

交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证  
券投资基金  
2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 月 31 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 4 月 21 日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 04 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 02 月 10 日起至 03 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	交银中证 A500 指数增强发起
基金主代码	026736
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2026 年 2 月 10 日
报告期末基金份额总额	886,473,384.25 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力争对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，追求超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，在力争对中证 A500 指数进行有效跟踪的基础上，对基金投资组合进行相对增强，追求超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8%。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险和预期收益理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为股票指数增强型基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金可投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	交银中证 A500 指数增强发起 A	交银中证 A500 指数增强发起 C
下属分级基金的交易代码	026736	026737
报告期末下属分级基金的份额总额	754,285,229.64 份	132,188,154.61 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 2 月 10 日-2026 年 3 月 31 日）	
	交银中证 A500 指数增强发起 A	交银中证 A500 指数增强发起 C
1. 本期已实现收益	-908,155.85	-194,989.37
2. 本期利润	-18,643,669.45	-3,289,520.14
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0245	-0.0244
4. 期末基金资产净值	735,885,313.42	128,928,884.85
5. 期末基金份额净值	0.9756	0.9753

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，计入费用后的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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、本基金合同生效日为 2026 年 02 月 10 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金运作时间未满足三个月。

#### 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

交银中证 A500 指数增强发起 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
自基金合同生效起至今	-2.44%	0.58%	-6.00%	1.14%	3.56%	-0.56%

交银中证 A500 指数增强发起 C

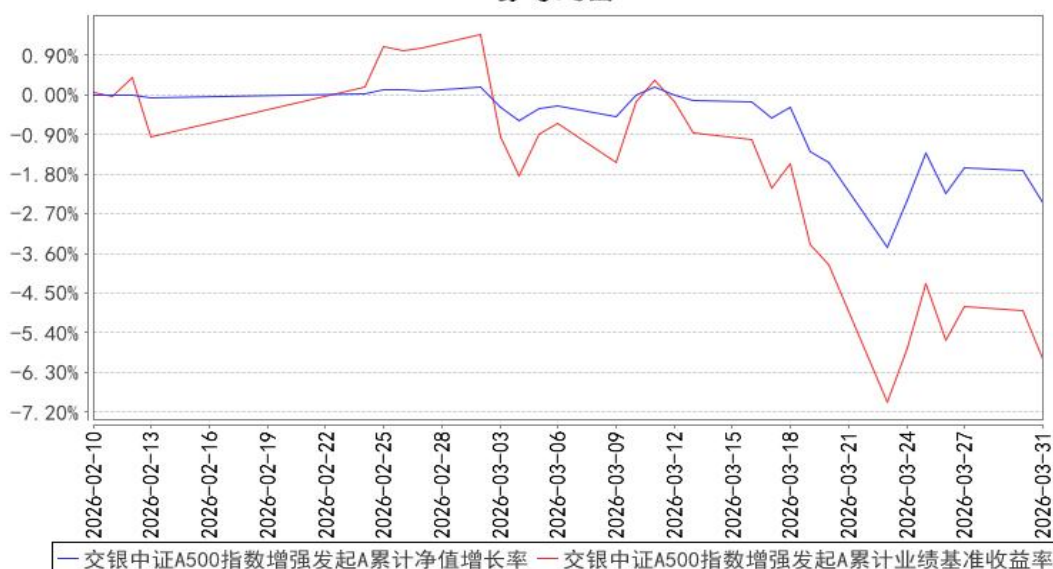
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④

		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
自基金合同 生效起至今	-2.47%	0.59%	-6.00%	1.14%	3.53%	-0.55%

注：本基金的业绩比较基准为中证 A500 指数收益率×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%，每日进行再平衡过程。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银中证A500指数增强发起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



交银中证A500指数增强发起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：本基金基金合同生效日为 2026 年 2 月 10 日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的 6 个月。截至 2026 年 3 月 31 日，本基金尚处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
邵文婷	交银上证 180 公司治理 ETF 及其联接、交银深证 300 价值 ETF 及其联接、交银中证海外中国互联网指数 (LOF)、交银中证环境治理指数 (LOF)、交银创业板 50 指数、交银国证新能源指数 (LOF)、交银中证红利低波动 100 指数、交银中证 A500 指数、交银上证科创板 100 指数、交银中证 A50 指数、交	2026 年 2 月 10 日	-	10 年	硕士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任量化投资部研究员/投资经理。

	银恒生港股通创新药精选指数、交银中证港股通央企红利指数、交银中证智选沪深港科技 50ETF、交银中证 A500 指数增强发起的基金经理，公司多资产研究部副总监				
杨彦煜	交银中证 A500 指数增强发起的基金经理	2026 年 3 月 21 日	-	10 年	硕士。历任中国人保资产管理有限公司量化研究员、量化投资经理，永赢基金管理有限公司投资经理。2025 年加入交银施罗德基金管理有限公司。

注：基金经理（或基金经理小组）期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金整体运作符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所管理的所有资产组合，包括证券投资基金和私募资产管理计划均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度。对于交易所公开竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则，全部通过交易系统进行比例分配；对于非集中竞价交易、以公司名义进行的场外交易，遵循公平交易分配原则对交易结果

进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控，风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析，于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析，通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度，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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）同向交易的交易价差未出现异常。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年一季度，国内经济延续修复态势，“十五五”开局之年政策协同发力，股市整体宽幅震荡，AI 科技与顺周期板块交替主导，市场在内生修复与外部扰动间寻求平衡。

回顾一季度市场行情，指数呈震荡上行后承压回调走势，节奏上呈现“1 月强势开门红、2 月先抑后扬、3 月震荡偏弱”格局。1 月市场以 AI 科技为主线，上证指数再度站上关键整数关口，期间 A 股成交额屡创新高，AI 应用、商业航天、脑机接口等主题活跃，风险偏好显著提升；2 月春节因素压缩交易时间，A 股进入高位震荡区间，高景气制造与顺周期板块走强，成长板块波动加剧；3 月两会政策预期部分兑现叠加中东地缘局势升级，原油价格快速上行抬升通胀预期，全球风险偏好回落，A 股承压震荡，能源、金融等高股息板块逆势上涨。

本基金于 2 月 10 日成立，恰逢市场高位震荡阶段，产品整体投资节奏保持平稳，小幅慢步建立仓位。而后在 3 月中下旬，中东地缘冲突导致的全球资本市场风险偏好收缩开始向 A 股市场传导，产品把握市场回调机会，加快建仓节奏，优化成本曲线。

展望 2026 年二季度，国内方面，在“十五五”规划的开局之年，宏观政策预计以“稳”为基调，产业政策聚焦新质生产力与未来产业。其次，4 月将是年报与一季报密集披露期，市场的交易重心大概率从宏观逻辑向基本面定价切换，产品将积极通过多因子选股，把握自下而上的结构性机会。海外方面，美以伊三方博弈持续，能源供给紧张对全球产业链的冲击日益加深，全球风险资产大概率将持续受到战场消息的频繁扰动，需要警惕全球市场流动性冲击带来的尾部风险，

美元、美债、黄金等避险资产的流动性状况值得密切关注。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	645,789,269.75	74.57
	其中：股票	645,789,269.75	74.57
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	170,000,000.00	19.63
	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	50,032,138.47	5.78
8	其他资产	223,084.58	0.03
9	合计	866,044,492.80	100.00

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	16,684.00	0.00
B	采矿业	42,458,909.00	4.91
C	制造业	317,207,406.39	36.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,780,656.00	0.90
E	建筑业	11,119,095.00	1.29
F	批发和零售业	2,792,250.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	12,842,260.04	1.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服	34,311,721.00	3.97

	务业		
J	金融业	101,752,189.00	11.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,867,258.00	0.79
M	科学研究和技术服务业	23,191,156.00	2.68
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	560,339,584.43	64.79

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	363,835.00	0.04
C	制造业	54,524,855.20	6.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,335,810.00	0.96
E	建筑业	143,920.00	0.02
F	批发和零售业	2,972,423.00	0.34
G	交通运输、仓储和邮政业	1,043,293.00	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,685,812.12	1.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,366,328.00	0.16
M	科学研究和技术服务业	2,420,815.00	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	1,739,239.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	28,850.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,824,505.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	85,449,685.32	9.88

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投

**资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	87,342	35,085,281.40	4.06
2	601899	紫金矿业	581,500	19,026,680.00	2.20
3	600519	贵州茅台	12,400	17,980,000.00	2.08
4	300308	中际旭创	26,600	15,146,306.00	1.75
5	601318	中国平安	235,900	13,394,402.00	1.55
6	600030	中信证券	556,300	13,373,452.00	1.55
7	603259	药明康德	130,200	12,772,620.00	1.48
8	601166	兴业银行	666,200	12,537,884.00	1.45
9	601211	国泰海通	678,700	11,259,633.00	1.30
10	600036	招商银行	285,000	11,206,200.00	1.30

**5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投****资明细**

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603444	吉比特	17,500	6,347,250.00	0.73
2	002299	圣农发展	323,600	5,727,720.00	0.66
3	000729	燕京啤酒	358,500	4,696,350.00	0.54
4	000685	中山公用	418,500	4,649,535.00	0.54
5	600801	华新建材	184,600	3,913,520.00	0.45

**5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合**

无。

**5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

无。

**5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资****明细**

无。

**5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

无。

**5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

无。

**5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

## 5.11 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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、处罚的情形披露如下：

2025 年 12 月 05 日，国家金融监督管理总局公示行政处罚决定书，给予兴业银行股份有限公司 720 万元人民币的行政处罚。

2025 年 09 月 12 日，金融监管总局公示行政处罚决定书，给予招商银行股份有限公司 60 万元人民币的行政处罚。

本基金遵循指数化投资理念，绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。本基金对上述主体发行证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

除上述主体外，本基金投资的前十名证券的其他发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

## 5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	223,084.58
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	223,084.58

## 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

## 5.11.5 报告期末股票中存在流通受限情况的说明

## 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无。

## 5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	交银中证 A500 指数增强发起 A	交银中证 A500 指数增强发起 C
基金合同生效日(2026年2月10日)基金份额总额	764,106,857.73	135,895,646.33
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,260,658.68	1,724,001.66
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	12,082,286.77	5,431,493.38
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	754,285,229.64	132,188,154.61

注：1、如果本报告期间发生转换入、份额类别调整、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出、份额类别调整业务，则总赎回份额中包含该业务。

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	交银中证 A500 指数增强发起 A	交银中证 A500 指数增强发起 C
基金合同生效日(2026年2月10日)管理人持有的本基金份额	10,000,388.92	-
基金合同生效日起至报告期期末买入/申购总份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,388.92	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.13	-

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	认购	2026-02-09	10,000,388.92	10,001,000.00	-
合计			10,000,388.92	10,001,000.00	

## § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,388.92	1.13	10,000,388.92	1.13	自基金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	10,000,388.92	1.13	10,000,388.92	1.13	-

## § 9 影响投资者决策的其他重要信息

### 9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

### 9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 10 备查文件目录

### 10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 5、关于申请募集注册交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内交银施罗德中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金在规定报刊上各项公告的原稿。

### 10.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 10.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站([www.fund001.com](http://www.fund001.com))查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：[services@jysld.com](mailto:services@jysld.com)。