浦银中证A500交易型开放式指数证券投资基金
2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：浦银基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2026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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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 6
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 7

§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遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 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遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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等内容的真实、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 净资产变动表 17
6.4 报表附注 18

§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 41
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 54
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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 56
8.3 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 56
§9 开放式基金份额变动 56
§10 重大事件揭示 56
10.1 基金份额持有人大会决议 56
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 57
10.4 基金投资策略的改变 57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 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 59
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 59
§12 备查文件目录 60
12.1 备查文件目录 60
12.2 存放地点 60
12.3 查阅方式 60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	浦银中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 浦银
基金主代码	159376
前端交易代码	159376
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024 年 12 月 30 日
基金管理人	浦银基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	78,922,317.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 1 月 13 日

注：本基金的场内简称自 2026 年 1 月 16 日起由“A500ETF 指数基金”变更为“A500ETF 浦银”，详见本基金管理人于 2026 年 1 月 15 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 场内简称变更的公告》

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	本基金主要采用完全复制法，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。 本基金通过严格的投资流程和量化风险管理手段，在正常情况下，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小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。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。 本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券与可交换债券投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 A500 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、债券型基金和混合型基金。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		浦银基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	薛香	王小飞
	联系电话	021-23212888	021-60637103
	电子邮箱	compliance@spdbfunds.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-33079999 或 400-8828-999	021-60637228
传真		021-23212985	021-60635778
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	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		200127	100033
法定代表人		张健	张金良

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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.spdbfunds.com
基金中期报告置备地点	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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	12,568,356.02
本期利润	14,332,332.83
加权平均基金份额本期利润	0.1776
本期加权平均净值利润率	13.00%
本期基金份额净值增长率	12.33%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	36,480,450.77
期末可供分配基金份额利润	0.4622
期末基金资产净值	115,402,767.77
期末基金份额净值	1.4622
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	46.22%

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

低于所列数字。

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

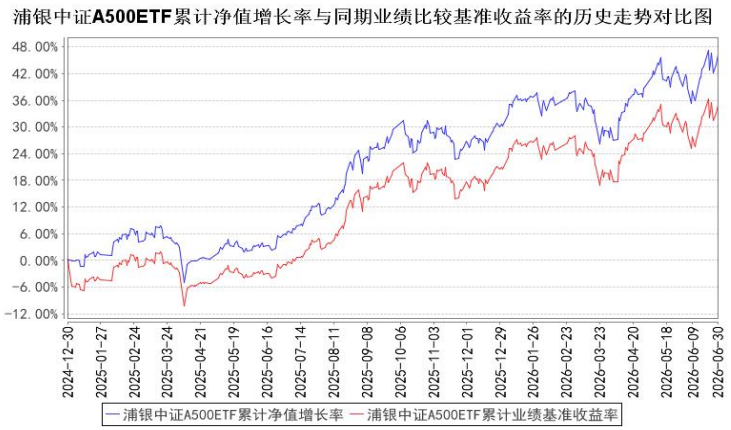
4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	14.66%	1.39%	14.26%	1.41%	0.40%	-0.02%
过去六个月	12.33%	1.27%	11.91%	1.29%	0.42%	-0.02%
过去一年	38.19%	1.14%	36.38%	1.14%	1.81%	0.00%
自基金合同生效起至今	46.22%	1.11%	34.97%	1.13%	11.25%	-0.02%

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



§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

浦银基金管理有限公司（以下简称“浦银基金”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、法国巴黎资产管理控股公司（BNP Paribas Asset Management Holding 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。2026 年 8 月 12 日，基金管理人的名称由“浦银安盛基金管理有限公司”变更为“浦银基金管理有限公司”。

截至 2026 年 6 月 30 日止，浦银基金旗下共管理 124 只基金，即浦银价值成长混合型证券投资基金、浦银优化收益债券型证券投资基金、浦银精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银红利精选混合型证券投资基金、浦银沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银货币市场证券投资基金、浦银稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、浦银战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银 6 个月持有期债券型证券投资基金、浦银消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银日日盈货币市场基金、浦银新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银日日丰货币市场基金、浦银盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银日日鑫货币市场基金、浦银盛达纯债债券型证券投资基金、浦银经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银中短债债券型证券投资基金、浦银普益纯债债券型证券投资基金、浦银盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银全球智能科技股票型证券投资基金（QDII）、浦银双债增强债券型证券投资基金、浦银盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银环保新能源混合型证券投资基金、浦银上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银普丰纯债债券型证券投资基金、浦银盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银先进制造混合型证券投资基金、浦银盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银科技创新优选混合型证券投资基金、浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银价值精选混合型证券投资基金、浦银普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银普天纯债债券型证券投资基金、浦银普庆纯债债券型证券投资基金、浦银睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银科技创新一年持有期混合型证券投资基金、浦银稳健丰利债券型证券投资基金、浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银盛

华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银中证 ESG　120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银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 CFETS　0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银品质优选混合型证券投资基金、浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银兴耀优选一年持有期混合型证券投资基金、浦银中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银普诚纯债债券型证券投资基金、浦银中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银普旭 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银光耀优选混合型证券投资基金、浦银中证证券公司 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、浦银景气优选混合型证券投资基金、浦银普兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银普恒利率债债券型证券投资基金、浦银稳健富利 180 天持有期债券型证券投资基金、浦银悦享 30 天持有期债券型证券投资基金、浦银策略优选混合型证券投资基金、浦银普安利率债债券型证券投资基金、浦银养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、浦银高端装备混合型发起式证券投资基金、浦银中证 A50 指数增强型证券投资基金、浦银上证科创板 100 指数增强型证券投资基金、浦银红利量化选股混合型证券投资基金、浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、浦银中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、浦银周期优选混合型发起式证券投资基金、浦银普航 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银上证科创板综合指数增强型证券投资基金、浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、浦银港股通央企红利混合型证券投资基金、浦银医疗创新混合型发起式证券投资基金、浦银数字经济混合型发起式证券投资基金、浦银国证港股通科技指数型发起式证券投资基金、浦银盈丰多元配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银盈鑫多元配置 90 天持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）、浦银港股通消费混合型发起式证券投资基金、浦银稳健双利债券型证券投资基金、浦银盈福多元配

置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银盈泰多元配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金、浦银半导体产业混合型发起式证券投资基金、浦银产业机遇混合型发起式证券投资基金、浦银稳健鑫利债券型证券投资基金、浦银国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银资源精选混合型发起式证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术基础设施以及有关业务应用系统构成。公司信息技术基础设施包括机房、网络设备、服务器设备、监控设备等，建设有上交所金桥托管机房和办公大楼自建机房，实现本地双活互备。同时在合肥建设有灾备托管机房，实现异地备份，形成了两地三中心的数据中心布局，这些基础设施由公司信息技术部主导并聘请专业的系统集成公司负责实施。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、客户服务系统、信息披露系统、反洗钱系统等，这些系统主要是采购行业内主流的专业系统提供商的成熟产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行相关的系统功能升级。公司的基础设施及业务应用系统建成后均由公司信息技术部负责日常的运维、管理，同时与第三方专业服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持运维服务。此外，公司自研开发团队建成了浦事通数字化办公平台、数字化运营平台、新一代营销服务平台、全面风险管理平台、投研一体化平台，以及基于 CDH 和 Oceanbase 底座的两大数据开发平台，和集 RPA、OCR、NLP、AI 等创新技术为一体的创新研发平台等业务支持应用平台，持续为公司业务赋能。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
宋施怡	本基金的基金经理	2024 年 12 月 30 日	-	12 年	宋施怡女士，中国人民大学金融专业硕士。2013 年 7 月至 2023 年 9 月就职于上海申银万国证券研究所金融工程部，历任助理分析师、分析师、高级分析师、资深高级分析师等职务。2023 年 10 月加盟本公司，现任指数与量化投资部基金经理。2024 年 3 月起担任浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月起担任浦银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。2024 年 12 月起担任浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起担任浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2025 年 7 月起担任浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起担任浦银增长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月起担任浦银上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，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。本报告期内不存在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中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

2026 年上半年，A 股市场整体呈现结构性牛市特征，成长风格显著跑赢价值风格，行业表现极致分化。从主要指数来看，创业板指以 35.58%的涨幅大幅领跑，深证成指上涨 19.82%，而上证指数仅上涨 3.16%。三大指数的表现差异鲜明地反映了上半年市场的核心特征——科技成长股强势领涨，传统蓝筹和周期股表现相对疲弱。代表 A 股核心资产的中证 A500 上涨 11.91%。市场整体交投活跃，上半年日均成交额达到 2.74 万亿元，维持在历史较高水平。宏观经济方面，上半年 GDP 上涨 4.7%，经济保持平稳增长。制造业 PMI 在枯荣线附近徘徊，6 月 PMI 为 50.3%，处于扩张区间。物价方面，CPI 同比温和回升，PPI 受输入性通胀影响同比转正。政策层面，上半年资本市场改革持续推进。4 月 10 日，中国证监会正式发布《关于深化创业板改革 更好服务新质生产力发展的建议》。6 月 17 日，证监会主席吴清在陆家嘴论坛上发表主题演讲，明确资本市场改革方向是服务新质生产力和经济高质量发展。货币政策延续"适度宽松"基调，以结构性工具为主，下调政策利率以促进降低社会综合融资成本。

中证 A500 是更具有代表性的 A 股核心资产指数。在指数编制过程中，中证 A500 指数具有以下特点：（1）充分考虑行业均衡特点，使指数更具有代表性。（2）通过剔除 ESG 评分为 C 级及以下的上市公司，有效降低了公司因不良经营或社会责任缺失而导致的潜在风险。（3）引入互联互通标筛选要素，方便境内外中长期资金配置 A 股核心资产，为指数的国际化打开空间。

在投资策略方面，中证 A500ETF 作为跟踪中证 A500 指数的被动型投资产品，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。报告期内，本基金以获取 A 股市场核心龙头资产的长期收益为宗旨，构建了紧密跟踪标的指数的投资组合，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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银中证 A500ETF 基金份额净值为 1.4622 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.33%；同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为下半年 A 股市场结构性慢牛的格局并未改变，行情特征可能从极致分化转向内部收敛，且波动将会加剧。7-8 月处于业绩与政策的真空期，微观结构拥挤与海外宏观扰动容易放大短期情绪波动。8 月下旬中报披露完毕后，盈利兑现情况将成为检验科技主线的关键，真正具备业绩支撑的科技企业将在分化中脱颖而出。从风险因素来看，美联储政策路径是下半年最大的外部变量。年初市场普遍预期美联储将在 2026 年降息 2 次（9 月和 12 月各 25 个基点），但经过 5 月非农数据超预期、中东地缘冲突推升油价、CPI 反弹等一系列事件后，主流机构已大幅修正预期，年内不降息成为基准情景，甚至有机构开始讨论加息可能性，美联储加息路径的不确定性或使科技股承压。此外，美国 AI 资本开支的可持续性担忧，以及韩国股市剧烈波动的外部情绪传导，均构成扰动因素。

综上，我们认为下半年应均衡配置，需综合考虑盈利与估值匹配的问题。中证 A500 指数均衡配置各行业龙头，在极致分化行情结束的情况下有望表现更佳。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

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。估值委员会由公司基金运营条线分管领导、固定收益/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研部门负责人、基金会计业务骨干一人组成。

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

本基金基金经理可参与估值委员会对于估值原则和方法的讨论，但对估值政策和估值方案无最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求履行基金估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在管理人进行估值调整导致基金资产净值变化达到 0.25%以上时对其采用的估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

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、本报告期内未出现连续二十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形。

§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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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：浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	243,706.66	488,575.57
结算备付金		3,718,728.94	5,059,413.72
存出保证金		-	166,262.40

交易性金融资产	6.4.7.2	112,721,640.82	170,732,064.00
其中：股票投资		112,721,640.82	170,732,064.00
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		1,103,629.07	54,059.69
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		117,787,705.49	176,500,375.38
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		2,292,295.84	3,289,114.38
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		11,124.36	12,855.27
应付托管费		3,708.16	4,285.10
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	78.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	77,809.36	170,852.00
负债合计		2,384,937.72	3,477,185.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	78,922,317.00	132,922,317.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	36,480,450.77	40,100,873.34
净资产合计		115,402,767.77	173,023,190.34

负债和净资产总计		117,787,705.49	176,500,375.38

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4622 元，基金份额总额 78,922,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		14,516,762.84	46,750,963.07
1.利息收入		3,253.09	114,864.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,253.09	53,887.36
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		-	60,977.34
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,376,309.45	32,505,381.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,399,424.14	26,929,272.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	125,635.53	269,984.11
股利收益	6.4.7.19	851,249.78	5,306,125.49
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	1,763,976.81	12,638,684.69
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	373,223.49	1,492,031.87
减：二、营业总支出		184,430.01	694,585.00
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	82,097.16	449,459.97
2．托管费	6.4.10.2.2	27,365.70	149,819.93
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		453.39	975.55
8．其他费用	6.4.7.23	74,513.76	94,329.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,332,332.83	46,056,378.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,332,332.83	46,056,378.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		14,332,332.83	46,056,378.07

6.3 净资产变动表

会计主体：浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	132,922,317.00	40,100,873.34	173,023,190.34
二、本期期初净资产	132,922,317.00	40,100,873.34	173,023,190.34
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-54,000,000.00	-3,620,422.57	-57,620,422.57
（一）、综合收益总额	-	14,332,332.83	14,332,332.83
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-54,000,000.00	-17,952,755.40	-71,952,755.40
其中：1.基金申购款	99,000,000.00	37,742,147.39	136,742,147.39
2.基金赎回款	-153,000,000.00	-55,694,902.79	-208,694,902.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-

四、本期期末净资产	78,922,317.00	36,480,450.77	115,402,767.77
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,506,922,317.00	20,653.64	1,506,942,970.64
二、本期期初净资产	1,506,922,317.00	20,653.64	1,506,942,970.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,104,000,000.00	23,402,296.75	-1,080,597,703.25
（一）、综合收益总额	-	46,056,378.07	46,056,378.07
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,104,000,000.00	-22,654,081.32	-1,126,654,081.32
其中：1.基金申购款	186,000,000.00	7,402,658.47	193,402,658.47
2.基金赎回款	-1,290,000,000.00	-30,056,739.79	-1,320,056,739.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	402,922,317.00	23,422,950.39	426,345,267.39

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：

张弛	喻庆	孙赵辉
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

浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（原名为浦银安盛中证 A500 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[2024]1755 号《关于准予浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批

复》准予注册，由浦银基金管理有限公司（原名为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《浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集，基金合同于 2024 年 12 月 30 日正式生效。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集规模为 1,506,922,317.00 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2025]19 号核准，本基金 1,506,922,317.00 份基金份额于 2025 年 1 月 13 日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股（均含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非标的指数成份股（包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许发行的股票）、存托凭证、债券（国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券（含超短期融资券）、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、货币市场工具以及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相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

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得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注中所列示的中国证监会和基金业协会

发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

6.4.5.1 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

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税

直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

d)本基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	243,706.66
等于：本金	243,678.09
加：应计利息	28.57
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	243,706.66

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		104,879,648.63	-	112,721,640.82	7,841,992.19
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		104,879,648.63	-	112,721,640.82	7,841,992.19

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内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：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

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 2026 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	3,425.60
预提费用	74,383.76
合计	77,809.36

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	132,922,317.00	132,922,317.00
本期申购	99,000,000.00	99,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-153,000,000.00	-153,000,000.00
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	78,922,317.00	78,922,317.00

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：本基金本报告期内无其他综合收益。

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	55,944,532.77	-15,843,659.43	40,100,873.34
本期期初	55,944,532.77	-15,843,659.43	40,100,873.34
本期利润	12,568,356.02	1,763,976.81	14,332,332.83
本期基金份额交易产生的变动数	-23,900,435.62	5,947,680.22	-17,952,755.40
其中：基金申购款	50,033,507.94	-12,291,360.55	37,742,147.39
基金赎回款	-73,933,943.56	18,239,040.77	-55,694,902.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,612,453.17	-8,132,002.40	36,480,450.77

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
活期存款利息收入	568.40
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	2,684.69
其他	-
合计	3,253.09

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 2026年1月1日至2026年6月30日

股票投资收益——买卖股票差价收入	4,514,549.35
股票投资收益——赎回差价收入	6,884,874.79
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	11,399,424.14

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	126,634,498.12
减：卖出股票成本总额	121,997,912.07
减：交易费用	122,036.70
买卖股票差价收入	4,514,549.35

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	208,694,902.79
减：现金支付赎回款总额	108,237,149.79
减：赎回股票成本总额	93,572,878.21
减：交易费用	-
赎回差价收入	6,884,874.79

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	125,635.53

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	851,249.78
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	851,249.78

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	1,786,896.81
股票投资	1,786,896.81
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	-22,920.00
权证投资	-
期货投资	-22,920.00
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	1,763,976.81

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	373,223.49
合计	373,223.49

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	130.00
合计	74,513.76

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于 2026 年 8 月 13 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》，基金管理人的中文法定名称自 2026 年 8 月 12 日起由“浦银安盛基金管理有限公司”变更为“浦银基金管理有限公司”。根据本基金的基金管理人于 2026 年 8 月 13 日发布的《浦银基金管理有限公司关于旗下基金名称变更的公告》，本基金的基金名称自 2026 年 8 月 13 日起由“浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金”变更为“浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金”。

6.4.9 关联方、关联关系

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

根据本基金的基金管理人于 2026 年 1 月 29 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于公司股东变更的公告》，根据基金管理人 2025 年度第五次股东会会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2026]177 号文核准，基金管理人原股东法国安盛投资管理公司（AXA Investment Managers S.A.）被法国巴黎资产管理控股公司（BNP Paribas Asset Management Holding S.A.）吸收合并。因此，法国巴黎资产管理控股公司（BNP Paribas Asset Management Holding S.A.）成为基金管理人股东，持有基金管理人 39%股权。

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
浦银基金管理有限公司（“浦银基金”）	基金管理人
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	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
浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	82,097.16	449,459.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,210.08	63,011.98
应支付基金管理人的净管理费	73,887.08	386,447.99

注：支付基金管理人浦银基金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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	27,365.70	149,819.93

注：支付基金托管人中国建设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均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：基金管理人在本报告期与上年度可比期间均未持有本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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（%）
浦银中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	17,025,100.00	21.57	17,251,700.00	12.98

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025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
中国建设银行-活期	243,706.66	568.40	815,301.42	18,087.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，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

于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 46,300 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 462,724.36 元，估值总额为人民币 398,643.00 元，占基金净资产的比例为 0.35%（于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 79,500 股浦发银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 945,009.68 元，估值总额为人民币 988,980.00 元，占基金净资产的比例为 0.57%）。

除前述事项外，本基金本报告期内及上年度可比期间均无需作说明的其他关联交易事项。

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（2026 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
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	39	1,092.00	1,083.42	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	30	1,136.40	1,046.10	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	61	3,412.95	3,483.10	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 07 月 13 日	890.99	477	123,392.91	396,864.00	-

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：于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间市场债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有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、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

本基金的投资范围主要为标的指数成份股和备选成份股(均含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非标的指数成份股(包含主板、创业板、科创板及其他经中国证监会允许发行的股票)、存托凭证、债券(国债、央行票据、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、可交换债券、可分离交易可转债、短期融资券(含超短期融资券)、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权等)、货币市场工具以及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相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，本基金可将其纳入投资范围，其投资原则及投资比例按法律法规或监管机构的相关规定执行。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得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行法定程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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、风险管理委员会、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、审计委员会、合规风控委员会、督察长和内部审计。董事会对风险管理负最终责任。

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

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

本基金管理人要求所有员工应自觉接受并配合董事会、及下设的审计委员会、合规风控委员会、督察长和审计部对各项业务和工作行为的检查监督，坚决执行公司规定的风险控制措施，以及采纳合理的风险分析和管理建议。

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建设银行股份有限公司，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 2026 年 6 月 30 日，本基金无债券和资产支持证券投资(2025 年 12 月 31 日：同)。

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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2026 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(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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司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 2026 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 2026 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、结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	243,706.66	-	-	-	243,706.66
结算备付金	3,718,728.94	-	-	-	3,718,728.94
交易性金融资产	-	-	-	112,721,640.82	112,721,640.82
应收清算款	-	-	-	1,103,629.07	1,103,629.07
资产总计	3,962,435.60	-	-	113,825,269.89	117,787,705.49
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	11,124.36	11,124.36
应付托管费	-	-	-	3,708.16	3,708.16
应付清算款	-	-	-	2,292,295.84	2,292,295.84
其他负债	-	-	-	77,809.36	77,809.36
负债总计	-	-	-	2,384,937.72	2,384,937.72
利率敏感度缺口	3,962,435.60	-	-	111,440,332.17	115,402,767.77
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	488,575.57	-	-	-	488,575.57
结算备付金	5,059,413.72	-	-	-	5,059,413.72
存出保证金	166,262.40	-	-	-	166,262.40
交易性金融资产	-	-	-	170,732,064.00	170,732,064.00
应收清算款	-	-	-	54,059.69	54,059.69
资产总计	5,714,251.69	-	-	170,786,123.69	176,500,375.38
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	12,855.27	12,855.27
应付托管费	-	-	-	4,285.10	4,285.10
应付清算款	-	-	-	3,289,114.38	3,289,114.38
应交税费	-	-	-	78.29	78.29
其他负债	-	-	-	170,852.00	170,852.00
负债总计	-	-	-	3,477,185.04	3,477,185.04
利率敏感度缺口	5,714,251.69	-	-	167,308,938.65	173,023,190.34

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 2026 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(2025 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(2025 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，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，跟踪中证 A500 指数，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金股票组合根据所跟踪的标的指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。

本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 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、国债期货、股票期权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。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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	112,721,640.82	97.68	170,732,064.00	98.68
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	112,721,640.82	97.68	170,732,064.00	98.68

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	
分析	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

	动	本期末 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准上升 500 基点	5,549,327.18	8,329,721.69
	业绩比较基准下降 500 基点	-5,549,327.18	-8,329,721.69

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	112,319,164.20	170,033,382.12
第二层次	396,864.00	629,419.52
第三层次	5,612.62	69,262.36
合计	112,721,640.82	170,732,064.00

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具（2025 年 12 月 31 日：无）。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的

金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§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	112,721,640.82	95.70
	其中：股票	112,721,640.82	95.70
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	3,962,435.60	3.36
8	其他各项资产	1,103,629.07	0.94
9	合计	117,787,705.49	100.00

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

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	366,818.00	0.32
B	采矿业	4,735,515.00	4.10
C	制造业	79,626,830.59	69.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,508,445.00	2.17
E	建筑业	1,397,580.00	1.21
F	批发和零售业	928,045.00	0.80
G	交通运输、仓储和邮政业	2,556,451.00	2.22
H	住宿和餐饮业	58,590.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,864,624.41	5.08
J	金融业	11,094,222.00	9.61

K	房地产业	641,519.00	0.56
L	租赁和商务服务业	814,825.60	0.71
M	科学研究和技术服务业	1,347,296.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	201,781.60	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,980.00	0.03
Q	卫生和社会工作	233,413.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	88,514.00	0.08
S	综合	212,088.00	0.18
	合计	112,714,538.20	97.67

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	4,529.20	0.00
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	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,083.42	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	5,612.62	0.00

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	300308	中际旭创	3,600	4,572,000.00	3.96
2	300750	宁德时代	9,500	3,733,595.00	3.24
3	300502	新易盛	4,888	2,967,016.00	2.57
4	600519	贵州茅台	2,200	2,608,078.00	2.26
5	603986	兆易创新	2,400	1,956,000.00	1.69
6	601318	中国平安	36,800	1,756,832.00	1.52
7	002371	北方华创	1,750	1,547,980.00	1.34
8	600036	招商银行	42,600	1,512,300.00	1.31
9	688256	寒武纪	918	1,464,714.90	1.27
10	601899	紫金矿业	57,100	1,435,494.00	1.24
11	688041	海光信息	3,545	1,312,713.50	1.14
12	688008	澜起科技	4,060	1,258,194.00	1.09
13	000333	美的集团	16,600	1,253,798.00	1.09
14	002475	立讯精密	16,400	1,154,560.00	1.00
15	002384	东山精密	4,400	1,154,340.00	1.00
16	688981	中芯国际	7,152	1,135,880.64	0.98
17	600900	长江电力	42,200	1,117,034.00	0.97
18	000725	京东方 A	125,700	1,091,076.00	0.95
19	603259	药明康德	8,400	1,045,884.00	0.91
20	688012	中微公司	2,210	1,035,385.00	0.90
21	600030	中信证券	33,800	971,074.00	0.84
22	601166	兴业银行	58,400	967,104.00	0.84
23	300059	东方财富	43,900	894,682.00	0.78
24	600183	生益科技	5,100	884,340.00	0.77
25	300274	阳光电源	5,100	811,002.00	0.70
26	600276	恒瑞医药	15,500	806,620.00	0.70
27	300408	三环集团	4,800	801,120.00	0.69
28	601398	工商银行	112,100	792,547.00	0.69
29	600487	亨通光电	7,000	765,380.00	0.66
30	002594	比亚迪	9,600	765,120.00	0.66
31	300394	天孚通信	2,364	715,535.52	0.62
32	601211	国泰海通	39,100	711,620.00	0.62
33	002463	沪电股份	4,600	702,880.00	0.61
34	300476	胜宏科技	2,000	692,860.00	0.60

35	601288	农业银行	99,400	603,358.00	0.52
36	600176	中国巨石	8,200	597,616.00	0.52
37	601328	交通银行	92,200	592,846.00	0.51
38	600522	中天科技	9,600	582,528.00	0.50
39	000651	格力电器	15,500	581,250.00	0.50
40	000988	华工科技	3,100	572,291.00	0.50
41	688498	源杰科技	300	565,800.00	0.49
42	603019	中科曙光	5,100	546,873.00	0.47
43	300604	长川科技	1,600	546,272.00	0.47
44	688525	佰维存储	1,100	544,203.00	0.47
45	603993	洛阳钼业	30,400	533,520.00	0.46
46	600150	中国船舶	15,641	528,509.39	0.46
47	600887	伊利股份	21,700	519,932.00	0.45
48	600584	长电科技	5,000	517,750.00	0.45
49	000858	五 粮 液	6,900	510,600.00	0.44
50	000338	潍柴动力	18,500	504,125.00	0.44
51	301308	江波龙	700	492,660.00	0.43
52	300857	协创数据	1,400	475,860.00	0.41
53	688521	芯原股份	1,245	462,069.30	0.40
54	601816	京沪高铁	101,700	460,701.00	0.40
55	300124	汇川技术	6,800	451,044.00	0.39
56	002281	光迅科技	1,700	436,798.00	0.38
57	600309	万华化学	6,200	424,142.00	0.37
58	002008	大族激光	2,800	420,308.00	0.36
59	600111	北方稀土	8,600	413,230.00	0.36
60	002415	海康威视	11,800	403,560.00	0.35
61	600000	浦发银行	46,300	398,643.00	0.35
62	300223	君正股份	1,600	398,240.00	0.35
63	688072	拓荆科技	477	396,864.00	0.34
64	600089	特变电工	17,600	396,000.00	0.34
65	300475	香农芯创	1,300	390,000.00	0.34
66	601857	中国石油	44,700	387,996.00	0.34
67	000063	中兴通讯	10,600	383,614.00	0.33
68	002028	思源电气	2,200	380,600.00	0.33
69	601088	中国神华	9,700	378,688.00	0.33
70	688120	华海清科	1,169	376,628.42	0.33
71	688347	华虹宏力	1,100	369,930.00	0.32
72	300136	信维通信	3,100	369,675.00	0.32
73	300433	蓝思科技	6,800	364,888.00	0.32
74	600031	三一重工	20,600	355,968.00	0.31
75	000100	TCL 科技	61,100	355,602.00	0.31
76	601601	中国太保	12,100	345,092.00	0.30
77	300014	亿纬锂能	5,300	344,659.00	0.30

78	002916	深南电路	740	338,846.00	0.29
79	000001	平安银行	33,700	338,685.00	0.29
80	002714	牧原股份	9,600	335,904.00	0.29
81	002353	杰瑞股份	2,200	335,500.00	0.29
82	002156	通富微电	4,400	333,828.00	0.29
83	000792	盐湖股份	10,900	329,071.00	0.29
84	002050	三花智控	7,500	328,725.00	0.28
85	600406	国电南瑞	13,700	313,045.00	0.27
86	601668	中国建筑	71,300	309,442.00	0.27
87	600549	厦门钨业	3,600	306,720.00	0.27
88	300760	迈瑞医疗	2,200	298,826.00	0.26
89	002602	世纪华通	20,500	289,050.00	0.25
90	000657	中钨高新	3,000	287,160.00	0.25
91	601919	中远海控	21,600	286,416.00	0.25
92	002436	兴森科技	5,600	285,320.00	0.25
93	601988	中国银行	49,500	283,140.00	0.25
94	002230	科大讯飞	6,900	281,796.00	0.24
95	601728	中国电信	54,100	280,779.00	0.24
96	600660	福耀玻璃	5,500	277,420.00	0.24
97	300054	鼎龙股份	2,600	275,522.00	0.24
98	603501	豪威集团	2,900	275,065.00	0.24
99	601012	隆基绿能	20,900	274,208.00	0.24
100	601225	陕西煤业	13,400	272,690.00	0.24
101	600690	海尔智家	13,000	265,330.00	0.23
102	002460	赣锋锂业	4,000	261,600.00	0.23
103	600941	中国移动	3,000	258,390.00	0.22
104	601985	中国核电	28,600	258,258.00	0.22
105	002352	顺丰控股	8,200	256,332.00	0.22
106	600160	巨化股份	4,800	254,448.00	0.22
107	603799	华友钴业	5,200	250,952.00	0.22
108	002851	麦格米特	1,500	250,770.00	0.22
109	002709	天赐材料	4,800	246,864.00	0.21
110	002938	鹏鼎控股	2,300	242,374.00	0.21
111	000425	徐工机械	28,500	230,565.00	0.20
112	600460	士兰微	4,200	229,572.00	0.20
113	300661	圣邦股份	1,590	228,133.20	0.20
114	688126	沪硅产业	5,662	225,857.18	0.20
115	601600	中国铝业	27,300	224,406.00	0.19
116	600028	中国石化	50,300	224,338.00	0.19
117	300442	润泽科技	2,700	224,289.00	0.19
118	000977	浪潮信息	3,200	224,000.00	0.19
119	600938	中国海油	8,200	222,630.00	0.19
120	601766	中国中车	42,000	218,400.00	0.19

121	600050	中国联通	54,200	216,800.00	0.19
122	002080	中材科技	2,400	216,000.00	0.19
123	601100	恒立液压	2,000	215,120.00	0.19
124	300033	同花顺	880	212,080.00	0.18
125	002185	华天科技	9,500	211,945.00	0.18
126	300346	南大光电	2,280	211,242.00	0.18
127	000938	紫光股份	7,300	210,678.00	0.18
128	605117	德业股份	1,956	207,688.08	0.18
129	688777	中控技术	1,741	204,567.50	0.18
130	002049	紫光国微	2,300	204,125.00	0.18
131	002179	中航光电	4,400	203,280.00	0.18
132	002600	领益智造	11,700	202,878.00	0.18
133	002466	天齐锂业	3,300	202,356.00	0.18
134	000568	泸州老窖	2,600	201,552.00	0.17
135	601628	中国人寿	5,700	201,495.00	0.17
136	300395	菲利华	1,500	200,595.00	0.17
137	002837	英维克	2,510	199,695.60	0.17
138	002138	顺络电子	2,700	197,370.00	0.17
139	601872	招商轮船	11,000	193,270.00	0.17
140	600879	航天电子	9,000	191,610.00	0.17
141	601006	大秦铁路	41,400	190,854.00	0.17
142	601658	邮储银行	38,400	189,312.00	0.16
143	002241	歌尔股份	8,400	189,252.00	0.16
144	603288	海天味业	5,700	189,012.00	0.16
145	000408	藏格矿业	2,700	187,164.00	0.16
146	688469	芯联集成	17,600	186,736.00	0.16
147	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.16
148	002202	金风科技	7,700	184,030.00	0.16
149	600905	三峡能源	49,500	183,645.00	0.16
150	600489	中金黄金	10,100	182,305.00	0.16
151	600118	中国卫星	2,200	180,510.00	0.16
152	600893	航发动力	4,700	180,198.00	0.16
153	000630	铜陵有色	28,000	178,080.00	0.15
154	300390	天华新能	1,900	177,669.00	0.15
155	300037	新宙邦	1,900	176,415.00	0.15
156	002625	光启技术	5,800	175,856.00	0.15
157	600010	包钢股份	78,400	174,832.00	0.15
158	600673	东阳光	5,200	174,616.00	0.15
159	600760	中航沈飞	4,200	172,620.00	0.15
160	601888	中国中免	3,200	171,872.00	0.15
161	601127	赛力斯	2,800	171,500.00	0.15
162	002027	分众传媒	34,700	167,948.00	0.15
163	300058	蓝色光标	12,060	165,945.60	0.14

164	600019	宝钢股份	30,300	164,529.00	0.14
165	601689	拓普集团	2,900	163,618.00	0.14
166	688002	睿创微纳	1,045	161,651.05	0.14
167	000807	云铝股份	7,300	161,622.00	0.14
168	300567	精测电子	500	158,800.00	0.14
169	000426	兴业银锡	4,800	158,208.00	0.14
170	600989	宝丰能源	7,700	156,541.00	0.14
171	002407	多氟多	3,100	155,713.00	0.13
172	601168	西部矿业	5,700	154,698.00	0.13
173	600104	上汽集团	15,800	154,208.00	0.13
174	600885	宏发股份	4,460	153,825.40	0.13
175	300782	卓胜微	1,400	153,412.00	0.13
176	605589	圣泉集团	2,400	152,568.00	0.13
177	600875	东方电气	5,300	152,481.00	0.13
178	688017	绿的谐波	363	151,683.18	0.13
179	601727	上海电气	21,600	151,200.00	0.13
180	002001	新 和 成	5,300	150,626.00	0.13
181	600988	赤峰黄金	5,700	150,024.00	0.13
182	601390	中国中铁	35,700	148,869.00	0.13
183	600667	太极实业	5,100	148,818.00	0.13
184	600362	江西铜业	3,400	147,220.00	0.13
185	688396	华润微	1,496	145,934.80	0.13
186	600392	盛和资源	4,900	145,873.00	0.13
187	002126	银轮股份	2,900	144,420.00	0.13
188	600795	国电电力	30,900	144,303.00	0.13
189	000538	云南白药	3,000	142,110.00	0.12
190	002738	中矿资源	2,400	141,576.00	0.12
191	300751	迈为股份	500	141,230.00	0.12
192	000960	锡业股份	3,300	140,877.00	0.12
193	600547	山东黄金	6,100	140,849.00	0.12
194	600096	云天化	4,600	139,840.00	0.12
195	688111	金山办公	655	139,547.75	0.12
196	600418	江淮汽车	5,400	139,482.00	0.12
197	601669	中国电建	29,600	139,120.00	0.12
198	600585	海螺水泥	8,200	138,990.00	0.12
199	688271	联影医疗	1,373	138,988.79	0.12
200	000831	中国稀土	2,500	138,725.00	0.12
201	002422	科伦药业	3,600	138,672.00	0.12
202	300450	先导智能	3,400	138,448.00	0.12
203	002273	水晶光电	3,900	138,372.00	0.12
204	600482	中国动力	4,200	137,760.00	0.12
205	300803	指南针	1,500	137,505.00	0.12
206	301358	湖南裕能	1,800	136,566.00	0.12

207	002648	卫星化学	5,700	133,893.00	0.12
208	002129	TCL 中环	11,000	132,220.00	0.11
209	300015	爱尔眼科	16,000	132,160.00	0.11
210	600141	兴发集团	2,800	131,516.00	0.11
211	000066	中国长城	6,900	131,445.00	0.11
212	600346	恒力石化	7,400	131,054.00	0.11
213	002195	岩山科技	19,900	130,146.00	0.11
214	601179	中国西电	8,700	129,804.00	0.11
215	002558	巨人网络	4,700	129,532.00	0.11
216	601868	中国能建	48,100	128,427.00	0.11
217	600497	驰宏锌锗	10,500	127,155.00	0.11
218	002812	恩捷股份	1,900	127,129.00	0.11
219	600066	宇通客车	4,700	126,007.00	0.11
220	000625	长安汽车	17,400	124,758.00	0.11
221	300438	鹏辉能源	1,500	124,275.00	0.11
222	600157	永泰能源	75,800	122,038.00	0.11
223	600426	华鲁恒升	5,100	121,992.00	0.11
224	000157	中联重科	17,500	121,975.00	0.11
225	300418	昆仑万维	3,000	121,080.00	0.10
226	300316	晶盛机电	2,000	120,800.00	0.10
227	600221	海航控股	89,200	120,420.00	0.10
228	600580	卧龙电驱	3,600	119,160.00	0.10
229	002532	天山铝业	11,100	119,103.00	0.10
230	002340	格林美	17,800	117,658.00	0.10
231	600711	盛屯矿业	10,700	117,379.00	0.10
232	688099	晶晨股份	1,136	116,894.40	0.10
233	600438	通威股份	9,600	116,256.00	0.10
234	600011	华能国际	15,300	116,127.00	0.10
235	600143	金发科技	7,500	115,875.00	0.10
236	600895	张江高科	3,100	115,475.00	0.10
237	002236	大华股份	7,000	115,430.00	0.10
238	000933	神火股份	5,400	114,480.00	0.10
239	600048	保利发展	24,700	114,361.00	0.10
240	002493	荣盛石化	10,400	111,800.00	0.10
241	600115	中国东航	29,300	111,633.00	0.10
242	002131	利欧股份	23,500	111,625.00	0.10
243	300017	网宿科技	8,500	110,585.00	0.10
244	600570	恒生电子	5,200	110,188.00	0.10
245	600886	国投电力	8,200	109,142.00	0.09
246	601233	桐昆股份	5,000	108,250.00	0.09
247	002456	欧菲光	11,400	107,844.00	0.09
248	000301	东方盛虹	9,400	107,630.00	0.09
249	601360	三六零	12,300	106,887.00	0.09

250	600352	浙江龙盛	8,800	106,568.00	0.09
251	003816	中国广核	27,000	105,570.00	0.09
252	600009	上海机场	4,500	103,950.00	0.09
253	600196	复星医药	4,600	103,362.00	0.09
254	601058	赛轮轮胎	8,900	102,617.00	0.09
255	600026	中远海能	5,700	102,258.00	0.09
256	002555	三七互娱	5,400	101,898.00	0.09
257	603659	璞泰来	3,500	101,255.00	0.09
258	000768	中航西飞	4,900	100,352.00	0.09
259	002595	豪迈科技	2,140	99,724.00	0.09
260	688506	百利天恒	339	99,676.17	0.09
261	002128	电投能源	4,300	99,416.00	0.09
262	002432	九安医疗	1,400	98,952.00	0.09
263	605499	东鹏饮料	801	98,867.43	0.09
264	600415	小商品城	9,700	98,552.00	0.09
265	300759	康龙化成	3,400	98,362.00	0.09
266	300001	特锐德	2,600	98,358.00	0.09
267	600674	川投能源	6,900	97,773.00	0.08
268	002821	凯莱英	600	97,200.00	0.08
269	688036	传音控股	1,647	97,090.65	0.08
270	000975	山金国际	5,700	96,900.00	0.08
271	300207	欣旺达	5,100	96,849.00	0.08
272	601111	中国国航	16,000	96,800.00	0.08
273	600029	南方航空	18,600	96,348.00	0.08
274	002074	国轩高科	3,500	96,285.00	0.08
275	300339	润和软件	2,500	96,275.00	0.08
276	300347	泰格医药	2,000	96,000.00	0.08
277	002472	双环传动	2,300	95,473.00	0.08
278	600219	南山铝业	23,700	94,563.00	0.08
279	603979	金诚信	1,600	94,448.00	0.08
280	002517	恺英网络	5,800	94,250.00	0.08
281	601186	中国铁建	15,800	94,010.00	0.08
282	002601	龙佰集团	5,700	93,936.00	0.08
283	601117	中国化学	12,700	93,345.00	0.08
284	000661	长春高新	1,400	93,240.00	0.08
285	600233	圆通速递	5,800	91,350.00	0.08
286	300458	全志科技	2,300	90,758.00	0.08
287	002465	海格通信	7,100	90,667.00	0.08
288	300568	星源材质	4,800	89,856.00	0.08
289	300115	长盈精密	3,200	89,408.00	0.08
290	600839	四川长虹	12,800	89,344.00	0.08
291	301236	软通动力	2,100	89,145.00	0.08
292	600372	中航机载	8,200	88,970.00	0.08

293	000547	航天发展	4,600	88,090.00	0.08
294	601877	正泰电器	3,500	87,745.00	0.08
295	688047	龙芯中科	567	87,697.89	0.08
296	600436	片仔癀	800	87,424.00	0.08
297	601021	春秋航空	1,900	86,602.00	0.08
298	002155	湖南黄金	3,600	85,932.00	0.07
299	002497	雅化集团	4,200	85,554.00	0.07
300	002130	沃尔核材	4,500	85,320.00	0.07
301	603087	甘李药业	1,500	85,140.00	0.07
302	000733	振华科技	1,500	84,960.00	0.07
302	002756	永兴材料	1,500	84,960.00	0.07
303	000963	华东医药	3,000	84,360.00	0.07
304	600741	华域汽车	5,400	83,808.00	0.07
305	300024	机器人	4,300	83,119.00	0.07
306	000423	东阿阿胶	1,800	81,648.00	0.07
307	001979	招商蛇口	12,600	81,018.00	0.07
308	000878	云南铜业	5,100	80,988.00	0.07
309	002271	东方雨虹	6,800	80,716.00	0.07
310	300496	中科创达	1,300	80,327.00	0.07
311	688213	思特威	748	80,088.36	0.07
312	300012	华测检测	5,700	79,002.00	0.07
313	688122	西部超导	1,238	77,758.78	0.07
314	002444	巨星科技	2,500	77,750.00	0.07
315	688578	艾力斯	710	77,532.00	0.07
316	000034	神州数码	2,780	77,145.00	0.07
317	002414	高德红外	5,800	76,908.00	0.07
318	300073	当升科技	1,600	76,864.00	0.07
319	603129	春风动力	300	76,740.00	0.07
320	603606	东方电缆	1,840	76,378.40	0.07
321	601677	明泰铝业	4,500	74,700.00	0.06
322	300919	中伟新材	1,700	74,375.00	0.06
323	601319	中国人保	11,000	74,360.00	0.06
324	300748	金力永磁	2,400	74,040.00	0.06
325	300083	创世纪	5,400	73,548.00	0.06
326	300474	景嘉微	1,200	72,576.00	0.06
327	603260	合盛硅业	1,500	72,390.00	0.06
328	688235	百济神州	282	71,800.02	0.06
329	300142	沃森生物	5,500	71,445.00	0.06
330	601800	中国交建	12,500	71,375.00	0.06
331	002078	太阳纸业	5,700	71,193.00	0.06
332	600226	亨通股份	7,400	70,966.00	0.06
333	601615	明阳智能	6,100	70,577.00	0.06
334	300677	英科医疗	1,800	70,506.00	0.06

335	000002	万　　科A	23,600	69,856.00	0.06
336	600699	均胜电子	3,200	69,152.00	0.06
337	002252	上海莱士	15,900	69,006.00	0.06
338	688599	天合光能	4,883	68,947.96	0.06
339	600039	四川路桥	8,800	68,816.00	0.06
340	603650	彤程新材	700	68,586.00	0.06
341	300432	富临精工	3,400	68,306.00	0.06
342	601633	长城汽车	4,500	67,905.00	0.06
343	688676	金盘科技	800	67,712.00	0.06
344	002831	裕同科技	1,900	67,564.00	0.06
345	002064	华峰化学	7,100	67,379.00	0.06
346	300454	深信服	700	67,340.00	0.06
347	300832	新产业	1,600	67,200.00	0.06
348	688223	晶科能源	14,049	66,732.75	0.06
349	600588	用友网络	7,200	66,096.00	0.06
350	001965	招商公路	7,200	65,952.00	0.06
351	002920	德赛西威	800	65,200.00	0.06
352	688331	荣昌生物	500	65,130.00	0.06
353	688617	惠泰医疗	358	64,998.48	0.06
354	002294	信立泰	2,000	63,780.00	0.06
355	300763	锦浪科技	700	63,245.00	0.05
356	605090	九丰能源	1,700	63,189.00	0.05
357	300866	安克创新	600	62,700.00	0.05
358	600516	方大炭素	10,000	61,700.00	0.05
359	000786	北新建材	3,400	61,506.00	0.05
360	688266	泽璟制药	524	61,129.84	0.05
361	300342	天银机电	1,300	61,100.00	0.05
362	002025	航天电器	800	60,976.00	0.05
363	600177	雅戈尔	8,000	60,240.00	0.05
364	300699	光威复材	2,100	60,165.00	0.05
365	601618	中国中冶	24,600	60,024.00	0.05
366	000519	中兵红箭	2,800	58,996.00	0.05
367	002176	江特电机	5,800	58,058.00	0.05
368	600499	科达制造	4,200	57,960.00	0.05
369	002085	万丰奥威	5,200	57,668.00	0.05
370	002318	久立特材	2,400	57,360.00	0.05
371	603806	福斯特	3,400	57,086.00	0.05
372	000623	吉林敖东	3,200	56,736.00	0.05
373	002459	晶澳科技	7,000	56,700.00	0.05
374	300251	光线传媒	5,100	56,559.00	0.05
375	603596	伯特利	2,276	56,535.84	0.05
376	300724	捷佳伟创	800	56,480.00	0.05
377	002223	鱼跃医疗	2,200	56,452.00	0.05

378	000617	中油资本	8,500	56,015.00	0.05
379	002065	东华软件	7,800	55,692.00	0.05
380	688169	石头科技	586	55,652.42	0.05
381	600085	同仁堂	2,400	55,464.00	0.05
382	601607	上海医药	3,600	55,440.00	0.05
383	688472	阿特斯	5,100	55,182.00	0.05
384	000032	深桑达A	2,200	54,890.00	0.05
385	600515	海南机场	20,000	54,800.00	0.05
386	300003	乐普医疗	4,600	54,510.00	0.05
387	000400	许继电气	2,500	54,250.00	0.05
388	002266	浙富控股	10,700	54,142.00	0.05
389	002044	美年健康	10,700	53,821.00	0.05
390	603766	隆鑫通用	4,400	52,492.00	0.05
391	002405	四维图新	8,100	52,407.00	0.05
392	000999	华润三九	2,330	52,401.70	0.05
393	600862	中航高科	2,900	52,287.00	0.05
394	688390	固德威	481	52,193.31	0.05
395	600323	瀚蓝环境	1,900	52,174.00	0.05
396	000415	渤海租赁	12,800	52,096.00	0.05
397	300972	万辰集团	300	52,023.00	0.05
398	300409	道氏技术	2,600	51,818.00	0.04
399	688180	君实生物	1,515	51,237.30	0.04
400	601216	君正集团	11,400	50,844.00	0.04
401	000683	博源化工	8,800	50,688.00	0.04
402	600704	物产中大	10,700	50,504.00	0.04
403	000830	鲁西化工	4,200	50,400.00	0.04
404	300122	智飞生物	4,300	50,267.00	0.04
405	600332	白云山	2,500	50,100.00	0.04
406	600018	上港集团	10,500	49,560.00	0.04
407	000039	中集集团	6,100	49,471.00	0.04
408	600312	平高电气	2,800	49,448.00	0.04
409	688608	恒玄科技	294	49,153.86	0.04
410	600803	新奥股份	3,100	48,980.00	0.04
411	600521	华海药业	3,400	48,960.00	0.04
412	688065	凯赛生物	1,016	48,615.60	0.04
413	000967	盈峰环境	4,600	48,438.00	0.04
414	000887	中鼎股份	2,700	48,303.00	0.04
415	600316	洪都航空	1,700	47,498.00	0.04
416	600763	通策医疗	1,400	47,432.00	0.04
417	600166	福田汽车	16,200	47,142.00	0.04
418	600153	建发股份	5,900	46,787.00	0.04
419	302132	中航成飞	800	46,656.00	0.04
420	600765	中航重机	3,600	46,512.00	0.04

421	301550	斯菱智驱	500	45,715.00	0.04
422	002410	广联达	5,600	45,696.00	0.04
423	300558	贝达药业	700	45,549.00	0.04
424	600529	山东药玻	2,400	44,280.00	0.04
425	002007	华兰生物	3,600	43,884.00	0.04
426	600398	海澜之家	8,300	43,409.00	0.04
427	603568	伟明环保	2,820	43,371.60	0.04
428	603392	万泰生物	1,600	43,152.00	0.04
429	002389	航天彩虹	2,400	42,648.00	0.04
430	688005	容百科技	1,392	42,595.20	0.04
431	603816	顾家家居	1,900	42,484.00	0.04
432	601000	唐山港	10,200	42,330.00	0.04
433	688188	柏楚电子	396	42,253.20	0.04
434	601018	宁波港	13,400	42,210.00	0.04
435	600208	衢州发展	14,900	42,167.00	0.04
436	000738	航发控制	2,300	42,067.00	0.04
437	002603	以岭药业	2,800	42,000.00	0.04
438	000932	华菱钢铁	12,100	41,987.00	0.04
439	603605	珀莱雅	700	41,944.00	0.04
440	600008	首创环保	15,400	41,888.00	0.04
441	300100	双林股份	1,500	41,670.00	0.04
442	600511	国药股份	1,600	41,664.00	0.04
443	688009	中国通号	8,719	41,502.44	0.04
444	600170	上海建工	18,400	40,848.00	0.04
445	600038	中直股份	1,600	40,464.00	0.04
446	600998	九州通	8,600	40,334.00	0.03
447	600820	隧道股份	7,600	39,596.00	0.03
448	603939	益丰药房	2,200	39,556.00	0.03
449	601238	广汽集团	7,600	38,608.00	0.03
450	600161	天坛生物	3,300	38,214.00	0.03
451	002607	中公教育	21,100	37,980.00	0.03
452	000833	粤桂股份	1,600	37,472.00	0.03
453	300118	东方日升	3,000	37,350.00	0.03
453	601567	三星电气	2,500	37,350.00	0.03
454	603885	吉祥航空	3,600	37,044.00	0.03
455	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.03
456	688114	华大智造	706	36,062.48	0.03
457	600486	扬农化工	700	35,490.00	0.03
458	601880	辽港股份	25,700	35,466.00	0.03
459	300896	爱美客	400	34,880.00	0.03
460	600535	天士力	2,600	34,398.00	0.03
461	688116	天奈科技	900	34,380.00	0.03
462	002244	滨江集团	4,500	34,200.00	0.03

463	300457	赢合科技	1,600	33,728.00	0.03
464	002544	普天科技	1,800	32,796.00	0.03
465	600816	建元信托	13,400	32,696.00	0.03
466	002120	韵达股份	5,100	32,436.00	0.03
467	600754	锦江酒店	1,800	32,382.00	0.03
468	300144	宋城演艺	5,500	31,955.00	0.03
469	600064	南京高科	4,400	31,372.00	0.03
470	688303	大全能源	1,777	30,973.11	0.03
471	603899	晨光股份	1,500	30,945.00	0.03
472	000998	隆平高科	4,100	30,914.00	0.03
473	601155	新城控股	3,000	30,780.00	0.03
474	603486	科沃斯	600	30,450.00	0.03
475	601866	中远海发	13,500	29,835.00	0.03
476	300573	兴齐眼药	728	29,673.28	0.03
477	600635	大众公用	6,900	29,532.00	0.03
478	600655	豫园股份	7,000	28,770.00	0.02
479	300676	华大基因	800	28,048.00	0.02
480	688166	博瑞医药	798	27,937.98	0.02
481	000035	中国天楹	5,700	27,531.00	0.02
482	300049	福瑞医科	700	27,216.00	0.02
482	300601	康泰生物	2,400	27,216.00	0.02
483	600663	陆家嘴	4,300	27,004.00	0.02
484	600258	首旅酒店	2,400	26,208.00	0.02
485	688063	派能科技	485	25,835.95	0.02
486	600859	王府井	2,700	24,786.00	0.02
487	600004	白云机场	3,400	24,684.00	0.02
488	300070	碧水源	7,700	24,563.00	0.02
489	002091	江苏国泰	3,300	23,859.00	0.02
490	600864	哈投股份	4,400	22,836.00	0.02
491	000069	华侨城 A	13,700	22,468.00	0.02
492	301078	孩子王	2,900	19,604.00	0.02
493	002292	奥飞娱乐	2,900	19,024.00	0.02
494	600325	华发股份	7,800	18,018.00	0.02
495	002572	索菲亚	2,100	15,330.00	0.01
496	603833	欧派家居	500	15,055.00	0.01
497	002891	中宠股份	500	13,360.00	0.01

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	688816	易思维	61	3,483.10	0.00
2	001220	世盟股份	39	1,083.42	0.00
3	603284	林平发展	30	1,046.10	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	600519	贵州茅台	5,176,283.00	2.99
2	601318	中国平安	2,952,970.00	1.71
3	601899	紫金矿业	2,516,554.00	1.45
4	688041	海光信息	2,395,355.26	1.38
5	600036	招商银行	2,145,174.00	1.24
6	600900	长江电力	1,510,276.00	0.87
7	688008	澜起科技	1,465,826.21	0.85
8	603986	兆易创新	1,420,666.00	0.82
9	601166	兴业银行	1,384,514.00	0.80
10	688981	中芯国际	1,290,618.99	0.75
11	600030	中信证券	1,186,611.00	0.69
12	600276	恒瑞医药	1,108,135.00	0.64
13	603259	药明康德	1,093,581.00	0.63
14	601398	工商银行	1,075,304.00	0.62
15	601211	国泰海通	899,486.00	0.52
16	601288	农业银行	860,247.00	0.50
17	600309	万华化学	841,809.00	0.49
18	603993	洛阳钼业	828,789.78	0.48
19	601328	交通银行	803,305.00	0.46
20	600887	伊利股份	797,330.00	0.46

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	600519	贵州茅台	7,769,520.00	4.49
2	601318	中国平安	4,868,408.09	2.81
3	601899	紫金矿业	4,103,570.00	2.37
4	600036	招商银行	3,430,145.00	1.98
5	688041	海光信息	2,930,325.51	1.69
6	600900	长江电力	2,353,094.00	1.36
7	601166	兴业银行	2,244,166.00	1.30
8	600030	中信证券	1,844,577.00	1.07
9	688981	中芯国际	1,842,225.63	1.06
10	688008	澜起科技	1,839,743.44	1.06
11	600276	恒瑞医药	1,774,482.00	1.03
12	601398	工商银行	1,666,680.00	0.96

13	603986	兆易创新	1,659,819.00	0.96
14	603259	药明康德	1,640,683.00	0.95
15	601211	国泰海通	1,461,324.00	0.84
16	601288	农业银行	1,366,944.00	0.79
17	603993	洛阳钼业	1,324,297.00	0.77
18	600309	万华化学	1,294,315.50	0.75
19	601328	交通银行	1,264,760.00	0.73
20	600887	伊利股份	1,247,331.00	0.72

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	90,860,711.29
卖出股票收入（成交）总额	126,634,498.12

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

本基金投资股指期货，将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、交易活跃的股指期货合约，从而降低交易成本，提高投资效率，从而更紧密地跟踪标的指数。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。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约定的备选股票库

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同约定的备选股票库的情况。

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	-
2	应收清算款	1,103,629.07
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	1,103,629.07

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不存在流通受限情况。

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	688816	易思维	3,483.10	0.00	新股锁定
2	001220	世盟股份	1,083.42	0.00	新股锁定
3	603284	林平发展	1,046.10	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（%）
527	149,757.72	68,458,484.00	86.74	10,463,833.00	13.26

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（%）
浦银中证A500交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	17,025,100.00	21.57

8.2 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

8.3 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（2024 年 12 月 30 日）基金份额总额	1,506,922,317.00
本报告期期初基金份额总额	132,922,317.00
本报告期基金总申购份额	99,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	153,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	78,922,317.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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

本报告期内，基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 2 月 12 日，黄俊麟先生新任公司首席信息官。具体信息请参见基金管理人于 2026 年 2 月 14 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

2026 年 3 月 11 日，顾佳女士新任公司督察长，喻庆先生离任公司督察长，喻庆先生新任公司副总经理兼财务负责人，顾佳女士离任公司副总经理兼财务负责人。具体信息请参见基金管理人于 2026 年 3 月 13 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

2026 年 5 月 8 日，公司 2026 年第三次股东会会议审议通过，同意黄雄先生接替屠旋旋先生续任公司第六届董事会董事。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本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毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

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

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

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

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：无

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
华鑫证券	4	217,439,207.42	100.00	44,771.51	100.00	-

注：1、证券公司交易单元选择的标准和程序：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

①基本情况：包括但不限于资本充足、近三年财务状况良好；主要股东经营稳健；具备高效、安全的通讯条件，能够提供有效交易执行服务。

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

③研究实力：有具备较强综合研究能力和行业分析能力的专职研究团队；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、公司等各项领域；研究报告分析严谨，观点独立、客观，并有完善的研究报告质量和合规保障机制。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

对于符合选择证券公司参与证券交易标准的证券公司，经公司相关审批程序，可纳入公司备选池。在备选池中的证券公司方可参加券商考核，并被选择参与证券交易。公司会与被选中的证券公司签订协议，督察长及法律合规部在上述过程中履行合规审查职责。

2、本基金使用证券公司交易结算模式，可免于执行《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》中关于单个券商交易佣金比例限制的规定。

3、本基金选择的证券经纪商为华鑫证券。本基金管理人与华鑫证券不存在关联关系。

4、按照本基金与华鑫证券签订的经纪服务协议，股票佣金费率为 0.026%，实际支付的佣金已扣除由经纪服务商承担的费用，在进行交易结算时逐笔直接扣除。

5、本基金本报告期内无证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
华鑫证券	-	-	-	-	-	-

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	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 场内简称变更的公告	报刊及规定网站	2026 年 1 月 15 日
2	浦银安盛中证 A500 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	2026 年 1 月 16 日
3	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026 年 1 月 22 日
4	浦银安盛基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	报刊及规定网站	2026 年 1 月 29 日
5	浦银安盛基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	报刊及规定网站	2026 年 1 月 29 日
6	浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	报刊及规定网站	2026 年 2 月 14 日
7	浦银安盛基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告	报刊及规定网站	2026 年 3 月 13 日
8	浦银安盛基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
9	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026 年 3 月 31 日
10	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026 年 4 月 22 日
11	2025 年度浦银安盛基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	报刊及规定网站	2026 年 4 月 30 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	20260129-20260203	2,328,403.00	123,683,597.00	122,912,779.00	3,099,221.00	3.93
	2	20260101-20260630	32,611,100.00	9,799,400.00	13,697,400.00	28,713,100.00	36.38
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、 中国证监会批准本基金募集的文件

2、 浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、 浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

4、 浦银中证 A500 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.spdbfunds.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。

浦银基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日