

浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券 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 1 月 1 日起至 2025 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	5
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	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
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	59

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	59
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	59
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	59
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§ 8 基金份额持有人信息	60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2 期末上市基金前十名持有人	60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	61
§ 9 开放式基金份额变动	61
§ 10 重大事件揭示	61
10.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4 基金投资策略的改变	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	63
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	64
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	64
§ 12 备查文件目录	65
12.1 备查文件目录	65
12.2 存放地点	65
12.3 查阅方式	65

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	浦银安盛中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 指数基金
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	402,922,317.00 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

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	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	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	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.py-axa.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	33,417,693.38
本期利润	46,056,378.07
加权平均基金份额本期利润	0.0790
本期加权平均净值利润率	7.72%
本期基金份额净值增长率	5.81%
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	23,417,039.95
期末可供分配基金份额利润	0.0581
期末基金资产净值	426,345,267.39
期末基金份额净值	1.0581
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	5.81%

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

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣

除相关费用和信用减值损失后的余额。

- 3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 4、期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

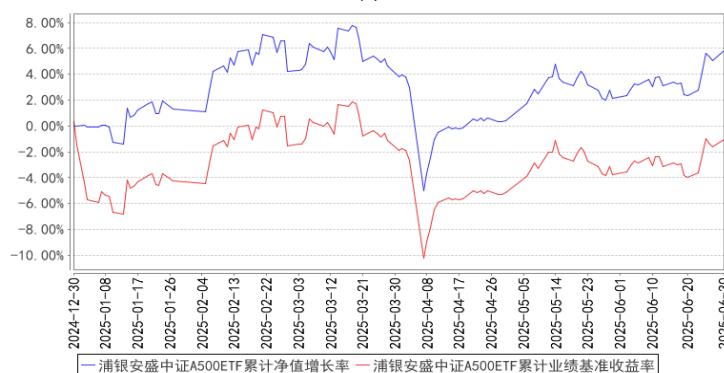
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.56%	0.59%	2.82%	0.60%	0.74%	-0.01%
过去三个月	1.92%	1.19%	0.84%	1.20%	1.08%	-0.01%
过去六个月	5.81%	1.05%	0.47%	1.10%	5.34%	-0.05%
自基金合同生效起至今	5.81%	1.04%	-1.03%	1.11%	6.84%	-0.07%

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 A500ETF 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 2024 年 12 月 30 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 2024 年 12 月 30 日至 2025 年 6 月 29 日。建仓期结束时符合相关规定。

§ 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、浦银安盛盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛普丰纯债债券型证券投资基金、浦银安盛盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安盛先进制造混合型证券投资基金、浦银安盛盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银安盛盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金

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		
宋施怡	本基金的基金经理	2024年12月30日	-	11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月加盟浦银安盛基金管理有限公司，现任指数与量化投资部基金经理。2024年3月起担任浦银安盛创业板交

					易型开放式指数证券投资基金、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的基金经理。2024 年 12 月起担任浦银安盛中证 A500 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

上半年 A 股整体表现为“哑铃型”行情，一端是以银行为代表的红利资产，另一端是微盘股，两端表现较好。上证综指上半年上涨 2.76%，中证银行上涨 12.98%，代表小微盘风格的中证 2000 上涨 15.24%，代表大盘均衡风格的中证 A500 上涨 0.47%。回顾上半年行情，1 月中上旬，A 股市场因特朗普上台后的政策不确定性下跌明显。春节期间，人形机器人登上春晚舞台、DeepSeek 爆火出圈等事件带动 A 股科技板块躁动，市场风险偏好显著提升，引发海内外资金对 A 股估值重估，春季躁动效应较强。与之伴随的是美国关税威胁反复扰动市场，TACO 交易频出。4 月 7 日，美国出台“对等关税”政策，上证综指单日大幅下跌 7.34%。当晚 A 股市场连续释放积极信号，凸显上层对资本市场的重视。中央汇金等 4 家央企宣布增持 A 股；央行称将加大再贷款支持中央汇金增持股票指数基金，平准基金概念首次被提及；多家上市公司发布回购与增持计划公告。A 股后续快速修复缺口。5 月 7 日，一行一局一会召开新闻发布会，三部门重磅政策齐出，央行一次性推出三大类共十项货币政策措施，持续提振股市信心。5 月 12 日，中美达成贸易协定，24% 的“对等关税”暂停实施 90 天，进一步提升市场情绪。6 月 18 日，陆家嘴论坛召开，提出科创板“1+6”深化改革政策，设置“科创成长层”，相关政策利好“硬科技”行业。从宏观数据来看，上半年国内经济数据超预期。一季度 GDP 同比增长 5.4%，二季度同比增速为 5.2%，宏观经济运行良好。资金面方面，保险资金成为最大增量。1 月，六部委联合印发《推动中长期资金入市工作的实施方案》，推动保险资金长期股票投资试点落地。A 股成交额显著提升，从年初的 1 万亿左右提升至 1.5 万亿左右。

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安盛中证 A500ETF 基金份额净值为 1.0581 元，本报告期基金份额净值增

长率为 5.81%；同期业绩比较基准收益率为 0.47%。

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，A 股有望在资金面的驱动下震荡上行。2025 年是居民存款到期再配置的高峰期。无风险利率的显著回落使得居民转向增配权益资产。股市的赚钱效应可能吸引更多资金进入股市。在结构上，我们认为自主可控科技+内需消费有望成为市场主线。政策端，去年底召开的中央经济工作会议确立的 2025 年九项重点任务，其中最重要的两点是提振内需消费以及科技创新引领新质生产力发展。在特朗普上台后，高额关税以及关键产品出口限制使得国产替代被迫更快推进，利好高科技领域的自主可控板块。另外，刺激内需消费是发展经济的最重要抓手，可以重点关注内需消费相关领域。海外市场方面，特朗普的大而美法案通过，叠加关税扰动，美元弱周期延续。弱美元趋势下，A 股有望迎来资金面改善的价值重估。反内卷作为近期中央最重要的政策利好龙头企业。中证 A500 作为科技+消费的宽基指数，汇集各行业龙头，在当前行业轮动较快的环境下，有望为投资者提供一键投资中国核心资产的工具性产品，充分分享 A 股上行的 Beta。

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：浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	6. 4. 7. 1	815, 301. 42	1, 505, 783, 159. 74
结算备付金		9, 159, 916. 11	1, 000, 000. 00
存出保证金		703, 540. 80	—
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	418, 145, 057. 87	—
其中：股票投资		418, 145, 057. 87	—
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		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 8	—	168, 045. 53
资产总计		428, 823, 816. 20	1, 506, 951, 205. 27
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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, 303, 788. 61	—
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		48, 753. 25	6, 175. 97
应付托管费		16, 251. 08	2, 058. 66
应付销售服务费		—	—
应付投资顾问费		—	—
应交税费		3, 905. 43	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6. 4. 7. 9	105, 850. 44	—
负债合计		2, 478, 548. 81	8, 234. 63
净资产：			

实收基金	6.4.7.10	402,922,317.00	1,506,922,317.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	23,422,950.39	20,653.64
净资产合计		426,345,267.39	1,506,942,970.64
负债和净资产总计		428,823,816.20	1,506,951,205.27

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0581 元，基金份额总额 402,922,317.00 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业收入		46,750,963.07
1. 利息收入		114,864.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	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）		32,505,381.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	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	269,984.11
股利收益	6.4.7.19	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	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	1,492,031.87
减：二、营业总支出		694,585.00
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	449,459.97
2. 托管费	6.4.10.2.2	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		975.55
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	94,329.55
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		46,056,378.07
减: 所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		46,056,378.07
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		46,056,378.07

6.3 净资产变动表

会计主体: 浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 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 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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《浦银安盛中证 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《浦银安盛中证 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 1 月 1 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

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 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业务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业务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 1) 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；且 2) 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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中（该类别次于其他所有工具类别），所有工具具有相同的特征（例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同）；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括本基金的任何影响）。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动（不包括该基金或合同的任何影响）；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

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：

(1)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。

(2)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。

(3)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

本基金本报告期内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	815,301.42
等于： 本金	815,221.69
加： 应计利息	79.73
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	815,301.42

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	405,648,493.18	—	418,145,057.87	12,496,564.69
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	405,648,493.18	-	418,145,057.87	12,496,564.69	

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	5,720,720.00	-	-	-
其中：股指期货投资	5,720,720.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,720,720.00	-	-	-

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
IC2507	中证 500 期货 2507	1.00	1,173,480.00	37,480.00
IF2507	沪深 300 期货 2507	4.00	4,689,360.00	104,640.00
合计				142,120.00
减：可抵销期货暂收款				142,120.00
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	11,630.89
预提费用	94,219.55
合计	105,850.44

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,506,922,317.00	1,506,922,317.00
本期申购	186,000,000.00	186,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-1,290,000,000.00	-1,290,000,000.00
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	402,922,317.00	402,922,317.00

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	20,653.64	-	20,653.64
本期期初	20,653.64	-	20,653.64
本期利润	33,417,693.38	12,638,684.69	46,056,378.07
本期基金份额交易产生的变动数	-10,021,307.07	-12,632,774.25	-22,654,081.32
其中：基金申购款	7,864,148.94	-461,490.47	7,402,658.47
基金赎回款	-17,885,456.01	-12,171,283.78	-30,056,739.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,417,039.95	5,910.44	23,422,950.39

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	18,087.00
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	35,800.36
其他	—
合计	53,887.36

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1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,605,052.62
股票投资收益——赎回差价收入	15,324,219.59
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	26,929,272.21

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 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	872,576,075.76
减：卖出股票成本总额	859,830,753.87
减：交易费用	1,140,269.27
买卖股票差价收入	11,605,052.62

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,320,056,739.79
减：现金支付赎回款总额	753,858,423.79
减：赎回股票成本总额	550,874,096.41
减：交易费用	—
赎回差价收入	15,324,219.59

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	269,984.11

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,306,125.49
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	5,306,125.49

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1月1日至2025年6月30日
1. 交易性金融资产	12,496,564.69
股票投资	12,496,564.69
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	142,120.00
权证投资	—
期货投资	142,120.00
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	12,638,684.69

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	—
替代损益	1,492,031.87

合计	1,492,031.87
----	--------------

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	110.00
合计	94,329.55

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

本报告期内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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人

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 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	449,459.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	63,011.98
应支付基金管理人的净管理费	386,447.99

注：支付基金管理人浦银安盛的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 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	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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

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末持有本基金。本基金《基金合同》生效日为 2024 年 12 月 30 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：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末及上年度末均未持有本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	当期利息收入
中国建设银行-活期	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

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末估值	备注

代码	券 名 称	认购 日	期	受限 类型	价格	估值 单价	(单 位: 股)	成本总额	总额	
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	1 个月内(含)	新股流通受限	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
301636	泽润新能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-

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

注：本基金本报告期末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

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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、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及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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》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 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
资产					
货币资金	815,301.42	-	-	-	815,301.42
结算备付金	9,159,916.11	-	-	-	9,159,916.11
存出保证金	703,540.80	-	-	-	703,540.80
交易性金融资产	-	-	-418,145,057.87	418,145,057.87	418,145,057.87
资产总计	10,678,758.33	-	-418,145,057.87	428,823,816.20	
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	48,753.25	48,753.25
应付托管费	-	-	-	16,251.08	16,251.08
应付清算款	-	-	-	2,303,788.61	2,303,788.61
应交税费	-	-	-	3,905.43	3,905.43
其他负债	-	-	-	105,850.44	105,850.44
负债总计	-	-	-2,478,548.81	2,478,548.81	

利率敏感度缺口	10,678,758.33	-	-	415,666,509.06	426,345,267.39
上年度末 2024 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	1,505,783,159.74	-	-	-	1,505,783,159.74
结算备付金	1,000,000.00	-	-	-	1,000,000.00
其他资产	-	-	-	168,045.53	168,045.53
资产总计	1,506,783,159.74	-	-	168,045.53	1,506,951,205.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	6,175.97	6,175.97
应付托管费	-	-	-	2,058.66	2,058.66
负债总计	-	-	-	8,234.63	8,234.63
利率敏感度缺口	1,506,783,159.74	-	-	159,810.90	1,506,942,970.64

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，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2024 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（2024 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 2025年6月30日		上年度末 2024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	418,145,057.87	98.08	—	—
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	418,145,057.87	98.08	—	—

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）	上年度末（2024年12月31日）
	业绩比较基准上升500基点	20,092,600.11	—
	业绩比较基准下降500基点	-20,092,600.11	—

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	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	418,107,711.81	-
第二层次	15,385.54	-
第三层次	21,960.52	-
合计	418,145,057.87	-

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(2024 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 2025 年 06 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	418,145,057.87	97.51
	其中：股票	418,145,057.87	97.51
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	9,975,217.53	2.33
8	其他各项资产	703,540.80	0.16
9	合计	428,823,816.20	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	2,281,740.00	0.54
B	采矿业	21,159,513.00	4.96
C	制造业	243,131,552.46	57.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,879,968.00	3.02
E	建筑业	7,961,322.00	1.87
F	批发和零售业	2,959,354.00	0.69
G	交通运输、仓储和邮政业	14,592,384.00	3.42
H	住宿和餐饮业	366,783.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,424,898.75	6.43
J	金融业	67,618,239.00	15.86
K	房地产业	4,371,513.00	1.03
L	租赁和商务服务业	4,627,684.60	1.09
M	科学研究和技术服务业	4,617,559.00	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	923,816.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	275,706.00	0.06
Q	卫生和社会工作	1,603,696.00	0.38
R	文化、体育和娱乐业	1,311,983.00	0.31
S	综合	-	-
	合计	418,107,711.81	98.07

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	37,346.06	0.01
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	-	-
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	37,346.06	0.01

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	11,600	16,350,432.00	3.84
2	300750	宁德时代	48,400	12,207,448.00	2.86
3	601318	中国平安	196,200	10,885,176.00	2.55
4	600036	招商银行	225,500	10,361,725.00	2.43
5	601166	兴业银行	302,900	7,069,686.00	1.66
6	600900	长江电力	223,000	6,721,220.00	1.58
7	000333	美的集团	89,800	6,483,560.00	1.52
8	601899	紫金矿业	300,300	5,855,850.00	1.37

9	002594	比亚迪	16,300	5,410,133.00	1.27
10	300059	东方财富	230,000	5,319,900.00	1.25
11	600030	中信证券	177,500	4,902,550.00	1.15
12	601398	工商银行	638,400	4,845,456.00	1.14
13	000858	五粮液	35,600	4,232,840.00	0.99
14	600276	恒瑞医药	81,200	4,214,280.00	0.99
15	601328	交通银行	486,200	3,889,600.00	0.91
16	000651	格力电器	81,500	3,660,980.00	0.86
17	601288	农业银行	581,700	3,420,396.00	0.80
18	600887	伊利股份	115,500	3,220,140.00	0.76
19	688981	中芯国际	36,370	3,206,742.90	0.75
20	002475	立讯精密	92,400	3,205,356.00	0.75
21	600919	江苏银行	267,300	3,191,562.00	0.75
22	603259	药明康德	45,200	3,143,660.00	0.74
23	601816	京沪高铁	535,300	3,077,975.00	0.72
24	600000	浦发银行	213,800	2,967,544.00	0.70
25	002371	北方华创	6,300	2,785,923.00	0.65
26	000725	京东方 A	669,400	2,670,906.00	0.63
27	300760	迈瑞医疗	11,200	2,517,200.00	0.59
28	688041	海光信息	17,515	2,474,694.35	0.58
29	601088	中国神华	60,500	2,452,670.00	0.58
30	601601	中国太保	62,600	2,348,126.00	0.55
31	300308	中际旭创	16,000	2,333,760.00	0.55
32	300502	新易盛	17,820	2,263,496.40	0.53
33	300124	汇川技术	34,700	2,240,579.00	0.53
34	601728	中国电信	282,600	2,190,150.00	0.51
35	601668	中国建筑	376,800	2,174,136.00	0.51
36	000001	平安银行	176,500	2,130,355.00	0.50
37	002352	顺丰控股	43,600	2,125,936.00	0.50
38	688256	寒武纪	3,509	2,110,663.50	0.50
39	002714	牧原股份	50,000	2,100,500.00	0.49
40	002230	科大讯飞	42,000	2,010,960.00	0.47
41	601127	赛力斯	14,800	1,987,936.00	0.47
42	603501	豪威集团	15,400	1,965,810.00	0.46
43	600031	三一重工	107,900	1,936,805.00	0.45
44	000063	中兴通讯	58,400	1,897,416.00	0.45
45	600309	万华化学	34,600	1,877,396.00	0.44
46	603019	中科曙光	26,600	1,872,640.00	0.44
47	002415	海康威视	67,200	1,863,456.00	0.44
48	600941	中国移动	16,300	1,834,565.00	0.43
49	300274	阳光电源	26,400	1,789,128.00	0.42
50	601857	中国石油	206,800	1,768,140.00	0.41
51	688008	澜起科技	21,196	1,738,072.00	0.41

52	601919	中远海控	115,100	1,731,104.00	0.41
53	600690	海尔智家	68,200	1,689,996.00	0.40
54	601012	隆基绿能	110,200	1,655,204.00	0.39
55	600660	福耀玻璃	29,000	1,653,290.00	0.39
56	600406	国电南瑞	73,500	1,647,135.00	0.39
57	601766	中国中车	221,800	1,561,472.00	0.37
58	603986	兆易创新	12,200	1,543,666.00	0.36
59	600050	中国联通	285,200	1,522,968.00	0.36
60	000568	泸州老窖	13,400	1,519,560.00	0.36
61	000338	潍柴动力	98,300	1,511,854.00	0.35
62	600028	中国石化	265,700	1,498,548.00	0.35
63	300476	胜宏科技	11,100	1,491,618.00	0.35
64	000100	TCL 科技	342,200	1,481,726.00	0.35
65	601988	中国银行	261,000	1,466,820.00	0.34
66	601006	大秦铁路	220,500	1,455,300.00	0.34
67	601985	中国核电	149,600	1,394,272.00	0.33
68	601225	陕西煤业	70,400	1,354,496.00	0.32
69	600104	上汽集团	84,100	1,349,805.00	0.32
70	002027	分众传媒	184,200	1,344,660.00	0.32
71	688012	中微公司	7,350	1,339,905.00	0.31
72	600150	中国船舶	40,700	1,324,378.00	0.31
73	600418	江淮汽车	31,500	1,262,835.00	0.30
74	601628	中国人寿	30,100	1,239,819.00	0.29
75	600760	中航沈飞	20,500	1,201,710.00	0.28
76	600436	片仔癀	6,000	1,200,060.00	0.28
77	603288	海天味业	30,200	1,175,082.00	0.28
78	000425	徐工机械	149,600	1,162,392.00	0.27
79	600111	北方稀土	46,500	1,157,850.00	0.27
80	000625	长安汽车	90,600	1,156,056.00	0.27
81	000792	盐湖股份	67,400	1,151,192.00	0.27
82	600938	中国海油	43,300	1,130,563.00	0.27
83	605499	东鹏饮料	3,570	1,121,158.50	0.26
84	600905	三峡能源	260,900	1,111,434.00	0.26
85	600089	特变电工	92,100	1,098,753.00	0.26
86	601658	邮储银行	200,700	1,097,829.00	0.26
87	688111	金山办公	3,914	1,096,115.70	0.26
88	002625	光启技术	27,400	1,095,452.00	0.26
89	688271	联影医疗	8,464	1,081,191.36	0.25
90	603993	洛阳钼业	128,300	1,080,286.00	0.25
91	002050	三花智控	40,700	1,073,666.00	0.25
92	601888	中国中免	17,500	1,066,975.00	0.25
93	600547	山东黄金	33,300	1,063,269.00	0.25
94	600048	保利发展	130,900	1,060,290.00	0.25

95	300015	爱尔眼科	84,600	1,055,808.00	0.25
96	600019	宝钢股份	159,600	1,051,764.00	0.25
97	601390	中国中铁	186,900	1,048,509.00	0.25
98	002463	沪电股份	24,600	1,047,468.00	0.25
99	600415	小商品城	50,100	1,036,068.00	0.24
100	300014	亿纬锂能	22,600	1,035,306.00	0.24
101	002241	歌尔股份	44,200	1,030,744.00	0.24
102	601600	中国铝业	144,500	1,017,280.00	0.24
103	300033	同花顺	3,700	1,010,137.00	0.24
104	601989	中国重工	208,000	965,120.00	0.23
105	002179	中航光电	23,400	944,424.00	0.22
106	002384	东山精密	25,000	944,250.00	0.22
107	600893	航发动力	24,400	940,376.00	0.22
108	000977	浪潮信息	18,400	936,192.00	0.22
109	600585	海螺水泥	43,500	933,945.00	0.22
110	600570	恒生电子	27,500	922,350.00	0.22
111	603799	华友钴业	24,900	921,798.00	0.22
112	000538	云南白药	16,100	898,219.00	0.21
113	000938	紫光股份	36,700	880,433.00	0.21
114	600584	长电科技	26,100	879,309.00	0.21
115	601727	上海电气	115,500	853,545.00	0.20
116	000988	华工科技	18,000	846,180.00	0.20
117	002028	思源电气	11,500	838,465.00	0.20
118	600438	通威股份	49,400	827,450.00	0.19
119	300408	三环集团	24,600	821,640.00	0.19
120	002049	紫光国微	12,400	816,664.00	0.19
121	300433	蓝思科技	36,500	813,950.00	0.19
122	000002	万科 A	123,700	794,154.00	0.19
123	600795	国电电力	162,300	785,532.00	0.18
124	600489	中金黄金	53,000	775,390.00	0.18
125	601669	中国电建	157,000	764,590.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	30,100	748,888.00	0.18
127	002422	科伦药业	20,700	743,544.00	0.17
128	601689	拓普集团	15,700	741,825.00	0.17
129	600010	包钢股份	412,400	738,196.00	0.17
130	300339	润和软件	14,400	731,952.00	0.17
131	600009	上海机场	22,900	727,533.00	0.17
132	002456	欧菲光	61,000	722,850.00	0.17
133	601100	恒立液压	10,000	720,000.00	0.17
134	600160	巨化股份	24,700	708,396.00	0.17
135	002460	赣锋锂业	20,900	705,793.00	0.17
136	300394	天孚通信	8,760	699,398.40	0.16
137	000768	中航西飞	25,400	694,436.00	0.16

138	600183	生益科技	22,400	675,360.00	0.16
139	601186	中国铁建	83,600	669,636.00	0.16
140	002252	上海莱士	96,500	662,955.00	0.16
141	002074	国轩高科	20,300	658,938.00	0.15
142	000157	中联重科	90,600	655,038.00	0.15
143	600839	四川长虹	67,200	653,184.00	0.15
144	601360	三六零	63,900	651,780.00	0.15
145	600989	宝丰能源	40,100	647,214.00	0.15
146	600886	国投电力	43,500	641,190.00	0.15
147	000963	华东医药	15,800	637,688.00	0.15
148	000661	长春高新	6,400	634,752.00	0.15
149	601058	赛轮轮胎	48,200	632,384.00	0.15
150	600115	中国东航	156,100	629,083.00	0.15
151	300442	润泽科技	12,600	624,078.00	0.15
152	688036	传音控股	7,808	622,297.60	0.15
153	000807	云铝股份	38,000	607,240.00	0.14
154	000408	藏格矿业	14,200	605,914.00	0.14
155	600066	宇通客车	24,300	604,098.00	0.14
156	002517	恺英网络	30,900	596,679.00	0.14
157	300661	圣邦股份	8,190	595,986.30	0.14
158	002001	新和成	27,900	593,433.00	0.14
159	002466	天齐锂业	18,500	592,740.00	0.14
160	002340	格林美	93,300	592,455.00	0.14
161	600196	复星医药	23,400	587,106.00	0.14
162	600426	华鲁恒升	27,000	585,090.00	0.14
163	002558	巨人网络	24,800	584,040.00	0.14
164	002195	岩山科技	103,700	583,831.00	0.14
165	301236	软通动力	10,600	579,184.00	0.14
166	001979	招商蛇口	66,000	578,820.00	0.14
167	600029	南方航空	97,900	577,610.00	0.14
168	601800	中国交建	64,900	576,961.00	0.14
169	002236	大华股份	36,300	576,444.00	0.14
170	600674	川投能源	35,800	574,232.00	0.13
171	002156	通富微电	22,400	573,888.00	0.13
172	600011	华能国际	80,100	571,914.00	0.13
173	000975	山金国际	30,100	570,094.00	0.13
174	688126	沪硅产业	29,767	557,238.24	0.13
175	600487	亨通光电	36,200	553,860.00	0.13
176	600346	恒力石化	38,500	549,010.00	0.13
177	688169	石头科技	3,454	540,723.70	0.13
178	300207	欣旺达	26,900	539,614.00	0.13
179	601111	中国国航	68,200	538,098.00	0.13
180	600460	士兰微	21,500	533,630.00	0.13

181	300251	光线传媒	26,300	533,101.00	0.13
182	300418	昆仑万维	15,800	531,354.00	0.12
183	600372	中航机载	43,800	528,228.00	0.12
184	601868	中国能建	236,400	527,172.00	0.12
185	002648	卫星化学	30,400	526,832.00	0.12
186	600745	闻泰科技	15,700	526,421.00	0.12
187	000066	中国长城	35,500	525,400.00	0.12
188	003816	中国广核	143,500	522,340.00	0.12
189	600096	云天化	23,400	514,098.00	0.12
190	300782	卓胜微	7,200	513,864.00	0.12
191	601021	春秋航空	9,200	511,980.00	0.12
192	300347	泰格医药	9,600	511,872.00	0.12
193	601117	中国化学	66,700	511,589.00	0.12
194	302132	中航成飞	5,800	510,052.00	0.12
195	002465	海格通信	36,400	507,416.00	0.12
196	002273	水晶光电	25,400	507,238.00	0.12
197	300450	先导智能	20,400	506,940.00	0.12
198	600879	航天电子	48,400	506,748.00	0.12
199	600741	华域汽车	28,600	504,790.00	0.12
200	601319	中国人保	57,900	504,309.00	0.12
201	601168	西部矿业	30,200	502,226.00	0.12
202	600588	用友网络	37,500	501,375.00	0.12
203	600256	广汇能源	82,600	497,252.00	0.12
204	600176	中国巨石	43,500	495,900.00	0.12
205	601633	长城汽车	23,000	494,040.00	0.12
206	688213	思特威	4,800	490,656.00	0.12
207	002920	德赛西威	4,800	490,224.00	0.11
208	002601	龙佰集团	30,200	489,542.00	0.11
209	002916	深南电路	4,540	489,457.40	0.11
210	000831	中国稀土	13,500	487,620.00	0.11
211	600219	南山铝业	127,300	487,559.00	0.11
212	002294	信立泰	10,300	487,499.00	0.11
213	688608	恒玄科技	1,400	487,172.00	0.11
214	688777	中控技术	10,826	486,195.66	0.11
215	002555	三七互娱	28,100	485,849.00	0.11
216	600352	浙江龙盛	47,800	485,648.00	0.11
217	600482	中国动力	20,900	482,163.00	0.11
218	000786	北新建材	18,200	481,936.00	0.11
219	600885	宏发股份	21,560	481,003.60	0.11
220	688235	百济神州	2,047	478,261.08	0.11
221	688120	华海清科	2,827	476,914.90	0.11
222	000933	神火股份	28,600	475,904.00	0.11
223	002185	华天科技	47,100	475,710.00	0.11

224	300017	网宿科技	44,300	474,896.00	0.11
225	600039	四川路桥	47,900	474,210.00	0.11
226	000630	铜陵有色	140,200	468,268.00	0.11
227	002493	荣盛石化	55,200	457,056.00	0.11
228	300223	北京君正	6,600	456,720.00	0.11
229	300896	爱美客	2,600	454,506.00	0.11
230	300474	景嘉微	6,200	452,600.00	0.11
231	600085	同仁堂	12,500	450,750.00	0.11
232	002595	豪迈科技	7,600	450,072.00	0.11
233	002129	TCL中环	58,600	450,048.00	0.11
234	002281	光迅科技	9,100	448,812.00	0.11
235	001965	招商公路	37,400	448,800.00	0.11
236	688617	惠泰医疗	1,508	447,876.00	0.11
237	603392	万泰生物	7,300	445,300.00	0.10
238	000423	东阿阿胶	8,500	444,550.00	0.10
239	002709	天赐材料	24,500	443,940.00	0.10
240	600362	江西铜业	18,600	435,798.00	0.10
241	688002	睿创微纳	6,244	435,331.68	0.10
242	601877	正泰电器	19,200	435,264.00	0.10
243	300122	智飞生物	22,100	432,939.00	0.10
244	002130	沃尔核材	18,100	431,142.00	0.10
245	002131	利欧股份	123,100	430,850.00	0.10
246	002085	万丰奥威	27,000	429,030.00	0.10
247	688396	华润微	9,090	428,684.40	0.10
248	603596	伯特利	8,100	426,789.00	0.10
249	300832	新产业	7,500	425,400.00	0.10
250	300002	神州泰岳	36,000	424,800.00	0.10
251	002738	中矿资源	13,200	424,512.00	0.10
252	002532	天山铝业	51,000	423,810.00	0.10
253	300058	蓝色光标	64,560	423,513.60	0.10
254	600161	天坛生物	21,900	420,261.00	0.10
255	002472	双环传动	12,400	415,276.00	0.10
256	688506	百利天恒	1,400	414,568.00	0.10
257	002128	电投能源	20,800	411,424.00	0.10
258	002180	纳思达	17,900	410,626.00	0.10
259	002138	顺络电子	14,600	410,552.00	0.10
260	300866	安克创新	3,600	408,960.00	0.10
261	300395	菲利华	8,000	408,800.00	0.10
262	603606	东方电缆	7,900	408,509.00	0.10
263	002078	太阳纸业	30,300	407,838.00	0.10
264	002938	鹏鼎控股	12,700	406,781.00	0.10
265	300496	中科创达	7,100	406,262.00	0.10
266	300454	深信服	4,300	404,974.00	0.09

267	000301	东方盛虹	48,500	404,005.00	0.09
268	688122	西部超导	7,784	403,833.92	0.09
269	002436	兴森科技	30,500	403,820.00	0.09
270	688099	晶晨股份	5,659	401,845.59	0.09
271	300346	南大光电	12,680	401,195.20	0.09
272	002410	广联达	29,900	400,959.00	0.09
273	600233	圆通速递	31,100	400,879.00	0.09
274	600143	金发科技	38,500	396,935.00	0.09
275	002353	杰瑞股份	11,300	395,500.00	0.09
276	000034	神州数码	10,500	395,220.00	0.09
277	002223	鱼跃医疗	11,100	395,160.00	0.09
278	300024	机器人	23,000	395,140.00	0.09
279	600862	中航高科	15,100	393,808.00	0.09
280	300759	康龙化成	16,000	392,640.00	0.09
281	600188	兖矿能源	32,200	391,874.00	0.09
282	002065	东华软件	40,800	391,680.00	0.09
283	300054	鼎龙股份	13,600	390,048.00	0.09
284	300136	信维通信	17,400	389,760.00	0.09
285	603129	春风动力	1,800	389,700.00	0.09
286	601618	中国中冶	130,200	387,996.00	0.09
287	002202	金风科技	37,800	387,450.00	0.09
288	601615	明阳智能	33,500	384,915.00	0.09
289	603087	甘李药业	7,000	383,460.00	0.09
290	000999	华润三九	12,230	382,554.40	0.09
291	688223	晶科能源	73,386	380,873.34	0.09
292	688072	拓荆科技	2,475	380,432.25	0.09
293	300604	长川科技	8,400	377,244.00	0.09
294	002271	东方雨虹	35,100	376,623.00	0.09
295	002624	完美世界	24,800	376,216.00	0.09
296	300383	光环新网	26,200	374,660.00	0.09
297	605117	德业股份	7,040	370,726.40	0.09
298	002008	大族激光	15,200	370,424.00	0.09
299	000733	振华科技	7,400	370,370.00	0.09
300	600515	海南机场	104,200	368,868.00	0.09
301	600845	宝信软件	15,600	368,472.00	0.09
302	002405	四维图新	43,000	367,220.00	0.09
303	601872	招商轮船	58,500	366,210.00	0.09
304	002459	晶澳科技	36,400	363,272.00	0.09
305	600895	张江高科	14,100	362,370.00	0.08
306	002155	湖南黄金	20,300	362,355.00	0.08
307	000426	兴业银锡	22,900	361,820.00	0.08
308	300459	汤姆猫	64,200	359,520.00	0.08
309	603659	璞泰来	19,100	358,698.00	0.08

310	600549	厦门钨业	17,100	357,732.00	0.08
311	300627	华测导航	10,180	356,300.00	0.08
312	300012	华测检测	30,400	355,376.00	0.08
313	688578	艾力斯	3,800	353,552.00	0.08
314	688047	龙芯中科	2,634	351,349.26	0.08
315	688599	天合光能	23,884	347,034.52	0.08
316	300037	新宙邦	9,800	344,960.00	0.08
317	605589	圣泉集团	12,400	344,100.00	0.08
318	300699	光威复材	10,800	342,036.00	0.08
319	601216	君正集团	61,800	341,136.00	0.08
320	603605	珀莱雅	4,100	339,439.00	0.08
321	000519	中兵红箭	15,500	339,295.00	0.08
322	300253	卫宁健康	31,900	338,140.00	0.08
323	300073	当升科技	7,700	337,799.00	0.08
324	600332	白云山	12,800	337,408.00	0.08
325	600392	盛和资源	25,600	337,152.00	0.08
326	603979	金诚信	7,200	334,368.00	0.08
327	002444	巨星科技	13,100	334,181.00	0.08
328	000617	中油资本	45,700	333,610.00	0.08
329	000932	华菱钢铁	75,800	333,520.00	0.08
330	688266	泽璟制药	3,100	333,281.00	0.08
331	300003	乐普医疗	24,100	332,098.00	0.08
332	300628	亿联网络	9,500	330,220.00	0.08
333	603260	合盛硅业	6,900	327,060.00	0.08
334	300316	晶盛机电	12,000	325,800.00	0.08
335	000878	云南铜业	25,600	325,632.00	0.08
336	600153	建发股份	31,400	325,618.00	0.08
337	002389	航天彩虹	12,700	325,120.00	0.08
338	601233	桐昆股份	30,400	322,240.00	0.08
339	300001	特锐德	13,400	321,198.00	0.08
340	002007	华兰生物	20,400	319,668.00	0.07
341	300142	沃森生物	29,000	319,000.00	0.07
342	002812	恩捷股份	10,800	316,332.00	0.07
343	002414	高德红外	30,800	315,700.00	0.07
344	600803	新奥股份	16,700	315,630.00	0.07
345	688180	君实生物	9,183	312,038.34	0.07
346	300568	星源材质	24,600	311,928.00	0.07
347	600118	中国卫星	10,900	311,413.00	0.07
348	600316	洪都航空	8,200	309,140.00	0.07
349	600699	均胜电子	17,700	308,688.00	0.07
350	002152	广电运通	22,900	307,776.00	0.07
351	600177	雅戈尔	42,000	306,600.00	0.07
352	600521	华海药业	16,300	303,669.00	0.07

353	600398	海澜之家	43,500	302,760.00	0.07
354	600038	中直股份	7,800	302,718.00	0.07
355	300315	掌趣科技	49,800	302,286.00	0.07
356	601238	广汽集团	40,300	301,847.00	0.07
357	002821	凯莱英	3,400	300,050.00	0.07
358	601799	星宇股份	2,400	300,000.00	0.07
359	000738	航发控制	14,400	298,800.00	0.07
360	600704	物产中大	56,500	297,755.00	0.07
361	000009	中国宝安	33,500	297,480.00	0.07
362	300413	芒果超媒	13,600	296,752.00	0.07
363	600497	驰宏锌锗	55,500	293,595.00	0.07
364	002318	久立特材	12,500	292,375.00	0.07
365	002044	美年健康	56,800	291,952.00	0.07
366	000623	吉林敖东	17,200	291,540.00	0.07
367	600018	上港集团	51,000	291,210.00	0.07
368	300919	中伟股份	8,800	289,344.00	0.07
369	601567	三星医疗	12,900	289,218.00	0.07
370	600141	兴发集团	14,000	287,420.00	0.07
371	600765	中航重机	17,000	286,960.00	0.07
372	601677	明泰铝业	22,900	284,418.00	0.07
373	000400	许继电气	13,000	283,010.00	0.07
374	002607	中公教育	90,100	275,706.00	0.06
375	600637	东方明珠	36,900	275,643.00	0.06
376	603939	益丰药房	11,200	274,064.00	0.06
377	600498	烽火通信	13,000	273,390.00	0.06
378	002841	视源股份	7,900	273,340.00	0.06
379	002245	蔚蓝锂芯	21,300	273,279.00	0.06
380	000960	锡业股份	17,700	270,810.00	0.06
381	600529	山东药玻	12,200	270,108.00	0.06
382	601607	上海医药	15,100	269,988.00	0.06
383	300088	长信科技	45,200	269,392.00	0.06
384	300182	捷成股份	48,800	268,888.00	0.06
385	301358	湖南裕能	8,600	268,234.00	0.06
386	002407	多氟多	22,000	268,180.00	0.06
387	002409	雅克科技	4,900	267,981.00	0.06
388	000039	中集集团	33,900	266,454.00	0.06
389	002739	万达电影	23,300	266,319.00	0.06
390	600026	中远海能	25,400	262,382.00	0.06
391	300724	捷佳伟创	4,800	260,640.00	0.06
392	601018	宁波港	70,600	258,396.00	0.06
393	300068	南都电源	16,200	257,904.00	0.06
394	688188	柏楚电子	1,955	257,395.30	0.06
395	600763	通策医疗	6,200	255,936.00	0.06

396	300757	罗博特科	1,700	254,949.00	0.06
397	300285	国瓷材料	14,500	251,575.00	0.06
398	000887	中鼎股份	14,300	251,537.00	0.06
399	600563	法拉电子	2,300	250,907.00	0.06
400	300558	贝达药业	4,300	249,185.00	0.06
401	600820	隧道股份	40,100	244,610.00	0.06
402	688009	中国通号	47,535	244,329.90	0.06
403	300144	宋城演艺	28,500	243,675.00	0.06
404	600486	扬农化工	4,200	243,600.00	0.06
405	002497	雅化集团	21,300	242,820.00	0.06
406	603806	福斯特	18,700	242,352.00	0.06
407	600008	首创环保	80,200	242,204.00	0.06
408	002025	航天电器	4,700	241,627.00	0.06
409	002312	川发龙蟒	21,000	241,080.00	0.06
410	300296	利亚德	39,500	240,950.00	0.06
411	002064	华峰化学	36,400	240,604.00	0.06
412	603568	伟明环保	12,500	238,500.00	0.06
413	600516	方大炭素	51,400	238,496.00	0.06
414	002432	九安医疗	6,500	236,795.00	0.06
415	600166	福田汽车	86,900	235,499.00	0.06
416	300763	锦浪科技	4,100	235,299.00	0.06
417	688303	大全能源	11,016	234,861.12	0.06
418	603816	顾家家居	9,200	234,784.00	0.06
419	600998	九州通	45,600	234,384.00	0.05
420	605358	立昂微	10,000	233,000.00	0.05
421	600170	上海建工	96,900	231,591.00	0.05
422	601179	中国西电	37,500	230,250.00	0.05
423	600208	衢州发展	77,600	229,696.00	0.05
424	000683	博源化工	47,800	228,962.00	0.05
425	603486	科沃斯	3,900	227,097.00	0.05
426	600312	平高电气	14,700	226,233.00	0.05
427	600323	瀚蓝环境	9,200	224,020.00	0.05
428	002176	江特电机	30,800	223,608.00	0.05
429	002244	滨江集团	22,900	223,275.00	0.05
430	601155	新城控股	16,300	222,984.00	0.05
431	603613	国联股份	9,400	222,686.00	0.05
432	601000	唐山港	53,900	218,834.00	0.05
433	000830	鲁西化工	21,200	218,360.00	0.05
434	000629	钒钛股份	84,400	216,064.00	0.05
435	000818	航锦科技	9,600	216,000.00	0.05
436	603885	吉祥航空	15,900	214,173.00	0.05
437	300676	华大基因	4,300	214,011.00	0.05
438	002603	以岭药业	15,100	212,910.00	0.05

439	600511	国药股份	7,300	212,868.00	0.05
440	000708	中信特钢	18,100	212,856.00	0.05
441	600535	天士力	13,600	212,840.00	0.05
442	002439	启明星辰	13,200	211,068.00	0.05
443	600499	科达制造	21,300	208,740.00	0.05
444	603000	人民网	10,300	208,163.00	0.05
445	300567	精测电子	3,400	206,074.00	0.05
446	300390	天华新能	10,800	205,956.00	0.05
447	603899	晨光股份	7,100	205,829.00	0.05
448	601880	辽港股份	136,400	204,600.00	0.05
449	002145	中核钛白	48,800	202,520.00	0.05
450	002756	永兴材料	6,300	200,025.00	0.05
451	600004	白云机场	21,900	199,290.00	0.05
452	000563	陕国投 A	55,700	198,849.00	0.05
453	600655	豫园股份	35,800	198,690.00	0.05
454	600859	王府井	14,300	198,627.00	0.05
455	000547	航天发展	23,500	197,400.00	0.05
456	600131	国网信通	11,100	196,470.00	0.05
457	603077	和邦生物	112,000	196,000.00	0.05
458	600325	华发股份	40,100	195,287.00	0.05
459	601966	玲珑轮胎	13,300	195,111.00	0.05
460	300529	健帆生物	9,000	194,130.00	0.05
461	600754	锦江酒店	8,600	192,984.00	0.05
462	300438	鹏辉能源	6,800	187,748.00	0.04
463	688005	容百科技	8,400	187,488.00	0.04
464	300601	康泰生物	12,300	186,837.00	0.04
465	002544	普天科技	7,800	182,910.00	0.04
466	000998	隆平高科	18,400	181,240.00	0.04
467	300070	碧水源	39,600	178,200.00	0.04
468	600867	通化东宝	21,700	177,940.00	0.04
469	002120	韵达股份	26,400	176,880.00	0.04
470	600667	太极实业	26,800	176,344.00	0.04
471	601866	中远海发	71,300	176,111.00	0.04
472	603833	欧派家居	3,100	174,995.00	0.04
473	000032	深桑达 A	8,600	173,978.00	0.04
474	600258	首旅酒店	12,300	173,799.00	0.04
475	300457	赢合科技	7,500	172,500.00	0.04
476	002508	老板电器	8,900	169,189.00	0.04
477	002831	裕同科技	7,200	168,624.00	0.04
478	300751	迈为股份	2,400	166,944.00	0.04
479	000069	华侨城 A	73,600	165,600.00	0.04
480	000967	盈峰环境	23,300	161,935.00	0.04
481	600129	太极集团	7,500	159,825.00	0.04

482	300118	东方日升	16,400	157,112.00	0.04
483	002292	奥飞娱乐	16,000	155,520.00	0.04
484	300573	兴齐眼药	2,940	152,262.60	0.04
485	002572	索菲亚	10,700	149,907.00	0.04
486	002266	浙富控股	47,900	147,532.00	0.03
487	601636	旗滨集团	29,200	146,292.00	0.03
488	600315	上海家化	6,600	139,062.00	0.03
489	600864	哈投股份	23,000	137,310.00	0.03
490	000035	中国天楹	31,600	135,564.00	0.03
491	603650	彤程新材	4,100	131,815.00	0.03
492	688063	派能科技	2,855	128,703.40	0.03
493	002091	江苏国泰	17,500	127,225.00	0.03
494	300769	德方纳米	3,800	125,476.00	0.03
495	688390	固德威	2,880	125,136.00	0.03
496	002372	伟星新材	11,700	121,212.00	0.03
497	001914	招商积余	8,100	100,197.00	0.02
498	600335	国机汽车	11,000	70,950.00	0.02
499	600007	中国国贸	3,400	69,972.00	0.02
500	301381	赛维时代	2,100	41,895.00	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	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
2	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
3	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
4	301595	太力科技	196	5,703.60	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	79,839,009.00	5.30
2	300750	宁德时代	49,116,508.80	3.26
3	601318	中国平安	42,869,589.00	2.84
4	600036	招商银行	38,871,203.76	2.58
5	600900	长江电力	27,959,100.64	1.86
6	000333	美的集团	26,966,038.48	1.79
7	601166	兴业银行	23,529,369.00	1.56
8	600030	中信证券	21,166,790.25	1.40
9	601899	紫金矿业	21,004,514.00	1.39
10	300059	东方财富	19,725,533.00	1.31
11	000858	五粮液	19,194,174.00	1.27

12	601398	工商银行	18,691,079.00	1.24
13	002371	北方华创	17,444,583.00	1.16
14	002594	比亚迪	16,672,137.00	1.11
15	688981	中芯国际	15,410,718.57	1.02
16	600276	恒瑞医药	15,323,294.96	1.02
17	688041	海光信息	15,032,121.12	1.00
18	600887	伊利股份	14,738,541.84	0.98
19	601328	交通银行	14,463,068.00	0.96
20	000651	格力电器	14,457,542.00	0.96

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	63,656,291.11	4.22
2	601318	中国平安	33,103,601.50	2.20
3	600036	招商银行	30,878,991.12	2.05
4	600900	长江电力	21,334,620.00	1.42
5	601166	兴业银行	17,849,983.00	1.18
6	601899	紫金矿业	16,570,140.00	1.10
7	600030	中信证券	16,565,363.40	1.10
8	601398	工商银行	14,320,409.00	0.95
9	688981	中芯国际	12,707,660.04	0.84
10	600276	恒瑞医药	12,181,030.80	0.81
11	688041	海光信息	12,087,104.47	0.80
12	600887	伊利股份	11,086,028.00	0.74
13	601328	交通银行	10,636,394.00	0.71
14	601816	京沪高铁	10,242,346.00	0.68
15	601288	农业银行	9,929,920.00	0.66
16	600436	片仔癀	9,052,825.00	0.60
17	600309	万华化学	8,691,905.00	0.58
18	600919	江苏银行	8,569,116.00	0.57
19	603259	药明康德	8,407,450.32	0.56
20	601088	中国神华	8,374,990.51	0.56

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	1,734,701,890.46
卖出股票收入（成交）总额	872,576,075.76

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，兴业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福建监管局的处罚。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	703,540.80
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	703,540.80

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：本基金本报告期末不存在指数投资前十名股票流通受限情况。

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	001388	信通电子	13,842.06	0.00	新股流通受限
1	001388	信通电子	1,543.48	0.00	新股锁定
2	301590	优优绿能	10,182.04	0.00	新股锁定
3	301636	泽润新能	6,074.88	0.00	新股锁定
4	301595	太力科技	5,703.60	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 (%)
1,142	352,821.64	364,746,481.00	90.53	38,175,836.00	9.47

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例(%)
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司一分 红-个人分红	127,744,100.00	31.70

2	中国人寿保险股份有限公司	100,017,749.00	24.82
3	国泰海通证券股份有限公司	54,000,000.00	13.40
4	万柏私募基金管理有限公司-万柏繁盛 5 号私募证券投资基金	27,000,000.00	6.70
5	中信建投证券股份有限公司	11,519,098.00	2.86
6	上海市肆号职业年金计划-浦发银行	9,727,924.00	2.41
7	华泰证券股份有限公司	8,484,191.00	2.11
8	上海恒太投资管理合伙企业(有限合伙)-恒太港湾一号私募证券投资基金	7,666,600.00	1.90
9	上海国际信托有限公司	6,256,100.00	1.55
10	中信证券股份有限公司	5,430,120.00	1.35

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例(%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.00

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位: 份

基金合同生效日(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	1,506,922,317.00
本报告期基金总申购份额	186,000,000.00
减: 本报告期基金总赎回份额	1,290,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	402,922,317.00

§ 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:

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，基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

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，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
华鑫证券	4	2,607,121,89 5.30	100.00	541,320.93	100.00	-

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中泰证券、上海证券与本公司不存在关联关系。
5. 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。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例(%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例(%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例(%)
华鑫证 券	-	-	450,000,000. 00	100.00	-	-

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 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	报刊及规定网站	2025 年 1 月 8 日
2	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	报刊及规定网站	2025 年 1 月 8 日
3	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	报刊及规定网站	2025 年 1 月 8 日
4	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	报刊及规定网站	2025 年 1 月 13 日
5	关于浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	报刊及规定网站	2025 年 1 月 14 日
6	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	2025 年 1 月 17 日
7	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
8	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
9	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
10	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
11	浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025 年 4 月 22 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	20250121-20250630	200,096,499.00	0.00	72,352,399.00	127,744,100.00	31.70
	2	20250224-20250630	100,017,749.00	0.00	0.00	100,017,749.00	24.82
	3	20250117-20250121	0.00	432,421,420,902,2	420,902,2	11,519,098.00	2.86

		50121		305.00	07.00		
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、中国证监会批准浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、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
- 3、浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 4、浦银安盛中证 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.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