上银中证500指数增强型证券投资基金

2026年第3季度报告

2026年09月30日

基金管理人:上银基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

报告送出日期:2026年10月27日

§1 重要提示

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

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年10月26日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年07月01日起至2026年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	上银中证 500 指数增强型	
基金主代码	009613	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 07 月 01 日	
报告期末基金份额总额	35,274,696.04 份	
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金力求控制基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。	
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，在标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%	
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。	
基金管理人	上银基金管理有限公司	
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	上银中证 500 指数增强型 A	上银中证 500 指数增强型 C
下属分级基金的交易代码	009613	009614
报告期末下属分级基金的份额	22,057,453.50 份	13,217,242.54 份

总额		

注：根据《上银基金管理有限公司关于上银中证 500 指数增强型证券投资基金基金托管人信息变更的提示性公告》、《上银基金管理有限公司关于上银中证 500 指数增强型证券投资基金修改基金合同、托管协议的公告》，本基金的基金托管人名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”，详情可参见相关公告。

§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 07 月 01 日-2026 年 09 月 30 日）	
	上银中证 500 指数增强型 A	上银中证 500 指数增强型 C
1.本期已实现收益	-542,543.40	-329,536.70
2.本期利润	-2,880,106.53	-1,602,886.20
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1309	-0.1273
4.期末基金资产净值	29,239,764.87	17,198,220.43
5.期末基金份额净值	1.3256	1.3012

注：1、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。

2、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。

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

上银中证 500 指数增强型 A 净值表现

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-9.07%	1.72%	-16.81%	1.89%	7.74%	-0.17%
过去六个月	3.54%	1.59%	-2.17%	1.75%	5.71%	-0.16%
过去一年	7.00%	1.46%	0.47%	1.58%	6.53%	-0.12%
过去三年	37.31%	1.40%	29.54%	1.50%	7.77%	-0.10%
过去五年	12.79%	1.27%	5.13%	1.34%	7.66%	-0.07%
自基金合同生效起至今	32.56%	1.25%	26.29%	1.31%	6.27%	-0.06%

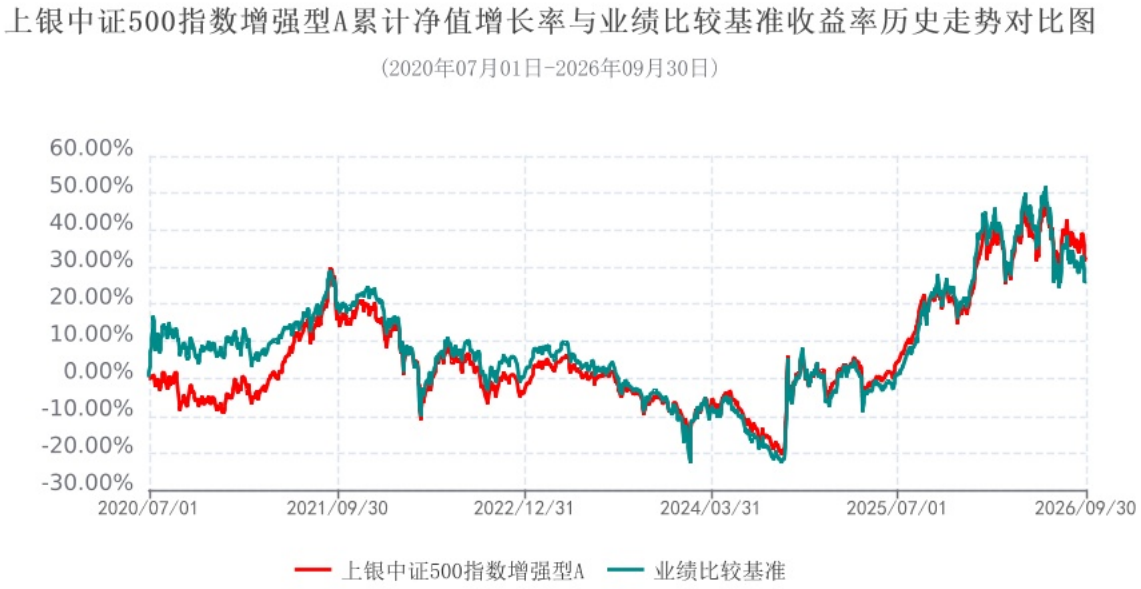
上银中证 500 指数增强型 C 净值表现

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

过去三个月	-9.13%	1.72%	-16.81%	1.89%	7.68%	-0.17%
过去六个月	3.38%	1.59%	-2.17%	1.75%	5.55%	-0.16%
过去一年	6.68%	1.46%	0.47%	1.58%	6.21%	-0.12%
过去三年	36.09%	1.40%	29.54%	1.50%	6.55%	-0.10%
过去五年	11.13%	1.27%	5.13%	1.34%	6.00%	-0.07%
自基金合同生效起至今	30.12%	1.24%	26.29%	1.31%	3.83%	-0.07%

注：本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。

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



注：本基金合同生效日为 2020 年 07 月 01 日，自基金合同生效日起 6 个月内为建仓期，建仓期结束

时各项资产配置比例符合基金合同约定。

§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		
鉏国彬	基金经理	2023-01-31	-	7.0 年	硕士，历任光大保德信基金研究员等职务。2023 年 1 月担任上银中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2025 年 8 月担任上银上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2026 年 2 月担任上银中证全指指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
翟云飞	量化投资部总监、基金经理	2023-09-21	-	16.0 年	博士，历任大成基金金融工程师(负责量化投资研究)、产品设计师、量化投资研究员、行业投资研究员，光大保德信基金金融工程高级经理、高级量化研究员、基金经理职务。2023 年 9 月担任上

					银中证 500 指数增强型证券投资基金基金经理，2023 年 9 月担任上银科技驱动双周定期可赎回混合型证券投资基金基金经理，2025 年 5 月担任上银中证半导体产业指数型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 6 月担任上银创业板 50 指数型发起式证券投资基金基金经理，2025 年 8 月担任上银上证科创板综合指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2026 年 2 月担任上银中证全指指数增强型发起式证券投资基金基金经理，2026 年 5 月担任上银中证沪港深互联网指数型发起式证券投资基金基金经理，2026 年 8 月担任上银创业板综指增强型发起式证券投资基金基金经理。

注：1、任职日期和离任日期一般情况下指公司决定确定的日期；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。
2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》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、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的约定，无违法违规、未履行基金合同承诺或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

报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》相关规定及公司内部的公平交易管理制度，通过系统和人工等方式在各个环节严格控制交易的公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合不存在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%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年三季度市场风格切换比较剧烈，上半年由 AI 产业链驱动的科技行情在三季度遭遇了明显的回调，医药、红利、周期等处于低位的方向轮流接棒，市场从“K 型分化”迈入高低切阶段。宽基指数表现上，主要宽基普跌，沪深 300 指数下跌 12.49%，中证 500 指数下跌 17.67%，中证 2000 指数下跌 11.08%，科创综合指数下跌 27.98%，中证全指下跌 13.79%。成交额较上半年明显缩量，市场由“放量博弈”转为“缩量震荡”。风格上成长、中盘回撤较大，大小盘、红利抗跌，与上半年市场形成镜像，本季度 TMT 成交占比回落，拥挤度得到缓解。行业上仍然分化较大，煤炭、石油石化、农林牧渔、银行领涨，电子、通信等成长板块调整较大，行业上首尾收益差超过 50%。在投资管理上，本基金是以中证 500 指数为跟踪标的指数的指数增强基金，坚持采用量化多因子的投资策略，勤勉尽责，在有效控制跟踪误差和偏离的基础上，力争为投资者获取合理的超额收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末上银中证 500 指数增强型 A 基金份额净值为 1.3256 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.07%，同期业绩比较基准收益率为-16.81%；截至报告期末上银中证 500 指数增强型 C 基金份额净值为 1.3012 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-9.13%，同期业绩比较基

准收益率为-16.81%。

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 2026 年 7 月 2 日至 2026 年 9 月 30 日期间基金资产净值低于五千万元。本基金存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会报告解决方案。自 2026 年 9 月 24 日起，本基金如产生信息披露费用、审计费用、持有人大会费用、银行间账户维护费由基金管理人承担。本报告期内，本基金未出现《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条规定的基金份额持有人数量不满二百人需要在本报告中予以披露的情形。

§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	43,672,951.68	93.43
	其中：股票	43,672,951.68	93.43
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	2,745,038.54	5.87
8	其他资产	327,499.24	0.70
9	合计	46,745,489.46	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	68,796.00	0.15
B	采矿业	667,048.00	1.44
C	制造业	25,517,109.78	54.95
D	电力、热力、燃气及	1,501,357.00	3.23

	水生产和供应业		
E	建筑业	74,382.00	0.16
F	批发和零售业	1,058,115.00	2.28
G	交通运输、仓储和邮政业	606,922.00	1.31
H	住宿和餐饮业	225,625.00	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,976,001.80	4.26
J	金融业	2,333,457.00	5.02
K	房地产业	421,638.00	0.91
L	租赁和商务服务业	142,072.00	0.31
M	科学研究和技术服务业	394,912.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	749,706.00	1.61
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	35,737,141.58	76.96

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	74,235.00	0.16
C	制造业	5,940,619.10	12.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	216,264.00	0.47
E	建筑业	55,209.00	0.12
F	批发和零售业	284,701.00	0.61
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	862,891.00	1.86
J	金融业	-	-
K	房地产业	28,035.00	0.06
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	365,572.00	0.79

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	63,460.00	0.14
P	教育	44,824.00	0.10
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	7,935,810.10	17.09

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通交易机制投资的港股。

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	688002	睿创微纳	4,300	745,706.00	1.61
2	300475	香农芯创	4,700	720,228.00	1.55
3	300857	协创数据	2,520	632,923.20	1.36
4	688188	柏楚电子	5,640	552,550.80	1.19
5	600601	方正科技	37,300	492,360.00	1.06
6	300223	君正股份	3,800	490,770.00	1.06
7	002138	顺络电子	9,700	467,928.00	1.01
8	300757	罗博特科	800	426,800.00	0.92
9	600685	中船防务	14,700	422,037.00	0.91
10	300548	长芯博创	1,900	417,677.00	0.90

5.3.2 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	688203	海正生材	16,254	308,013.30	0.66
2	600050	中国联通	66,700	282,141.00	0.61
3	000404	长虹华意	40,500	277,020.00	0.60
4	300566	激智科技	10,700	250,273.00	0.54
5	300153	科泰电源	10,200	241,842.00	0.52

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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

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

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

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

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

本基金本报告期末未投资股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

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投资国债期货。

5.10.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

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受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的前十名证券的发行主体本报告期内没有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超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同约定的备选股票库。

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	327,499.24
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	327,499.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中分项之和与合计可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	上银中证 500 指数增强型 A	上银中证 500 指数增强型 C
报告期期初基金份额总额	22,011,490.36	12,385,296.54
报告期期间基金总申购份额	1,276,713.63	4,511,605.81
减：报告期期间基金总赎回份额	1,230,750.49	3,679,659.81
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	22,057,453.50	13,217,242.54

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§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

本报告期内基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内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

本基金本报告期内单一投资者持有基金份额比例无达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立上银中证 500 指数增强型证券投资基金的文件

2、《上银中证 500 指数增强型证券投资基金基金合同》

3、《上银中证 500 指数增强型证券投资基金托管协议》

4、《上银中证 500 指数增强型证券投资基金招募说明书》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、报告期内在中国证监会规定报刊上公开披露的各项公告

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所

9.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人，客服电话：021-60231999，公司网址：www.boscam.com.cn。

上银基金管理有限公司

二〇二六年十月二十七日