

浦银安盛中证 A500 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2026 年第 2 季度报告

2026 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

报告送出日期：2026 年 7 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 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 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
|------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 浦银安盛中证 A500ETF                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 场内简称       | A500ETF 浦银                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 基金主代码      | 159376                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 前端交易代码     | 159376                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金运作方式     | 交易型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 基金合同生效日    | 2024 年 12 月 30 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 报告期末基金份额总额 | 78,922,317.00 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                          |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
| 投资策略       | 本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数中的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。<br>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。<br>本基金的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、可转换债券与可交换债券投资策略、股指期货交易策略、国债期货交易策略、股票期权投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务投资策略详见法律文件。 |
| 业绩比较基准     | 中证 A500 指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 风险收益特征     | 本基金属于股票型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法                                                                                                                                                                                                                                                                             |

|       |                                            |
|-------|--------------------------------------------|
|       | 跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |
| 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                               |

§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 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 4,164,532.36                          |
| 2. 本期利润         | 12,985,635.58                         |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.1894                                |
| 4. 期末基金资产净值     | 115,402,767.77                        |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.4622                                |

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

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

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

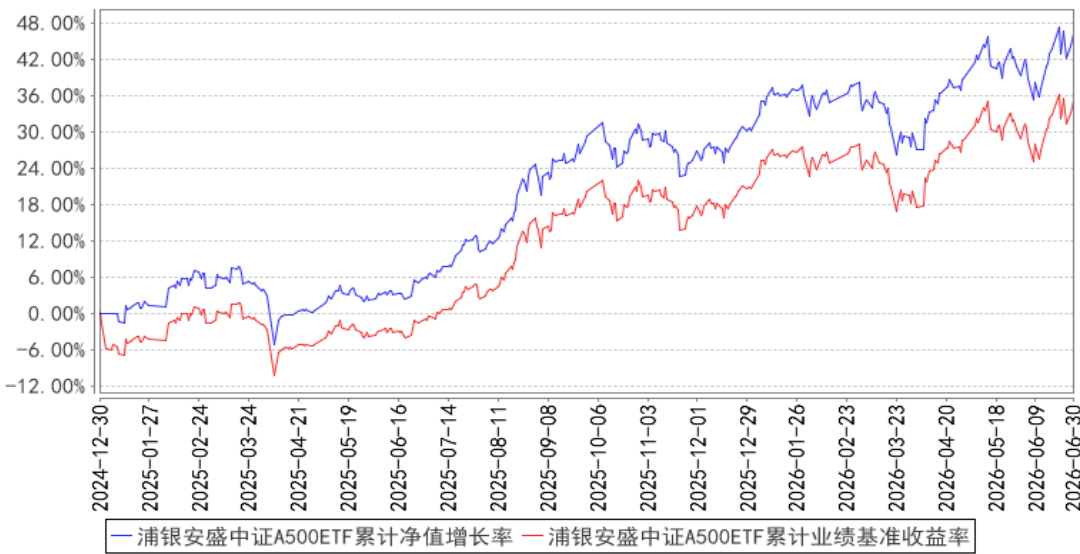
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



§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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 宋施怡 | 本基金的基金经理 | 2024 年 12 月 30 日 | —    | 12 年   | 宋施怡女士，中国人民大学金融专业硕士。2013 年 7 月至 2023 年 9 月就职于上海申银万国证券研究所金融工程部，历任助理分析师、分析师、高级分析师、资深高级分析师等职务。2023 年 10 月加盟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。2025 年 7 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发起式联接基金的基金经理。2025 年 7 月起担任浦银安盛北证 50 成份指数型发起式证券投资基金的基金经理。2025 年 10 月起担任浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2026 年 3 月起担任浦银安盛上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |

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

2、证券从业含义遵从《证券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》及其他有关法律法规的规定及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件认定的异常交易行为。报告期内未发生本基金与旗下其他投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年二季度，A 股主要宽基指数全部录得正收益，但内部分化极为显著。市场呈现典型的“科技牛、结构牛”特征。这一分化格局的核心原因在于 AI 产业链的业绩兑现与全球科技产业趋势的共振。从节奏上看，二季度走势大致分为三个阶段：4 月初探底：各大宽基指数在 4 月 2-7 日先后触及季度低点，承接一季度末美伊冲突冲击的余波。4 月中旬至 5 月反弹修复：地缘局势缓和预期叠加政策利好，市场逐步回暖。6 月加速上行：创业板指在 6 月 25 日创下历史新高，科技成长主线全面爆发。总体来看，上证指数上涨 5.20%，深证成指上涨 20.24%，中证 A500 上涨 14.26%。流动性方面，二季度 A 股日均成交额达到 2.88 万亿元，维持在 3 万亿附近的极高活跃度水平。两融余额方面，二季度呈现持续攀升态势。融资余额从 4 月初的 2.47 万亿元一路攀升至 6 月末的 2.91 万亿元，增幅约 18%。从经济基本面看，6 月国内 PMI 为 50.3%，比 5 月份上升 0.3 个百分点，重返扩张区间。

我们认为三季度市场关注的核心问题在于当前极致分化市场的可持续性。二季度，31 个申万一级行业中仅 5 个行业上涨，通信（+90.92%）、电子（+63.84%）与石油石化（-22.20%）、农林牧渔（-20.19%）、钢铁（-18.59%）的收益差甚至超过 100%。其次是估值压力。万得全 A 估值分位已达历史 97% 以上高位，虽然 AI 相关行业的强劲盈利有望逐步消化高估值，但对于缺乏业绩支撑的纯概念炒作个股，回调风险尤为突出。其三是外部扰动，年初市场普遍预期美联储将在 2026 年降息 2 次（9 月和 12 月各 25 个基点），但经过 5 月非农数据超预期、中东地缘冲突推升油价、CPI 反弹等一系列事件后，主流机构已大幅修正预期，年内不降息成为基准情景，甚至有机开始讨论加息可能性，美联储加息路径的不确定性或使科技股承压。此外，美国 AI 资本开支的可持续性担忧，以及韩国股市剧烈波动的外部情绪传导，均构成短期扰动因素。

综上，我们认为三季度应均衡配置，尤其是临近中报披露期，需综合考虑盈利与估值匹配的问题。中证 A500 指数均衡配置各行业龙头，在极致分化行情结束的情况下有望表现更佳。

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。

## 4.5 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 1.4622 元,本报告期基金份额净值增长率为 14.66%; 同期业绩比较基准收益率为 14.26%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

- 1、本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 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              | 112,721,640.82 | 95.70        |
|    | 其中：股票             | 112,721,640.82 | 95.70        |
| 2  | 基金投资              | —              | —            |
| 3  | 固定收益投资            | —              | —            |
|    | 其中：债券             | —              | —            |
|    | 资产支持证券            | —              | —            |
| 4  | 贵金属投资             | —              | —            |
| 5  | 金融衍生品投资           | —              | —            |
| 6  | 买入返售金融资产          | —              | —            |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计      | 3,962,435.60   | 3.36         |
| 8  | 其他资产              | 1,103,629.07   | 0.94         |
| 9  | 合计                | 117,787,705.49 | 100.00       |

注：上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

## 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         | 366,818.00    | 0.32         |
| B  | 采矿业              | 4,735,515.00  | 4.10         |
| C  | 制造业              | 79,626,830.59 | 69.00        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,508,445.00  | 2.17         |
| E  | 建筑业              | 1,397,580.00  | 1.21         |
| F  | 批发和零售业           | 928,045.00    | 0.80         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 2,556,451.00  | 2.22         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 58,590.00     | 0.05         |

|   |                 |                |       |
|---|-----------------|----------------|-------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 5,864,624.41   | 5.08  |
| J | 金融业             | 11,094,222.00  | 9.61  |
| K | 房地产业            | 641,519.00     | 0.56  |
| L | 租赁和商务服务业        | 814,825.60     | 0.71  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 1,347,296.00   | 1.17  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 201,781.60     | 0.17  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | —              | —     |
| P | 教育              | 37,980.00      | 0.03  |
| Q | 卫生和社会工作         | 233,413.00     | 0.20  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 88,514.00      | 0.08  |
| S | 综合              | 212,088.00     | 0.18  |
|   | 合计              | 112,714,538.20 | 97.67 |

### 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              | —        | —            |
| C  | 制造业              | 4,529.20 | 0.00         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —        | —            |
| E  | 建筑业              | —        | —            |
| F  | 批发和零售业           | —        | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,083.42 | 0.00         |
| H  | 住宿和餐饮业           | —        | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —        | —            |
| J  | 金融业              | —        | —            |
| K  | 房地产业             | —        | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —        | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —        | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —        | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —        | —            |
| P  | 教育               | —        | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —        | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —        | —            |
| S  | 综合               | —        | —            |
|    | 合计               | 5,612.62 | 0.00         |

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创 | 3,600  | 4,572,000.00 | 3.96         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 9,500  | 3,733,595.00 | 3.24         |
| 3  | 300502 | 新易盛  | 4,888  | 2,967,016.00 | 2.57         |
| 4  | 600519 | 贵州茅台 | 2,200  | 2,608,078.00 | 2.26         |
| 5  | 603986 | 兆易创新 | 2,400  | 1,956,000.00 | 1.69         |
| 6  | 601318 | 中国平安 | 36,800 | 1,756,832.00 | 1.52         |
| 7  | 002371 | 北方华创 | 1,750  | 1,547,980.00 | 1.34         |
| 8  | 600036 | 招商银行 | 42,600 | 1,512,300.00 | 1.31         |
| 9  | 688256 | 寒武纪  | 918    | 1,464,714.90 | 1.27         |
| 10 | 601899 | 紫金矿业 | 57,100 | 1,435,494.00 | 1.24         |

### 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  | 688816 | 易思维  | 61    | 3,483.10 | 0.00         |
| 2  | 001220 | 世盟股份 | 39    | 1,083.42 | 0.00         |
| 3  | 603284 | 林平发展 | 30    | 1,046.10 | 0.00         |

### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

**5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

| 代码                | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值(元) | 公允价值变动（元） | 风险说明      |
|-------------------|----|----------|---------|-----------|-----------|
| -                 | -  | -        | -       | -         | -         |
| 公允价值变动总额合计（元）     |    |          |         |           | -         |
| 股指期货投资本期收益（元）     |    |          |         |           | 94,955.92 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） |    |          |         |           | 48,600.00 |

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

**5.9.2 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。

**5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****5.10.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.10.3 本期国债期货投资评价**

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。本基金投资的前十名证券中，上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

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

**5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库**

报告期内，本基金投资的前十名股票不存在超出基金合同约定的备选股票库的情况。

**5.11.3 其他资产构成**

| 序号 | 名称      | 金额（元）        |
|----|---------|--------------|
| 1  | 存出保证金   | —            |
| 2  | 应收证券清算款 | 1,103,629.07 |
| 3  | 应收股利    | —            |
| 4  | 应收利息    | —            |
| 5  | 应收申购款   | —            |
| 6  | 其他应收款   | —            |
| 7  | 其他      | —            |
| 8  | 合计      | 1,103,629.07 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末不存在指数投资前十名股票流通受限的情况。

##### 5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688816 | 易思维  | 3,483.10       | 0.00         | 新股锁定     |
| 2  | 001220 | 世盟股份 | 1,083.42       | 0.00         | 新股锁定     |
| 3  | 603284 | 林平发展 | 1,046.10       | 0.00         | 新股锁定     |

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 81,922,317.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 45,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 48,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —             |
| 报告期期末基金份额总额               | 78,922,317.00 |

## §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

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

#### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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              | 20260401-20260630       | 29,258,200.00 | 1,030,000.00 | 1,575,100.00 | 28,713,100.00 | 36.38   |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                   |                |                         |               |              |              |               |         |
| 基金管理人提示投资者注意：当特定的机构投资者进行大额赎回操作时，基金管理人需通过对基金持有证券的快速变现以支付赎回款，该等操作可能会产生基金仓位调整的困难，产生冲击成本的风险，并造成基金净值的波动；同时，该等大额赎回将可能产生（1）单位净值尾差风险；（2）基金净值大幅波动的风险；（3）因引发基金本身的巨额赎回而导致中小投资者无法及时赎回的风险；以及（4）因基金资产净值低于 5000 万元从而影响投资目标实现或造成基金终止等风险。 |                |                         |               |              |              |               |         |

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准本基金募集的文件
- 2、浦银安盛中证 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

9.2 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。

9.3 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。

客户服务中心电话：400-8828-999 或 021-33079999。

浦银安盛基金管理有限公司

2026 年 7 月 21 日