,700	184,789.00	0.09
310	002414	高德红外	14,315	184,234.05	0.08
311	300726	宏达电子	3,000	183,510.00	0.08
312	600183	生益科技	10,800	183,492.00	0.08
313	002384	东山精密	8,000	183,440.00	0.08
314	300529	健帆生物	3,600	183,204.00	0.08
315	300558	贝达药业	3,000	182,400.00	0.08
316	688187	时代电气	2,800	181,972.00	0.08
317	600153	建发股份	13,900	181,673.00	0.08
318	300850	新强联	2,040	181,621.20	0.08
319	002407	多氟多	3,700	180,967.00	0.08
320	600298	安琪酵母	3,711	180,911.25	0.08
321	601555	东吴证券	26,090	180,803.70	0.08
322	000155	川能动力	8,000	177,200.00	0.08
323	300699	光威复材	3,000	176,610.00	0.08
324	603589	口子窖	3,000	175,830.00	0.08
325	601108	财通证券	22,230	174,950.10	0.08
326	601233	桐昆股份	11,000	174,680.00	0.08
327	002385	大北农	22,300	174,163.00	0.08
328	600392	盛和资源	7,700	174,020.00	0.08
329	601058	赛轮轮胎	15,400	173,558.00	0.08
330	603517	绝味食品	3,000	173,460.00	0.08
331	300146	汤臣倍健	8,000	173,200.00	0.08



332	000519	中兵红箭	5,900	171,985.00	0.08
333	600985	淮北矿业	11,800	171,808.00	0.08
334	603707	健友股份	6,081	171,484.20	0.08
335	002557	洽洽食品	3,000	170,790.00	0.08
336	002372	伟星新材	7,100	170,684.00	0.08
337	601319	中国人保	33,700	170,522.00	0.08
338	600348	华阳股份	11,000	170,060.00	0.08
339	601607	上海医药	9,400	169,952.00	0.08
340	603077	和邦生物	39,800	169,548.00	0.08
341	002508	老板电器	4,700	169,341.00	0.08
342	002032	苏泊尔	3,000	169,020.00	0.08
343	002602	世纪华通	35,040	168,892.80	0.08
344	002294	信立泰	6,000	168,600.00	0.08
345	002409	雅克科技	3,000	166,530.00	0.08
346	000932	华菱钢铁	32,500	165,425.00	0.08
347	600026	中远海能	16,000	165,280.00	0.08
348	002600	领益智造	32,700	164,154.00	0.08
349	600160	巨化股份	12,400	163,060.00	0.08
350	002078	太阳纸业	13,200	162,492.00	0.07
351	601636	旗滨集团	12,700	161,925.00	0.07
352	601577	长沙银行	20,400	161,772.00	0.07
353	000630	铜陵有色	49,600	161,696.00	0.07
354	000977	浪潮信息	6,100	161,528.00	0.07
355	000009	中国宝安	11,900	160,531.00	0.07
356	603939	益丰药房	3,030	160,074.90	0.07
357	601966	玲珑轮胎	6,300	159,831.00	0.07
358	300003	乐普医疗	8,600	159,702.00	0.07
359	688185	康希诺	800	159,264.00	0.07
360	000830	鲁西化工	9,200	159,068.00	0.07
361	000783	长江证券	26,800	158,924.00	0.07
362	600487	亨通光电	10,800	157,032.00	0.07
363	300568	星源材质	5,394	156,641.76	0.07
364	300357	我武生物	3,000	156,090.00	0.07
365	603338	浙江鼎力	3,060	155,142.00	0.07
366	688009	中国通号	34,000	154,020.00	0.07
367	000825	太钢不锈	28,200	153,690.00	0.07
368	601077	渝农商行	41,200	152,440.00	0.07
369	002531	天顺风能	9,200	151,708.00	0.07
370	002326	永太科技	4,600	151,478.00	0.07
371	002405	四维图新	10,000	150,700.00	0.07
372	600161	天坛生物	6,180	150,050.40	0.07
373	002430	杭氧股份	4,800	150,048.00	0.07

374	000800	一汽解放	16,000	149,440.00	0.07
375	000987	越秀金控	21,188	148,951.64	0.07
376	002507	涪陵榨菜	4,300	148,436.00	0.07
377	000401	冀东水泥	14,100	148,332.00	0.07
378	000066	中国长城	13,700	148,234.00	0.07
379	601990	南京证券	17,700	147,618.00	0.07
380	600177	雅戈尔	22,180	147,053.40	0.07
381	600705	中航产融	42,200	146,012.00	0.07
382	600415	小商品城	26,200	145,934.00	0.07
383	000629	攀钢钒钛	38,300	145,540.00	0.07
384	002532	天山铝业	22,200	144,966.00	0.07
385	000831	五矿稀土	4,600	143,750.00	0.07
386	002185	华天科技	15,300	143,514.00	0.07
387	601168	西部矿业	12,000	141,960.00	0.07
388	600521	华海药业	6,250	141,875.00	0.07
389	000893	亚钾国际	4,100	141,081.00	0.06
390	600258	首旅酒店	5,600	138,880.00	0.06
391	601666	平煤股份	10,200	138,618.00	0.06
392	600109	国金证券	15,400	138,600.00	0.06
393	002673	西部证券	21,100	137,994.00	0.06
394	601198	东兴证券	15,500	137,950.00	0.06
395	600655	豫园股份	14,600	137,824.00	0.06
396	002568	百润股份	4,580	137,583.20	0.06
397	002624	完美世界	9,550	137,233.50	0.06
398	600038	中直股份	3,000	135,600.00	0.06
399	300832	新产业	3,000	135,330.00	0.06
400	601880	辽港股份	79,400	134,980.00	0.06
401	600338	西藏珠峰	4,700	134,890.00	0.06
402	603218	日月股份	5,300	134,620.00	0.06
403	002463	沪电股份	9,100	134,316.00	0.06
404	002299	圣农发展	7,000	134,260.00	0.06
405	000975	银泰黄金	13,760	134,022.40	0.06
406	000933	神火股份	10,200	133,416.00	0.06
407	002128	电投能源	9,300	133,176.00	0.06
408	600027	华电国际	33,800	132,834.00	0.06
409	002028	思源电气	3,700	131,942.00	0.06
410	600549	厦门钨业	6,100	131,882.00	0.06
411	603233	大参林	4,204	131,585.20	0.06
412	002408	齐翔腾达	16,000	129,760.00	0.06
413	300251	光线传媒	13,700	129,739.00	0.06
414	002541	鸿路钢构	3,870	129,258.00	0.06
415	000728	国元证券	20,740	129,002.80	0.06

416	002223	鱼跃医疗	5,000	128,300.00	0.06
417	000998	隆平高科	7,700	128,282.00	0.06
418	600369	西南证券	32,300	128,231.00	0.06
419	600872	中炬高新	3,700	128,057.00	0.06
420	600170	上海建工	42,000	127,260.00	0.06
421	688002	睿创微纳	3,200	127,104.00	0.06
422	002925	盈趣科技	5,900	126,968.00	0.06
423	601456	国联证券	10,300	126,381.00	0.06
424	600598	北大荒	8,500	125,460.00	0.06
425	600516	方大炭素	16,480	125,248.00	0.06
426	002939	长城证券	12,300	124,968.00	0.06
427	000960	锡业股份	7,400	124,098.00	0.06
428	000027	深圳能源	19,320	123,841.20	0.06
429	601696	中银证券	9,300	123,690.00	0.06
430	000739	普洛药业	5,950	122,808.00	0.06
431	002266	浙富控股	25,600	122,624.00	0.06
432	000807	云铝股份	12,400	122,512.00	0.06
433	002797	第一创业	19,100	122,431.00	0.06
434	000937	冀中能源	16,400	122,344.00	0.06
435	600988	赤峰黄金	7,600	121,220.00	0.06
436	600056	中国医药	8,120	120,338.40	0.06
437	603858	步长制药	6,100	120,231.00	0.06
438	002153	石基信息	7,548	119,786.76	0.06
439	000591	太阳能	14,100	117,735.00	0.05
440	600380	健康元	9,400	116,090.00	0.05
441	600808	马钢股份	30,500	115,595.00	0.05
442	600079	人福医药	7,200	115,200.00	0.05
443	600143	金发科技	12,100	115,192.00	0.05
444	600801	华新水泥	5,900	115,109.00	0.05
445	601016	节能风电	23,800	114,240.00	0.05
446	002422	科伦药业	6,100	114,070.00	0.05
447	002156	通富微电	7,400	113,960.00	0.05
448	000988	华工科技	4,900	113,533.00	0.05
449	000709	河钢股份	50,200	113,452.00	0.05
450	000050	深天马 A	11,300	112,661.00	0.05
451	600704	物产中大	21,800	111,834.00	0.05
452	002506	协鑫集成	29,800	110,856.00	0.05
453	000423	东阿阿胶	3,000	110,850.00	0.05
454	603712	七一二	3,500	110,250.00	0.05
455	601992	金隅集团	39,600	109,692.00	0.05
456	300308	中际旭创	3,500	108,675.00	0.05
457	000513	丽珠集团	3,000	108,630.00	0.05

458	600998	九州通	9,100	108,381.00	0.05
459	002145	中核钛白	15,120	107,805.60	0.05
460	002152	广电运通	11,400	105,678.00	0.05
461	603866	桃李面包	6,376	105,522.80	0.05
462	002044	美年健康	18,800	104,716.00	0.05
463	601866	中远海发	34,300	102,900.00	0.05
464	600295	鄂尔多斯	5,700	102,885.00	0.05
465	002465	海格通信	11,300	102,717.00	0.05
466	600848	上海临港	7,480	101,428.80	0.05
467	300418	昆仑万维	6,300	100,800.00	0.05
468	002157	正邦科技	16,600	100,596.00	0.05
469	002030	达安基因	5,852	100,595.88	0.05
470	002065	东华软件	15,900	100,488.00	0.05
471	600699	均胜电子	6,300	98,973.00	0.05
472	300253	卫宁健康	11,240	98,687.20	0.05
473	002500	山西证券	17,170	98,555.80	0.05
474	600711	盛屯矿业	12,700	98,552.00	0.05
475	002138	顺络电子	3,600	98,100.00	0.05
476	002926	华西证券	12,500	98,000.00	0.05
477	002010	传化智联	15,200	97,736.00	0.04
478	688298	东方生物	840	95,886.00	0.04
479	000750	国海证券	26,000	94,380.00	0.04
480	002558	巨人网络	10,200	93,330.00	0.04
481	002456	欧菲光	13,900	93,269.00	0.04
482	300677	英科医疗	3,640	92,310.40	0.04
483	600688	上海石化	28,600	90,948.00	0.04
484	002092	中泰化学	11,500	89,240.00	0.04
485	002958	青农商行	26,600	88,312.00	0.04
486	600498	烽火通信	6,000	86,880.00	0.04
487	000860	顺鑫农业	3,216	86,253.12	0.04
488	600583	海油工程	20,700	85,905.00	0.04
489	600895	张江高科	6,700	83,415.00	0.04
490	601598	中国外运	20,700	80,316.00	0.04
491	002563	森马服饰	12,300	72,816.00	0.03
492	300070	碧水源	13,900	72,419.00	0.03
493	000686	东北证券	10,100	70,599.00	0.03
494	000656	金科股份	24,600	70,356.00	0.03
495	300383	光环新网	6,000	62,520.00	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

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	301160	翔楼新材	2,873	122,285.43	0.06
2	688171	纬德信息	2,821	64,234.17	0.03
3	688175	高凌信息	1,710	55,113.30	0.03
4	688115	思林杰	1,378	52,997.88	0.02
5	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.02
6	001323	慕思股份	573	28,111.38	0.01
7	301101	明月镜片	371	19,043.43	0.01
8	301127	天源环保	1,117	12,432.21	0.01
9	301201	诚达药业	172	12,304.88	0.01
10	301235	华康医疗	322	12,213.46	0.01
11	301116	益客食品	577	11,805.42	0.01
12	301211	亨迪药业	532	11,533.76	0.01
13	001268	联合精密	409	11,337.48	0.01
14	301221	光庭信息	168	10,891.44	0.01
15	301177	迪阿股份	132	9,794.40	0.00
16	301236	软通动力	291	9,131.58	0.00
17	301138	华研精机	285	8,763.75	0.00
18	301103	何氏眼科	261	8,357.22	0.00
19	301207	华兰疫苗	138	7,785.96	0.00
20	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
21	301268	铭利达	220	7,671.40	0.00
22	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
23	301102	兆讯传媒	234	7,275.06	0.00
24	301216	万凯新材	243	7,251.12	0.00
25	301258	富士莱	148	6,168.64	0.00
26	300834	星辉环材	195	5,855.85	0.00
27	301219	腾远钴业	65	5,708.30	0.00
28	301110	青木股份	136	5,419.60	0.00
29	301237	和顺科技	118	4,939.48	0.00
30	301109	军信股份	294	4,745.16	0.00
31	301151	冠龙节能	211	4,528.06	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	300750	宁德时代	1,844,235.00	0.55
2	600905	三峡能源	1,197,855.00	0.35
3	000858	五粮液	1,006,313.00	0.30
4	688599	天合光能	761,944.62	0.23
5	002594	比亚迪	710,454.00	0.21
6	000651	格力电器	692,472.00	0.21

7	000568	泸州老窖	655,852.00	0.19
8	002371	北方华创	641,157.00	0.19
9	601006	大秦铁路	602,975.00	0.18
10	601868	中国能建	520,188.00	0.15
11	688396	华润微	475,717.00	0.14
12	300059	东方财富	436,509.00	0.13
13	000001	平安银行	432,602.00	0.13
14	002475	立讯精密	427,493.65	0.13
15	002714	牧原股份	425,184.00	0.13
16	002304	洋河股份	420,788.00	0.12
17	300760	迈瑞医疗	418,233.00	0.12
18	688005	容百科技	395,292.00	0.12
19	002352	顺丰控股	384,050.00	0.11
20	002049	紫光国微	383,530.00	0.11

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	5,470,365.00	1.62
2	000858	五粮液	2,675,820.00	0.79
3	002594	比亚迪	1,781,704.00	0.53
4	000568	泸州老窖	1,561,907.00	0.46
5	002714	牧原股份	1,225,078.00	0.36
6	000001	平安银行	1,188,475.00	0.35
7	002304	洋河股份	1,171,516.00	0.35
8	002475	立讯精密	1,167,466.00	0.35
9	300760	迈瑞医疗	1,123,979.90	0.33
10	300059	东方财富	1,109,200.04	0.33
11	002352	顺丰控股	1,045,736.00	0.31
12	002371	北方华创	1,013,412.00	0.30
13	002142	宁波银行	953,641.00	0.28
14	300122	智飞生物	865,408.00	0.26
15	002812	恩捷股份	841,602.00	0.25
16	300274	阳光电源	813,290.00	0.24
17	000002	万科 A	756,818.00	0.22
18	300015	爱尔眼科	743,776.00	0.22
19	002049	紫光国微	729,906.00	0.22
20	600519	贵州茅台	706,741.00	0.21

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	41,065,279.11
卖出股票收入（成交）总额	80,782,160.69

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

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

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	370,895.82
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	370,895.82

**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**

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	688171	纬德信息	64,234.17	0.03	新股锁定
2	688175	高凌信息	55,113.30	0.03	新股锁定
3	688115	思林杰	52,997.88	0.02	新股锁定
4	301160	翔楼新材	10,846.08	0.00	新股锁定

**§ 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 (%)



274	524,763.34	130,960,455.00	91.08	12,824,700.00	8.92
-----	------------	----------------	-------	---------------	------

### 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	48,520,700.00	33.75

### 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	招商证券股份有限公司	20,112,196.00	13.99
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	16,463,700.00	11.45
3	招商银行股份有限公司—兴证全球安悦稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	12,715,200.00	8.84
4	兴业银行股份有限公司—兴全安泰积极养老目标五年持有期混合型发起式基金中基金（FO）	10,436,300.00	7.26
5	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	4.49
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	3.48
7	华泰证券股份有限公司	4,731,445.00	3.29
8	方正证券股份有限公司	4,203,000.00	2.92
9	李明杰	1,756,500.00	1.22
10	中信证券股份有限公司	1,565,650.00	1.09

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 究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	206,785,155.00
本报告期基金总申购份额	39,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	102,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	143,785,155.00

**§ 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，本基金管理人重大人事变动如下：

2022年2月19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，聘任陈阳先生担任本基金管理人副总经理。

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

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	86,774,386.89	73.59	63,458.34	68.63	-
天风证券	1	20,417,367.95	17.32	19,015.10	20.57	-
国泰君安	1	10,722,524.20	9.09	9,986.11	10.80	-

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	123,726.00	100.00	-	-	-	-
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 2021 年第 4 季度报告	规定网站	2022 年 1 月 24 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 2021 年年度报告	规定网站	2022 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 2022 年第 1 季度报告	规定网站	2022 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招募说明书 (更新) 2022 年第 1 号	规定网站	2022 年 4 月 29 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基金产品资料概要更新	规定网站	2022 年 4 月 29 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	20220101-20220630	85,588,200.00	3,445,500.00	40,513,000.00	48,520,700.00	33.75

## 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。

## 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](http://www.py-axa.com)）查阅，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询基金管理人。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日