浦银中证A500指数增强型发起式证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9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

报告送出日期：2026年10月27日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 2026 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	浦银中证 A500 指数增强
基金主代码	022768
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 11 日
报告期末基金份额总额	358,061,023.07 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	在正常市场情况下，本基金力争使基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 8%。 本基金以中证 A500 指数为标的指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制标的指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离标的指数，另一方面在跟踪标的指数的同时，力争获得超越标的指数的收益。 本基金的资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、可转换债券与可交换债券投资策略、转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、资产支持证券投资策略、股票期权投资策略详见法律文件。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*95%＋银行活期存款利率（税后）

	*5%	
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
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	
下属分级基金的基金简称	浦银中证 A500 指数增强 A	浦银中证 A500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	022768	022769
报告期末下属分级基金的份额总额	267,766,510.94 份	90,294,512.13 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）	
	浦银中证 A500 指数增强 A	浦银中证 A500 指数增强 C
1.本期已实现收益	-10,631,354.47	-3,343,676.79
2.本期利润	-46,792,502.18	-17,790,443.59
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2042	-0.2281
4.期末基金资产净值	347,807,624.80	116,557,310.07
5.期末基金份额净值	1.2989	1.2909

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。

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

浦银中证 A500 指数增强 A

阶段	净值增长率①	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	-16.40%	1.92%	-14.23%	1.43%	-2.17%	0.49%
过去六个月	3.62%	1.82%	-2.62%	1.40%	6.24%	0.42%

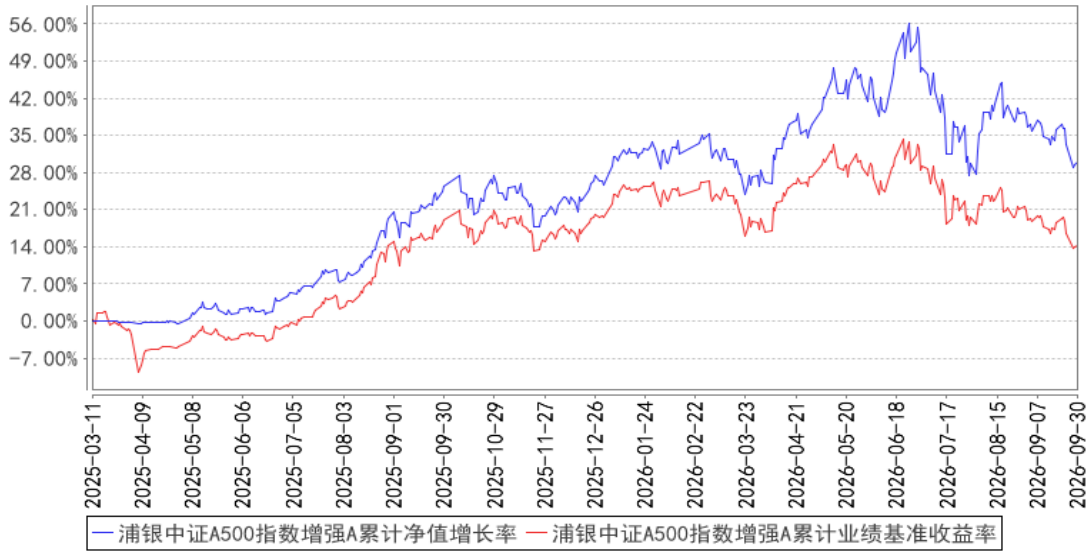
过去一年	3.63%	1.55%	-4.10%	1.24%	7.73%	0.31%
自基金合同生效起至今	29.89%	1.30%	14.21%	1.15%	15.68%	0.15%

浦银中证 A500 指数增强 C

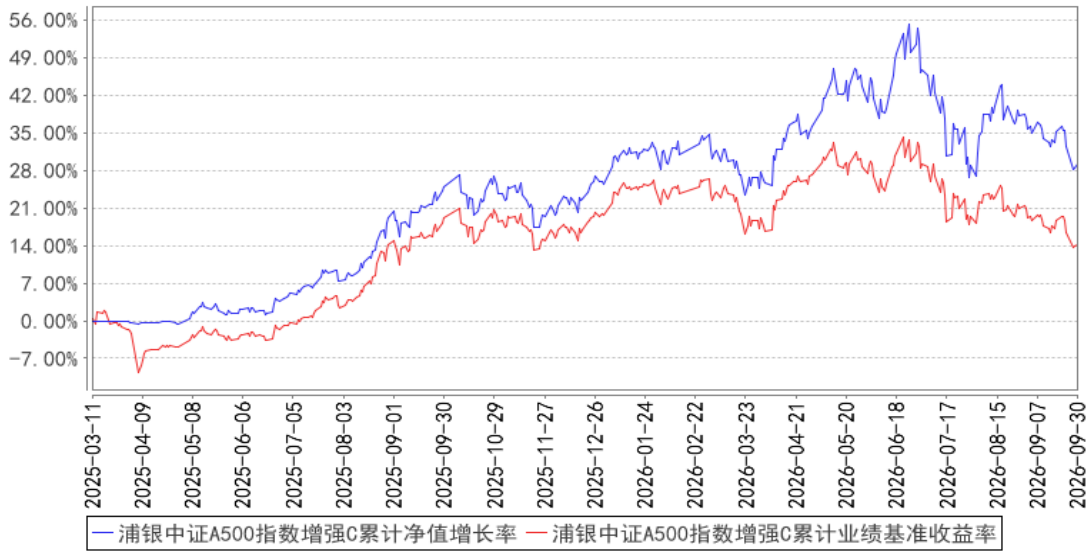
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-16.48%	1.92%	-14.23%	1.43%	-2.25%	0.49%
过去六个月	3.42%	1.82%	-2.62%	1.40%	6.04%	0.42%
过去一年	3.22%	1.55%	-4.10%	1.24%	7.32%	0.31%
自基金合同生效起至今	29.09%	1.30%	14.21%	1.15%	14.88%	0.15%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

浦银中证A500指数增强A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



浦银中证A500指数增强C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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙晨进	公司指数与量化投资部总监，公司旗下部分基金基金经理	2025 年 3 月 11 日	-	16 年	孙晨进先生，武汉大学金融工程专业硕士。2010 年 7 月至 2021 年 1 月就职于华安基金管理有限公司指数与量化投资部，历任数量分析师、投资经理、基金经理、量化业务负责人、助理总监等职务。2021 年 2 月至 2023 年 2 月就职于申万菱信基金管理有限公司，历任量化投资部总监、基金经理、基金经理兼投资经理等职务。2023 年 3 月加盟本公司，现任指数与量化投资部总监兼基金经理。2024 年 9 月起担任浦银中证 A50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起担任浦银上证科创板 100 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起担任浦银红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月起担任浦银中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月起担任浦银上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理。2025 年 7 月起担任浦银港股通央企红利混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 1 月起担任浦银量化多

					策略灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 9 月起担任浦银新材料混合型发起式证券投资基金的基金经理。2026 年 9 月起担任浦银产业优选混合型发起式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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度，A 股市场整体呈现震荡调整格局，主要指数普遍回落，市场风格发生显著切换。7 月，受全球科技板块去杠杆影响，A 股跟随海外市场大幅回撤后低位震荡，风格轮动明显加快；8 月市场在震荡中逐步企稳，但结构性分化加剧；9 月，受中东地缘局势持续发酵、国际油价高位运行以及美联储时隔三年多首次加息、全球转向加息周期等因素影响，A 股市场再度承压，成长板块调整尤为明显，三季度整体跌幅大于全球股市。从主要指数来看，三季度中证红利指数上涨 9.38%，上证指数、沪深 300、科创 50 指数分别下跌 6.16%、12.49%、30.70%，创业板指、深证成指分别下跌 27.80%、20.47%。行业方面，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行表现相对较好，电子、通信、建筑材料、电力设备表现较弱。

本报告期基金核心执行多因子量化增强投资框架，依托上市公司财报披露数据，结合各类因子收益表现、市场风格轮动情况动态优化持仓组合。后续市场环境下，具备扎实基本面支撑的优质标的估值修复空间确定性较强，价值、成长两类因子或将呈现轮动走强格局。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.2989 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.40%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%，截至本报告期末浦银中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.2909 元，本报告期基金份额净值增长率为-16.48%，同期业绩比较基准收益率为-14.23%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

1、本基金为发起式基金，基金持有人数符合法律法规及基金合同的要求。

2、本基金为发起式基金，基金资产净值符合法律法规及基金合同的要求。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	432,319,004.33	92.85
	其中：股票	432,319,004.33	92.85
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	32,621,639.30	7.01
8	其他资产	652,279.98	0.14
9	合计	465,592,923.61	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	-	-
B	采矿业	13,092,030.00	2.82
C	制造业	265,190,327.41	57.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,751,250.00	1.24
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	10,158,332.00	2.19
G	交通运输、仓储和邮政业	6,284,159.00	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,475,078.40	4.62
J	金融业	41,581,588.00	8.95
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	937,486.00	0.20
M	科学研究和技术服务业	5,021,708.00	1.08
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	369,491,958.81	79.57

5.2.2 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	1,127,520.00	0.24
C	制造业	42,795,052.40	9.22

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	77,928.02	0.02
E	建筑业	5,625,564.00	1.21
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,188.64	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,467,388.80	0.96
J	金融业	8,712,374.00	1.88
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	20,029.66	0.00
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	62,827,045.52	13.53

5.2.3 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	21,600	17,462,304.00	3.76
2	300502	新易盛	38,440	14,953,160.00	3.22
3	300750	宁德时代	47,400	13,798,614.00	2.97
4	601318	中国平安	189,700	10,109,113.00	2.18
5	600036	招商银行	217,000	8,953,420.00	1.93
6	688498	源杰科技	5,472	8,826,336.00	1.90
7	300394	天孚通信	32,340	8,433,301.80	1.82
8	000001	平安银行	647,700	7,493,889.00	1.61
9	002384	东山精密	42,800	7,164,720.00	1.54
10	600183	生益科技	49,000	6,368,040.00	1.37

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	300489	光智科技	27,200	7,571,120.00	1.63
2	601869	长飞光纤	15,300	6,290,748.00	1.35
3	600970	中材国际	728,700	5,625,564.00	1.21
4	688702	盛科通信	15,680	4,467,388.80	0.96
5	300593	新雷能	153,600	4,414,464.00	0.95

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2612	中证 500 期货 2612	1	1,462,680.00	-25,880.00	-
IF2612	沪深 300 期货 2612	1	1,289,820.00	-42,780.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-68,660.00
股指期货投资本期收益（元）					-237,440.80
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-69,720.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本产品投资一定比例的股指期货多头，主要是应对基金的流动性需求和超额收益需求。本产品在宽基指数为基准的期货品种中进行了选择和配置。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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，平安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；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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	330,300.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	321,979.98
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	652,279.98

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银中证 A500 指数增强 A	浦银中证 A500 指数增强 C
报告期期初基金份额总额	140,306,365.21	61,377,108.28
报告期期间基金总申购份额	160,087,289.82	44,234,624.22
减:报告期期间基金总赎回份额	32,627,144.09	15,317,220.37
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	267,766,510.94	90,294,512.13

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	浦银中证 A500 指数增强 A	浦银中证 A500 指数增强 C
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,002,500.25	0.00
报告期期间买入/申购总份额	0.00	0.00
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	0.00
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,002,500.25	0.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	3.74	0.00

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：1、本报告期内，基金管理人不存在申购、赎回或买卖本基金的情况。截至本报告期末，本基金管理人持有浦银中证 A500 指数增强 A 10,002,500.25 份。

2、基金管理人固有资金投资本基金费用按照本基金法律文件约定收取。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,500.25	2.79	10,002,500.25	2.79	自合同生效之日起不少于 3 年
基金管理人	-	-	-	-	-

高级管理人员					
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,500.25	2.79	10,002,500.25	2.79	自合同生效之日起不少于 3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 9 月 29 日，汪献华先生离任公司副总经理。具体信息请参见基金管理人于 2026 年 9 月 30 日在规定媒介披露的《浦银基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更公告》。

§10 备查文件目录

10.1 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 指数增强型发起式证券投资基金基金合同

3、 浦银中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书

4、 浦银中证 A500 指数增强型发起式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

10.2 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。

10.3 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 10 月 27 日