

浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券  
投资基金  
2025 年中期报告

2025 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 30 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 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 2025 年 3 月 11 日起至 2025 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>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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内容的真实、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 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55

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 .....	55
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 .....	55
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	60
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 .....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	60
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	浦银安盛中证 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	
基金管理人	浦银安盛基金管理有限公司	
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	224,953,050.81 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银安盛中证 A500 指数增强 A	浦银安盛中证 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	135,253,881.02 份	89,699,169.79 份

### 2.2 基金产品说明

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	<p>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%。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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。

### 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@py-axa.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	《中国证券报》
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	浦银安盛基金管理有限公司	上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层

## § 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	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）-2025 年 6 月 30 日	
	浦银安盛中证 A500 指数增强 A	浦银安盛中证 A500 指数增强 C
本期已实现收益	10,328,796.15	6,680,475.52
本期利润	11,899,010.79	9,172,233.26
加权平均基金份额 本期利润	0.0338	0.0264
本期加权平均净 值利润率	3.36%	2.63%
本期基金份额净 值增长率	4.31%	4.19%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)	
期末可供分配利润	5,833,335.91	3,755,342.08
期末可供分配基金份额利润	0.0431	0.0419
期末基金资产净值	141,087,216.93	93,454,511.87
期末基金份额净值	1.0431	1.0419
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.31%	4.19%

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。

5、本基金《基金合同》2025年3月11日生效，至报告期末，合同成立未满半年。

## 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

浦银安盛中证 A500 指数增强 A

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	2.88%	0.56%	2.68%	0.57%	0.20%	-0.01%
过去三个月	4.50%	0.48%	0.83%	1.14%	3.67%	-0.66%
自基金合同生效起至今	4.31%	0.43%	-0.93%	1.08%	5.24%	-0.65%

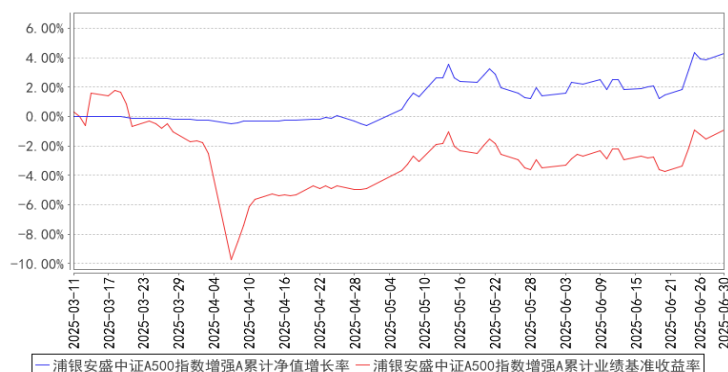
浦银安盛中证 A500 指数增强 C

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

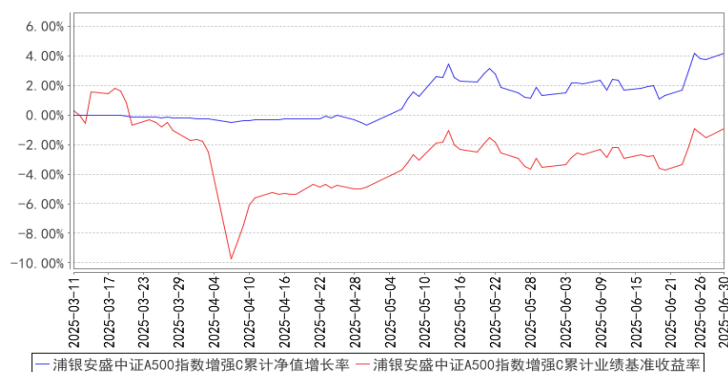
	率①	准差②		④		
过去一个月	2.85%	0.56%	2.68%	0.57%	0.17%	-0.01%
过去三个月	4.40%	0.48%	0.83%	1.14%	3.57%	-0.66%
自基金合同生效起 至今	4.19%	0.43%	-0.93%	1.08%	5.12%	-0.65%

### 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



浦银安盛中证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



注：1、本基金合同生效日为 2025 年 3 月 11 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未  
满 1 年。

2、根据基金合同规定：基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期为 2025 年 3 月 11 日至 2025 年 9 月 10 日。截止本报告期末，本基金建仓期尚未结束。



## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司（以下简称“浦银安盛”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、AXA Investment Managers S.A. 及上海国盛集团资产有限公司，公司总部设在上海，注册资本为 120,000 万元人民币，股东持股比例分别为 51%、39%和 10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理、境外证券投资管理和中国证监会许可的其他业务。

截至 2025 年 6 月 30 日止，浦银安盛旗下共管理 108 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）、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛 6 个月持有期债券型证券投资基金、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、浦银安盛盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛安恒回报定期开放混合型证券投资基金、浦银安盛量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普益纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛全球智能科技股票型证券投资基金（QDII）、浦银安盛双债增强债券型证券投资基金、浦银安盛盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛环保新能源混合型证券投资基金、浦银安盛上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银安盛盛焯 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投

资基金、浦银安盛盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛科技创新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、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、浦银安盛科技创新一年持有期混合型证券投资基金（原浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金）、浦银安盛稳健丰利债券型证券投资基金、浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银安盛盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银安盛季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛中证 ESG 120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证智能电动汽车交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛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、浦银安盛兴荣稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银安盛普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛兴耀优选一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普诚纯债债券型证券投资基金、浦银安盛中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银安盛季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银安盛普旭 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛光耀优选混合型证券投资基金、浦银安盛中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银安盛安荣回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银安盛景气优选混合型证券投资基金、浦银安盛普兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛普恒利率债券型证券投资基金、浦银安盛稳健富利 180 天持有期债券型证券投资基金、浦银安盛悦享 30 天持有期债券型证券投资基金、浦银安盛策略优选混合型证券投资基金、浦银安盛普安利率债券型证券投资基金、浦银

安盛养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金 (FOF)、浦银安盛高端装备混合型发起式证券投资基金、浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金、浦银安盛上证科创板 100 指数增强型证券投资基金、浦银安盛红利量化选股混合型证券投资基金、浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、浦银安盛周期优选混合型发起式证券投资基金、浦银安盛普航 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛上证科创板综合指数增强型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术基础设施系统以及有关业务应用系统构成。当前，公司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，在合肥异地建设有灾备托管机房，实现异地备份，形成了两地三中心的架构布局。公司的机房建设、网络设备、服务器设备、监控设备等基础设施，由公司信息技术部主导并聘请专业的系统集成公司负责建成。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。这些系统主要是采购行业内成熟、主流的专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。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低代码的数字化运营平台，基于 CDH 底座的大数据开发平台，集 RPA、OCR、NLP、AI 等创新技术为一体的创新研发平台以及移动平台等业务支持应用平台，积极为业务赋能。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		
孙晨进	公司指数与量化投资部总监，公司旗下部分基	2025 年 3 月 11 日	-	14 年	孙晨进，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

	金基金经理			<p>资经理等职务。2023 年 3 月加盟浦银安盛基金管理有限公司，现任指数与量化投资部总监之职。2024 年 9 月起担任浦银安盛中证 A50 指数增强型证券投资基金的基金经理。2024 年 11 月起任浦银安盛上证科创板 100 指数增强型证券投资基金、浦银安盛红利量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 3 月起担任浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金的基金经理。</p>
--	-------	--	--	--

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

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

违反公平交易的行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

2025 年上半年，A 股市场经历了显著的波动与调整，整体呈现探底修复的态势。年初至 1 月中旬，市场受风险情绪压制快速下跌，随后在 4 月初因美国所谓“对等关税”政策冲击下再次探底，但政策底显现后迅速修复。6 月下旬，市场连续三日上涨，6 月 26 日盘中达到 3462 点，创下年内新高。上半年投资热点迅速轮动，机器人、DeepSeek、创新药、新消费均取得了不错的阶段性行情。从风格来看，微盘股表现优于小盘股，小盘股优于中盘和大盘股。从整体表现来看，万得全 A、上证指数和沪深 300 分别上涨 5.83%、2.76% 和 0.03%，显示出市场在震荡中逐步回暖。

本报告期内，本基金采用以多因子量化增强的投资策略为主，根据上市公司财务信息披露，以及因子表现和市场风格变化，实时对组合进行相应的调整。展望后市，基本面逻辑清晰的优质公司估值恢复的确定性较高，价值和成长因子有望交替走强。

### 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中证 A500 指数增强 A 的基金份额净值为 1.0431，本报告期基金份额净值增长率为 4.31%，同期业绩比较基准收益率为-0.93%；截至本报告期末浦银安盛中证 A500 指数增强 C 的基金份额净值为 1.0419，本报告期基金份额净值增长率为 4.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.93%。

## 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，国内财政政策将继续发挥稳经济、促内需和防风险的作用，货币政策将维持适度宽松，降准降息仍有空间。资本市场改革将持续推进，产业政策将聚焦于反内卷、科技创新和消费提振。这些政策动向为 A 股市场提供了有力支撑。同时，权益类公募基金扩容、中长期资金入市及政策工具护航将推动 A 股资金面向好。居民财富向金融资产加速再配置的趋势明确。当前 A 股估值处于历史中等水平，对比海外成熟市场仍偏低，风险溢价显示投资性价比较高。因此，2025 年下半年 A 股市场有望震荡向上，价值和成长类因子有望交替上行。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人为确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值

的公平、合理，有效维护投资人的利益，设立了浦银安盛基金管理有限公司估值委员会（以下简称“估值委员会”），制定了估值政策和估值程序。

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

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

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

本基金基金经理未参与或决定基金的估值。

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

本基金管理人与中证指数有限公司签订了《债券估值数据服务协议》。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合相关法律法规和基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

- 1、本基金为发起式基金，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 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

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合规守信、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关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：浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		
货币资金	6.4.7.1	13,763,378.38
结算备付金		14,762,811.95
存出保证金		557,851.20
交易性金融资产	6.4.7.2	217,567,951.46
其中：股票投资		217,567,951.46
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-

应收申购款		36,096.26
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		246,688,089.25
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年6月30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		11,803,830.46
应付管理人报酬		188,615.51
应付托管费		35,365.41
应付销售服务费		38,280.34
应付投资顾问费		-
应交税费		7,313.93
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	72,954.80
负债合计		12,146,360.45
<b>净资产:</b>		
实收基金	6.4.7.10	224,953,050.81
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	9,588,677.99
净资产合计		234,541,728.80
负债和净资产总计		246,688,089.25

注：本基金合同生效日为 2025 年 03 月 11 日，本报告期自基金合同生效日 2025 年 03 月 11 日起至 2025 年 06 月 30 日止。报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 224,953,050.81 份，其中 A 类基金份额净值 1.0431 元，份额总额 135,253,881.02 份；C 类基金份额净值 1.0419 元，份额总额 89,699,169.79 份。

## 6.2 利润表

会计主体：浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年3月11日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
一、营业总收入		23,578,982.26



1. 利息收入		519,453.98
其中：存款利息收入	6.4.7.13	266,650.68
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		252,803.30
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,994,477.33
其中：股票投资收益	6.4.7.14	14,858,321.58
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	271,506.08
股利收益	6.4.7.19	3,864,649.67
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	4,061,972.38
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	3,078.57
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>2,507,738.21</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,695,463.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	317,899.42
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	419,761.09
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		986.16
8. 其他费用	6.4.7.23	73,627.80
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>21,071,244.05</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>21,071,244.05</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>21,071,244.05</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,129,119,984.02	-	1,129,119,984.02
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-904,166,933.21	9,588,677.99	-894,578,255.22
(一)、综合收益总额	-	21,071,244.05	21,071,244.05
(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)	-904,166,933.21	-11,482,566.06	-915,649,499.27
其中：1. 基金申购款	8,489,198.25	134,797.35	8,623,995.60
2. 基金赎回款	-912,656,131.46	-11,617,363.41	-924,273,494.87
(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	224,953,050.81	9,588,677.99	234,541,728.80

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

顾佳

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

浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金(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]1677 号《关于准予浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式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《浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集,基金合同于 2025 年 3 月 11 日正式生效。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集规模为 1,129,119,984.02 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。根据《浦银安盛中证 A500 指数增强型发

起式证券投资基金基金合同》和《浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费用和销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同类别：在投资者认购/申购基金时收取认购/申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式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具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证，下同）、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据相关法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。

基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，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：中证 A500 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%

#### 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，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注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 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 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、金融负债或权益工具。

###### (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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

###### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照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交易性金融资产。

#### (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。

### 6.4.4.4 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。

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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金：

- 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；
- 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列

示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 6.4.4.9 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扣除按票面利率(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后的净额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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额

持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(a) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(b) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(c) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允



价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期内未发生会计政策变更。

##### 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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、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》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) 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,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税;对国债、地方政府债利息收入以及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。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。

(b)对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、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。

(d)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)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	13,763,378.38
等于：本金	13,762,734.85
加：应计利息	643.53
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	13,763,378.38

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	213,681,339.08	-	217,567,951.46	3,886,612.38
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	213,681,339.08	-	217,567,951.46	3,886,612.38

#### 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 2025年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,473,400.00	-	-	-
其中：股指期货 投资	4,473,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	4,473,400.00	-	-	-

##### 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
IC2509	中证500期货	2.00	2,310,320.00	108,880.00

	2509			
IF2507	沪深 300 期货 2507	1.00	1,172,340.00	33,960.00
IF2509	沪深 300 期货 2509	1.00	1,166,100.00	32,520.00
合计				175,360.00
减：可抵销期货 暂收款				175,360.00
净额				-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

#### 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 2025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	1,062.00
预提费用	71,892.80
合计	72,954.80

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

##### 浦银安盛中证 A500 指数增强 A

项目	本期 2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	532,434,762.81	532,434,762.81
本期申购	1,290,093.48	1,290,093.48
本期赎回（以“-”号填列）	-398,470,975.27	-398,470,975.27
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	135,253,881.02	135,253,881.02

##### 浦银安盛中证 A500 指数增强 C

项目	本期 2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	596,685,221.21	596,685,221.21

本期申购	7,199,104.77	7,199,104.77
本期赎回（以“-”号填列）	-514,185,156.19	-514,185,156.19
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	89,699,169.79	89,699,169.79

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

浦银安盛中证 A500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	10,328,796.15	1,570,214.64	11,899,010.79
本期基金份额交易产生的变动数	-4,076,072.47	-1,989,602.41	-6,065,674.88
其中：基金申购款	25,652.48	2,335.39	27,987.87
基金赎回款	-4,101,724.95	-1,991,937.80	-6,093,662.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,252,723.68	-419,387.77	5,833,335.91

浦银安盛中证 A500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	6,680,475.52	2,491,757.74	9,172,233.26
本期基金份额交易产生的变动数	-2,646,985.88	-2,769,905.30	-5,416,891.18
其中：基金申购款	145,114.65	-38,305.17	106,809.48
基金赎回款	-2,792,100.53	-2,731,600.13	-5,523,700.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,033,489.64	-278,147.56	3,755,342.08

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	106,569.01
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	160,081.67
其他	-
合计	266,650.68

#### 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
	2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	14,858,321.58
股票投资收益——赎回差价收入	-
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	14,858,321.58

##### 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
	2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,187,647,616.29
减：卖出股票成本总额	1,171,536,618.93
减：交易费用	1,252,675.78
买卖股票差价收入	14,858,321.58

##### 6.4.7.14.3 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
	2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股指期货投资收益	271,506.08

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,864,649.67
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	3,864,649.67
----	--------------

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,886,612.38
股票投资	3,886,612.38
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	175,360.00
权证投资	-
期货投资	175,360.00
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	4,061,972.38

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,078.57
合计	3,078.57

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

## 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
	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	26,486.88
信息披露费	45,405.92
证券出借违约金	-
银行费用	535.00
开户费	1,200.00
合计	73,627.80

## 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

截至本财务报表批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明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、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
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、基金销售机构

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
----	----

	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,695,463.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	783,944.83
应支付基金管理人的净管理费	911,518.91

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 0.8% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.8\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	317,899.42

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 0.15% 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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025 年 3 月 11 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银安盛中证 A500 指数增强 A	浦银安盛中证 A500 指数增强 C	合计
上海浦东发展银行	-	186,426.58	186,426.58
中国建设银行	-	189,356.46	189,356.46
合计	-	375,783.04	375,783.04

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给浦银安盛，再由浦银安盛计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金资产净值} \times 0.40\% / \text{当年天数}$$

2、本基金《基金合同》生效日为 2025 年 3 月 11 日，无上年度可比期间。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本报告期内未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：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	浦银安盛中证 A500 指数增强 A	浦银安盛中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日（2025年3月11日）持有的基金份额	10,002,500.25	0.00
报告期初持有的基金份额	10,002,500.25	0.00
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	10,002,500.25	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	7.40%	0.00%

注：1、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。

2、本基金《基金合同》生效日为2025年3月11日，无上年度可比期间。

##### 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

注：1、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。

2、本基金《基金合同》生效日为2025年3月11日，无上年度末可比期间。

#### 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 2025年3月11日（基金合同生效日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期	13,763,378.38	106,569.01

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：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须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（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：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。

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而受上述规定约束的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间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

于 2025 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 2025 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。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股（均含存托凭证，下同）、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款、通知存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。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，可以将其纳入投资范围，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。本基金可根据相关法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，其中，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变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，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、合规及审计委员会、督察长和内部审计。

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。

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 2025 年 6 月 30 日，本基金无债券和资产支持证券投资。

#### 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 2025 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2025 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 2025 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、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 2025年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	13,763,378.38	-	-	-	13,763,378.38
结算备付金	14,762,811.95	-	-	-	14,762,811.95
存出保证金	557,851.20	-	-	-	557,851.20
交易性金融资产	-	-	-	-217,567,951.46	217,567,951.46
应收申购款	-	-	-	36,096.26	36,096.26
<b>资产总计</b>	<b>29,084,041.53</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-217,604,047.72</b>	<b>246,688,089.25</b>
<b>负债</b>					
应付赎回款	-	-	-	11,803,830.46	11,803,830.46
应付管理人报酬	-	-	-	188,615.51	188,615.51
应付托管费	-	-	-	35,365.41	35,365.41
应付销售服务费	-	-	-	38,280.34	38,280.34
应交税费	-	-	-	7,313.93	7,313.93
其他负债	-	-	-	72,954.80	72,954.80
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>12,146,360.45</b>	<b>12,146,360.45</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>29,084,041.53</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-205,457,687.27</b>	<b>234,541,728.80</b>

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 2025 年 6 月 30 日，本基金主要投资于固定利率类的固定收益品种，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金以中证 A500 指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。

在有效复制目标指数的基础上，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，避免大幅偏离目标指数，另一方面在跟踪目标指数的同时，力争获得超越业绩比较基准的收益。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例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，现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%，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，及时可靠地对风险进行跟踪与控制。

#### 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 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	217,567,951.46	92.76
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	217,567,951.46	92.76

#### 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（2025年6月30日）
	业绩比较基准上升 500 基点	9,034,917.78
	业绩比较基准下降 500 基点	-9,034,917.78

注：本基金成立不满一年，其他价格风险敏感性基于基金合同生效日至 2025 年 6 月 30 日期间的数据进行分析。

#### 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 2025年6月30日
第一层次	217,567,951.46
第二层次	-
第三层次	-
合计	217,567,951.46

**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 2025 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

**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 2025 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	217,567,951.46	88.20
	其中：股票	217,567,951.46	88.20
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	28,526,190.33	11.56
8	其他各项资产	593,947.46	0.24
9	合计	246,688,089.25	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	-	-
B	采矿业	7,108,174.00	3.03
C	制造业	111,076,928.02	47.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,127,820.00	1.33
E	建筑业	1,816,492.00	0.77

F	批发和零售业	6,414,913.00	2.74
G	交通运输、仓储和邮政业	3,390,861.00	1.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,585,353.18	5.79
J	金融业	27,045,521.00	11.53
K	房地产业	1,221,756.00	0.52
L	租赁和商务服务业	399,245.00	0.17
M	科学研究和技术服务业	4,489,956.00	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	236,236.00	0.10
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	1,120,140.00	0.48
S	综合	-	-
	合计	181,033,395.20	77.19

### 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	1,949,242.00	0.83
C	制造业	18,449,231.44	7.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,056,011.00	0.88
E	建筑业	1,393,392.00	0.59
F	批发和零售业	288,510.00	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	1,210,218.00	0.52
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	505,616.82	0.22
J	金融业	9,061,265.00	3.86
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	1,621,070.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	36,534,556.26	15.58

### 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	5,530	7,794,645.60	3.32
2	601318	中国平安	125,800	6,979,384.00	2.98
3	600036	招商银行	144,300	6,630,585.00	2.83
4	300750	宁德时代	19,100	4,817,402.00	2.05
5	000725	京东方 A	1,193,700	4,762,863.00	2.03
6	603259	药明康德	56,960	3,961,568.00	1.69
7	600919	江苏银行	317,700	3,793,338.00	1.62
8	000100	TCL 科技	850,600	3,683,098.00	1.57
9	002415	海康威视	126,900	3,518,937.00	1.50
10	002138	顺络电子	123,700	3,478,444.00	1.48
11	000333	美的集团	47,000	3,393,400.00	1.45
12	300408	三环集团	100,500	3,356,700.00	1.43
13	600482	中国动力	133,300	3,075,231.00	1.31
14	000425	徐工机械	394,700	3,066,819.00	1.31
15	600998	九州通	589,900	3,032,086.00	1.29
16	600050	中国联通	559,600	2,988,264.00	1.27
17	002414	高德红外	287,900	2,950,975.00	1.26
18	601328	交通银行	359,300	2,874,400.00	1.23
19	601989	中国重工	563,300	2,613,712.00	1.11
20	002145	中核钛白	597,900	2,481,285.00	1.06
21	601728	中国电信	311,600	2,414,900.00	1.03
22	002409	雅克科技	41,000	2,242,290.00	0.96
23	600690	海尔智家	88,300	2,188,074.00	0.93
24	002180	纳思达	94,800	2,174,712.00	0.93
25	600066	宇通客车	87,300	2,170,278.00	0.93

26	300088	长信科技	357,000	2,127,720.00	0.91
27	601877	正泰电器	93,100	2,110,577.00	0.90
28	600131	国网信通	118,200	2,092,140.00	0.89
29	600941	中国移动	18,200	2,048,410.00	0.87
30	000960	锡业股份	132,900	2,033,370.00	0.87
31	600031	三一重工	112,100	2,012,195.00	0.86
32	600704	物产中大	381,600	2,011,032.00	0.86
33	600104	上汽集团	125,200	2,009,460.00	0.86
34	000623	吉林敖东	116,500	1,974,675.00	0.84
35	601601	中国太保	52,600	1,973,026.00	0.84
36	000878	云南铜业	155,100	1,972,872.00	0.84
37	603993	洛阳钼业	233,200	1,963,544.00	0.84
38	601567	三星医疗	85,000	1,905,700.00	0.81
39	002340	格林美	299,400	1,901,190.00	0.81
40	600150	中国船舶	56,800	1,848,272.00	0.79
41	600188	兖矿能源	144,300	1,756,131.00	0.75
42	601633	长城汽车	80,900	1,737,732.00	0.74
43	002841	视源股份	48,200	1,667,720.00	0.71
44	300573	兴齐眼药	31,600	1,636,564.00	0.70
45	600900	长江电力	51,500	1,552,210.00	0.66
46	300017	网宿科技	138,700	1,486,864.00	0.63
47	601166	兴业银行	60,600	1,414,404.00	0.60
48	601058	赛轮轮胎	101,400	1,330,368.00	0.57
49	000683	博源化工	271,600	1,300,964.00	0.55
50	603816	顾家家居	50,400	1,286,208.00	0.55
51	601233	桐昆股份	121,100	1,283,660.00	0.55
52	600905	三峡能源	299,800	1,277,148.00	0.54
53	001979	招商蛇口	138,700	1,216,399.00	0.52
54	600233	圆通速递	92,700	1,194,903.00	0.51
55	601899	紫金矿业	60,900	1,187,550.00	0.51
56	000651	格力电器	25,100	1,127,492.00	0.48
57	600885	宏发股份	50,300	1,122,193.00	0.48
58	002739	万达电影	98,000	1,120,140.00	0.48
59	600820	隧道股份	177,000	1,079,700.00	0.46
60	000708	中信特钢	91,100	1,071,336.00	0.46
61	688005	容百科技	46,744	1,043,326.08	0.44
62	600660	福耀玻璃	17,700	1,009,077.00	0.43
63	603605	珀莱雅	12,100	1,001,759.00	0.43
64	002594	比亚迪	3,000	995,730.00	0.42
65	601857	中国石油	115,100	984,105.00	0.42
66	601988	中国银行	173,300	973,946.00	0.42
67	601919	中远海控	64,600	971,584.00	0.41
68	600115	中国东航	223,700	901,511.00	0.38

69	000538	云南白药	15,600	870,324.00	0.37
70	601168	西部矿业	52,000	864,760.00	0.37
71	600183	生益科技	28,500	859,275.00	0.37
72	002001	新和成	39,600	842,292.00	0.36
73	600166	福田汽车	299,400	811,374.00	0.35
74	002555	三七互娱	46,900	810,901.00	0.35
75	600219	南山铝业	211,400	809,662.00	0.35
76	300059	东方财富	34,500	797,985.00	0.34
77	000338	潍柴动力	51,300	788,994.00	0.34
78	600637	东方明珠	104,700	782,109.00	0.33
79	002532	天山铝业	93,000	772,830.00	0.33
80	601600	中国铝业	107,300	755,392.00	0.32
81	002091	江苏国泰	102,000	741,540.00	0.32
82	601868	中国能建	330,400	736,792.00	0.31
83	601179	中国西电	118,700	728,818.00	0.31
84	002920	德赛西威	7,100	725,123.00	0.31
85	600487	亨通光电	45,000	688,500.00	0.29
86	600862	中航高科	26,300	685,904.00	0.29
87	002202	金风科技	66,300	679,575.00	0.29
88	601677	明泰铝业	52,600	653,292.00	0.28
89	688256	寒武纪	1,085	652,627.50	0.28
90	002493	荣盛石化	66,100	547,308.00	0.23
91	601607	上海医药	30,500	545,340.00	0.23
92	601319	中国人保	60,800	529,568.00	0.23
93	300012	华测检测	45,200	528,388.00	0.23
94	600989	宝丰能源	31,100	501,954.00	0.21
95	600332	白云山	18,000	474,480.00	0.20
96	603288	海天味业	11,900	463,029.00	0.20
97	600030	中信证券	16,500	455,730.00	0.19
98	300274	阳光电源	6,700	454,059.00	0.19
99	600038	中直股份	10,700	415,267.00	0.18
100	600499	科达制造	41,100	402,780.00	0.17
101	600153	建发股份	38,500	399,245.00	0.17
102	601658	邮储银行	67,300	368,131.00	0.16
103	002128	电投能源	17,800	352,084.00	0.15
104	300395	菲利华	6,800	347,480.00	0.15
105	600887	伊利股份	11,900	331,772.00	0.14
106	000977	浪潮信息	6,400	325,632.00	0.14
107	688188	柏楚电子	2,348	309,137.68	0.13
108	688608	恒玄科技	883	307,266.34	0.13
109	000423	东阿阿胶	5,300	277,190.00	0.12
110	600018	上港集团	47,300	270,083.00	0.12
111	601398	工商银行	33,600	255,024.00	0.11



112	002266	浙富控股	76,700	236,236.00	0.10
113	600011	华能国际	32,200	229,908.00	0.10
114	600177	雅戈尔	27,700	202,210.00	0.09
115	600655	豫园股份	15,300	84,915.00	0.04
116	600008	首创环保	22,700	68,554.00	0.03
117	600004	白云机场	5,800	52,780.00	0.02
118	000858	五粮液	300	35,670.00	0.02
119	600867	通化东宝	4,300	35,260.00	0.02
120	600325	华发股份	1,100	5,357.00	0.00
121	600276	恒瑞医药	100	5,190.00	0.00

### 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	601818	光大银行	592,500	2,458,875.00	1.05
2	000895	双汇发展	97,100	2,370,211.00	1.01
3	000596	古井贡酒	17,300	2,303,495.00	0.98
4	002142	宁波银行	80,400	2,199,744.00	0.94
5	601211	国泰海通	109,800	2,103,768.00	0.90
6	600025	华能水电	185,100	1,767,705.00	0.75
7	300595	欧普康视	110,500	1,687,335.00	0.72
8	601958	金钼股份	137,600	1,505,344.00	0.64
9	600970	中材国际	162,400	1,393,392.00	0.59
10	600999	招商证券	74,000	1,301,660.00	0.55
11	600600	青岛啤酒	16,000	1,111,360.00	0.47
12	601928	凤凰传媒	95,700	1,068,969.00	0.46
13	603733	仙鹤股份	50,500	1,047,370.00	0.45
14	000877	天山股份	220,700	1,024,048.00	0.44
15	001872	招商港口	46,800	929,448.00	0.40
16	601717	中创智领	50,800	844,296.00	0.36
17	600582	天地科技	135,800	813,442.00	0.35
18	600299	安迪苏	75,900	732,435.00	0.31
19	603529	爱玛科技	21,200	729,280.00	0.31
20	601901	方正证券	91,800	726,138.00	0.31
21	000050	深天马 A	84,800	722,496.00	0.31
22	688469	芯联集成	151,251	721,467.27	0.31
23	600572	康恩贝	163,700	717,006.00	0.31
24	000921	海信家电	27,700	711,890.00	0.30
25	600703	三安光电	53,100	659,502.00	0.28
26	601019	山东出版	58,300	552,101.00	0.24
27	688252	天德钰	20,739	505,616.82	0.22
28	600873	梅花生物	46,600	498,154.00	0.21
29	600583	海油工程	81,300	443,898.00	0.19
30	601311	骆驼股份	43,800	395,514.00	0.17

31	600380	健康元	35,300	389,359.00	0.17
32	603309	维力医疗	27,100	344,712.00	0.15
33	688187	时代电气	8,037	342,778.05	0.15
34	603233	大参林	17,700	288,510.00	0.12
35	600167	联美控股	51,300	288,306.00	0.12
36	688475	萤石网络	8,981	283,081.12	0.12
37	603565	中谷物流	29,400	280,770.00	0.12
38	000166	申万宏源	54,000	271,080.00	0.12

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	33,255,239.00	14.18
2	600036	招商银行	20,706,548.00	8.83
3	300750	宁德时代	16,517,048.00	7.04
4	601988	中国银行	16,475,904.00	7.02
5	601318	中国平安	15,318,167.30	6.53
6	601658	邮储银行	13,937,615.00	5.94
7	601328	交通银行	13,354,028.00	5.69
8	000725	京东方 A	12,891,541.00	5.50
9	601398	工商银行	12,478,931.00	5.32
10	600919	江苏银行	12,102,817.00	5.16
11	000895	双汇发展	12,065,735.00	5.14
12	601600	中国铝业	11,565,188.00	4.93
13	000623	吉林敖东	11,510,070.00	4.91
14	601601	中国太保	11,030,217.00	4.70
15	600352	浙江龙盛	10,840,236.00	4.62
16	000100	TCL 科技	10,834,912.00	4.62
17	002340	格林美	10,711,222.08	4.57
18	600582	天地科技	10,177,949.00	4.34
19	002594	比亚迪	9,727,729.00	4.15
20	600104	上汽集团	9,549,991.00	4.07
21	002064	华峰化学	9,506,457.20	4.05
22	300408	三环集团	9,419,169.00	4.02
23	688009	中国通号	9,413,210.58	4.01
24	000651	格力电器	9,267,943.00	3.95
25	300088	长信科技	9,202,254.00	3.92
26	600219	南山铝业	9,113,014.00	3.89
27	600050	中国联通	9,018,475.00	3.85
28	600900	长江电力	9,000,313.00	3.84
29	600704	物产中大	8,906,049.00	3.80
30	601899	紫金矿业	8,791,443.00	3.75

31	601989	中国重工	8,709,811.00	3.71
32	600887	伊利股份	8,606,608.00	3.67
33	002185	华天科技	8,444,741.00	3.60
34	300207	欣旺达	8,375,673.00	3.57
35	000596	古井贡酒	8,236,852.00	3.51
36	600905	三峡能源	8,067,759.00	3.44
37	601866	中远海发	8,067,609.00	3.44
38	600703	三安光电	8,041,916.00	3.43
39	600998	九州通	7,968,235.00	3.40
40	600115	中国东航	7,965,517.00	3.40
41	600016	民生银行	7,958,819.00	3.39
42	002532	天山铝业	7,929,341.00	3.38
43	600406	国电南瑞	7,880,944.41	3.36
44	601868	中国能建	7,845,828.00	3.35
45	601766	中国中车	7,824,716.00	3.34
46	002409	雅克科技	7,812,821.00	3.33
47	600690	海尔智家	7,698,787.00	3.28
48	002920	德赛西威	7,625,422.00	3.25
49	601818	光大银行	7,532,075.00	3.21
50	688005	容百科技	7,408,365.97	3.16
51	002841	视源股份	7,400,547.80	3.16
52	600131	国网信通	7,289,156.00	3.11
53	603259	药明康德	7,286,287.20	3.11
54	002145	中核钛白	7,243,093.00	3.09
55	600196	复星医药	7,226,818.00	3.08
56	600885	宏发股份	7,103,704.00	3.03
57	002429	兆驰股份	7,025,348.00	3.00
58	600529	山东药玻	6,846,833.00	2.92
59	003816	中国广核	6,667,468.00	2.84
60	002415	海康威视	6,629,616.00	2.83
61	601319	中国人保	6,626,693.00	2.83
62	300037	新宙邦	6,607,029.00	2.82
63	002138	顺络电子	6,555,279.00	2.79
64	300144	宋城演艺	6,433,686.00	2.74
65	000858	五粮液	6,388,043.00	2.72
66	688256	寒武纪	6,295,861.31	2.68
67	601633	长城汽车	6,278,881.00	2.68
68	600637	东方明珠	6,272,692.00	2.67
69	002405	四维图新	6,187,309.00	2.64
70	601288	农业银行	6,090,040.00	2.60
71	601877	正泰电器	6,057,016.00	2.58
72	603369	今世缘	6,042,778.00	2.58
73	603979	金诚信	6,029,329.12	2.57

74	603486	科沃斯	5,998,883.00	2.56
75	601058	赛轮轮胎	5,945,241.00	2.53
76	002304	洋河股份	5,890,628.00	2.51
77	300751	迈为股份	5,862,884.00	2.50
78	002027	分众传媒	5,820,792.00	2.48
79	000921	海信家电	5,765,028.00	2.46
80	688981	中芯国际	5,682,909.15	2.42
81	000423	东阿阿胶	5,680,521.00	2.42
82	601238	广汽集团	5,650,518.00	2.41
83	601880	XD 辽港股	5,648,658.00	2.41
84	300015	爱尔眼科	5,644,578.00	2.41
85	601225	陕西煤业	5,642,707.00	2.41
86	000975	山金国际	5,635,726.00	2.40
87	601816	京沪高铁	5,632,107.00	2.40
88	300628	亿联网络	5,612,266.40	2.39
89	000333	美的集团	5,551,426.00	2.37
90	688180	君实生物	5,504,058.46	2.35
91	688002	睿创微纳	5,493,821.64	2.34
92	601728	中国电信	5,489,445.00	2.34
93	601966	玲珑轮胎	5,448,996.00	2.32
94	600183	生益科技	5,376,000.00	2.29
95	603288	海天味业	5,338,783.00	2.28
96	600487	亨通光电	5,326,393.00	2.27
97	000338	潍柴动力	5,303,842.00	2.26
98	300724	捷佳伟创	5,298,699.00	2.26
99	600167	联美控股	5,282,043.00	2.25
100	600038	中直股份	5,253,280.00	2.24
101	603659	璞泰来	5,226,716.00	2.23
102	601992	金隅集团	5,221,275.00	2.23
103	002414	高德红外	5,220,006.00	2.23
104	300496	中科创达	5,211,540.00	2.22
105	000425	徐工机械	5,200,745.00	2.22
106	300212	易华录	5,178,807.00	2.21
107	000001	平安银行	4,968,303.00	2.12
108	601166	兴业银行	4,913,754.00	2.10
109	688472	阿特斯	4,815,835.80	2.05
110	002353	杰瑞股份	4,768,489.00	2.03
111	300014	亿纬锂能	4,728,582.10	2.02
112	600332	白云山	4,724,584.00	2.01
113	603260	合盛硅业	4,718,165.00	2.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	24,851,912.70	10.60
2	601988	中国银行	15,760,848.00	6.72
3	600036	招商银行	14,590,251.00	6.22
4	601658	邮储银行	13,609,675.00	5.80
5	300750	宁德时代	13,539,522.10	5.77
6	601398	工商银行	12,365,085.00	5.27
7	600352	浙江龙盛	10,989,089.00	4.69
8	601328	交通银行	10,688,158.00	4.56
9	601600	中国铝业	10,129,517.00	4.32
10	002064	华峰化学	9,875,293.00	4.21
11	000623	吉林敖东	9,743,736.00	4.15
12	601866	中远海发	9,618,014.00	4.10
13	000895	双汇发展	9,443,483.00	4.03
14	601318	中国平安	9,302,884.00	3.97
15	601601	中国太保	9,294,716.00	3.96
16	600582	天地科技	9,104,651.00	3.88
17	688009	中国通号	9,056,329.17	3.86
18	002340	格林美	9,053,970.00	3.86
19	600219	南山铝业	9,025,760.00	3.85
20	002594	比亚迪	8,969,338.00	3.82
21	600919	江苏银行	8,919,320.00	3.80
22	000725	京东方 A	8,454,491.00	3.60
23	300207	欣旺达	8,380,486.00	3.57
24	600887	伊利股份	8,328,318.00	3.55
25	000651	格力电器	8,319,528.00	3.55
26	600016	民生银行	8,157,406.00	3.48
27	601766	中国中车	7,984,953.00	3.40
28	002185	华天科技	7,928,743.00	3.38
29	600104	上汽集团	7,851,781.00	3.35
30	000100	TCL 科技	7,830,391.00	3.34
31	300088	长信科技	7,631,328.00	3.25
32	600406	国电南瑞	7,597,952.93	3.24
33	600900	长江电力	7,548,541.00	3.22
34	600703	三安光电	7,538,434.00	3.21
35	002532	天山铝业	7,526,499.00	3.21
36	601899	紫金矿业	7,418,040.00	3.16
37	600196	复星医药	7,189,023.75	3.07
38	600704	物产中大	7,152,140.00	3.05
39	600115	中国东航	7,120,623.00	3.04
40	002920	德赛西威	7,074,767.00	3.02
41	002429	兆驰股份	7,060,078.00	3.01
42	601868	中国能建	7,007,914.00	2.99

43	600529	山东药玻	6,790,665.00	2.90
44	600905	三峡能源	6,789,498.00	2.89
45	300144	宋城演艺	6,711,600.00	2.86
46	003816	中国广核	6,692,621.00	2.85
47	300751	迈为股份	6,600,141.00	2.81
48	688005	容百科技	6,496,306.66	2.77
49	300037	新宙邦	6,478,626.00	2.76
50	601319	中国人保	6,462,417.00	2.76
51	601989	中国重工	6,459,831.00	2.75
52	603486	科沃斯	6,343,274.00	2.70
53	002405	四维图新	6,185,929.00	2.64
54	603979	金诚信	6,064,525.31	2.59
55	600885	宏发股份	6,058,954.95	2.58
56	601288	农业银行	6,058,133.00	2.58
57	002841	视源股份	6,056,126.50	2.58
58	002027	分众传媒	6,038,989.00	2.57
59	600050	中国联通	5,906,759.00	2.52
60	000858	五粮液	5,904,362.00	2.52
61	603369	今世缘	5,843,906.00	2.49
62	601880	XD 辽港股	5,806,535.00	2.48
63	688180	君实生物	5,780,961.80	2.46
64	601816	京沪高铁	5,774,108.00	2.46
65	300628	亿联网络	5,769,363.00	2.46
66	601238	广汽集团	5,716,088.00	2.44
67	688002	睿创微纳	5,706,098.34	2.43
68	002409	雅克科技	5,693,762.00	2.43
69	300408	三环集团	5,642,222.00	2.41
70	002304	洋河股份	5,613,108.00	2.39
71	000975	山金国际	5,520,483.00	2.35
72	600637	东方明珠	5,513,851.00	2.35
73	601818	光大银行	5,486,032.00	2.34
74	600690	海尔智家	5,447,139.00	2.32
75	600998	九州通	5,403,859.00	2.30
76	601225	陕西煤业	5,400,715.00	2.30
77	000423	东阿阿胶	5,373,675.00	2.29
78	300496	中科创达	5,370,496.00	2.29
79	688981	中芯国际	5,318,760.35	2.27
80	300724	捷佳伟创	5,280,514.00	2.25
81	000921	海信家电	5,223,051.00	2.23
82	601966	玲珑轮胎	5,217,925.00	2.22
83	603659	璞泰来	5,200,709.00	2.22
84	601992	金隅集团	5,183,443.00	2.21
85	688256	寒武纪	5,110,317.31	2.18

86	000596	古井贡酒	5,107,808.00	2.18
87	000001	平安银行	5,101,833.00	2.18
88	300212	易华录	5,083,430.00	2.17
89	600131	国网信通	5,043,095.00	2.15
90	600038	中直股份	5,023,570.00	2.14
91	300015	爱尔眼科	5,019,569.00	2.14
92	600183	生益科技	5,011,800.00	2.14
93	300014	亿纬锂能	4,991,714.00	2.13
94	601058	赛轮轮胎	4,959,760.00	2.11
95	002353	杰瑞股份	4,933,338.00	2.10
96	603288	海天味业	4,877,309.00	2.08
97	002145	中核钛白	4,839,200.00	2.06
98	600167	联美控股	4,836,478.00	2.06
99	688472	阿特斯	4,794,012.24	2.04
100	601825	沪农商行	4,763,037.00	2.03

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	1,385,217,958.01
卖出股票收入（成交）总额	1,187,647,616.29

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规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	557,851.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,096.26
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	593,947.46

### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。



## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
浦银安盛 中证 A500 指数增强 A	1,091	123,972.39	20,016,714.77	14.80	115,237,166.25	85.20
浦银安盛 中证 A500 指数增强 C	1,085	82,672.05	300,050.00	0.33	89,399,119.79	99.67
合计	2,176	103,379.16	20,316,764.77	9.03	204,636,286.04	90.97

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	浦银安盛中证 A500 指数增强 A	1,130,379.10	0.84
	浦银安盛中证 A500 指数增强 C	12,837.87	0.01
	合计	1,143,216.97	0.51

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、 基金投资和部门 负责人持有本开放式 基金	浦银安盛中证 A500 指数增 强 A	>100
	浦银安盛中证 A500 指数增 强 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有 本开放式基金	浦银安盛中证 A500 指数增 强 A	>100
	浦银安盛中证 A500 指数增 强 C	0
	合计	>100

## 8.4 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	4.45	10,002,500.25	4.45	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	4.45	10,002,500.25	4.45	自合同生效之日起不少于 3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银安盛中证 A500 指数增强 A	浦银安盛中证 A500 指数增强 C
基金合同生效日 (2025 年 3 月 11 日) 基金份额总额	532,434,762.81	596,685,221.21
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	1,290,093.48	7,199,104.77
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	398,470,975.27	514,185,156.19
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	135,253,881.02	89,699,169.79

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

## § 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：

浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第一次股东会会议审议通过，选举张健先生、Pierre-Axel Margulies 先生、杨志敏先生、侯林先生、林忠汉先生、袁涛先生、张弛先生、韩启蒙先生（独立董事）、赵晓菊女士（独立董事）、寇宗来先生（独立董事）和王少飞先生（独立董事）担任公司第六届董事会董事。其中，寇宗来先生、王少飞先生为新任公司独立董事。原第五届董事会成员董叶顺先生、霍佳震先生不再担任公司独立董事。具体信息请参见基金管理人于 2025 年 3 月 5 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告》。

2025 年 3 月 6 日，赵婷女士新任公司副总经理。具体信息请参见基金管理人于 2025 年 3 月 8 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》。

2025 年 3 月 18 日，浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第二次股东会会议审议通过，批准屠旋旋先生接替袁涛先生续任公司第六届董事会董事。

2025 年 6 月 26 日，浦银安盛基金管理有限公司 2025 年第三次股东会会议审议通过，免去林忠汉先生公司第六届董事会董事职务。

本报告期内，基金托管人重大人事变动如下：

中国建设银行股份有限公司（以下简称“中国建设银行”）研究决定，聘任陈颖钰为中国建设银行资产托管业务部总经理。

陈颖钰女士曾先后在中国建设银行财务会计、重组改制、资产负债、同业业务、金融科技等领域工作，并在中国建设银行总行同业业务中心、财务会计部、资产托管业务部以及山东省分行、建信金融科技有限责任公司等机构担任领导职务，具有丰富的财会、科技和资金资产管理经验。

### 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

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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受到监管部门稽查或处罚的情形。

## 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 (%)	
恒泰证券	2	1,444,732,513.37	56.15	297,706.98	57.89	-
中国银河证券	2	607,080,429.18	23.60	119,293.21	23.20	-
国泰海通证券	2	521,052,631.75	20.25	97,261.76	18.91	-

注：1. 根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发〔2019〕14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。

2. 本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。

3. 本基金管理人与选择的证券经纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。

4. 本基金选择的证券经纪商恒泰证券、中国银河证券、国泰海通证券与本公司不存在关联关

系。

5. 按照本基金与恒泰证券签订的经纪服务协议，股票佣金费率为 0.05%；按照本基金与中国银河证券签订的经纪服务协议，股票佣金费率为 0.05%；按照本基金与国泰海通证券签订的经纪服务协议，股票佣金费率为 0.05%。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。

### 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(%)
恒泰证券	-	-	399,940,000.	52.35	-	-
中国银河证券	-	-	363,996,000.	47.65	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-

### 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	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金产品资料概要	规定网站	2025 年 1 月 21 日
2	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金份额发售公告	报刊及规定网站	2025 年 1 月 21 日
3	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议	规定网站	2025 年 1 月 21 日
4	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	规定网站	2025 年 1 月 21 日
5	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书	规定网站	2025 年 1 月 21 日
6	浦银安盛基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及其他身份基本信息的公告	报刊及规定网站	2025 年 1 月 25 日
7	浦银安盛基金管理有限公司关于董事会成员换届变更的公告	报刊及规定网站	2025 年 3 月 5 日
8	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	2025 年 3 月 8 日
9	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同生效公告	报刊及规定网站	2025 年 3 月 12 日
10	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起	规定网站	2025 年 3 月 25 日

	式证券投资基金基金产品资料概要更新		
11	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（2024 年下半年度）	报刊及规定网站	2025 年 3 月 31 日
12	关于浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金在部分代销机构参加费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2025 年 4 月 10 日
13	关于浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金在部分代销机构参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2025 年 4 月 10 日
14	浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	报刊及规定网站	2025 年 4 月 10 日
15	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海联泰基金销售有限公司为代销机构并开通定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2025 年 4 月 11 日
16	浦银安盛基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝证券为代销机构并开通基金定投业务、参加其费率优惠活动的公告	报刊及规定网站	2025 年 6 月 25 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

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。

## § 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中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- 3、浦银安盛中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛中证 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

## 12.2 存放地点

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

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人网站（[www.py-axa.com](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

2025 年 8 月 30 日