浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：浦银基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 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 2026 年 1 月 1 日起至 2026 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 9

4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
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 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 16

§5 托管人报告 16

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 17
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 17

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 17

6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 18
6.3 净资产变动表 20
6.4 报表附注 21

§7 投资组合报告 45

7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 49
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 49

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 49
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 50
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 50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50
7.12 投资组合报告附注 50

§8 基金份额持有人信息 51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
8.2 盈利投资者数量占比 51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
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 51

§9 开放式基金份额变动 52

§10 重大事件揭示 52

10.1 基金份额持有人大会决议 52
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 52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53
10.4 基金投资策略的改变 53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 53
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 53
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 53
10.8 其他重大事件 55

§11 影响投资者决策的其他重要信息 55

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 55

§12 备查文件目录 55

12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金	
基金简称	浦银 ESG 责任投资混合	
基金主代码	009630	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 3 月 16 日	
基金管理人	浦银基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	968,189,056.53 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浦银 ESG 责任投资混合 A	浦银 ESG 责任投资混合 C
下属分级基金的交易代码	009630	009631
报告期末下属分级基金的份额总额	683,248,077.41 份	284,940,979.12 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金坚持“ESG”与“价值投资”相结合的投资理念，在严格控制组合风险并保持良好流动性的前提下，兼顾社会价值和商业价值，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金坚持“ESG”与“价值投资”相结合的投资理念。坚持严格的基本面分析，以股东价值为核心，不仅关注其商业价值，同时也关注其社会价值。注重风险与收益的平衡，结合公司长期发展趋势，精选个股构建投资组合。 本基金界定的 ESG 责任投资将综合考虑企业的环境效益（E）、对社会的贡献（S）和良好的公司治理（G），通过定性和定量相结合的策略将 ESG 评价情况纳入投资参考。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+中证全债指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金可投资港股通标的股票，需承担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。

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		浦银基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	薛香	冯萌
	联系电话	021-23212888	021-52629999-213310
	电子邮箱	compliance@spdbfunds.com	fengmeng@cib.com.cn

客户服务电话	021-33079999 或 400-8828-999	95561
传真	021-23212985	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址	上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码	200127	200120
法定代表人	张健	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.spdbfunds.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	浦银基金管理有限公司	上海市浦东新区滨江大道 5189 号 S2 座 1-7 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	浦银 ESG 责任投资混合 A	浦银 ESG 责任投资混合 C
本期已实现收益	75,625,002.30	32,458,037.11
本期利润	-21,176,135.67	-10,376,328.50
加权平均基金份额本期利润	-0.0287	-0.0323
本期加权平均净值利润率	-3.12%	-3.57%
本期基金份额净值增长率	-3.66%	-3.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	-78,154,716.88	-36,925,773.81

期末可供分配基金份额利润	-0.1144	-0.1296
期末基金资产净值	610,387,852.27	249,911,397.28
期末基金份额净值	0.8934	0.8771
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	-10.66%	-12.29%

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

浦银 ESG 责任投资混合 A

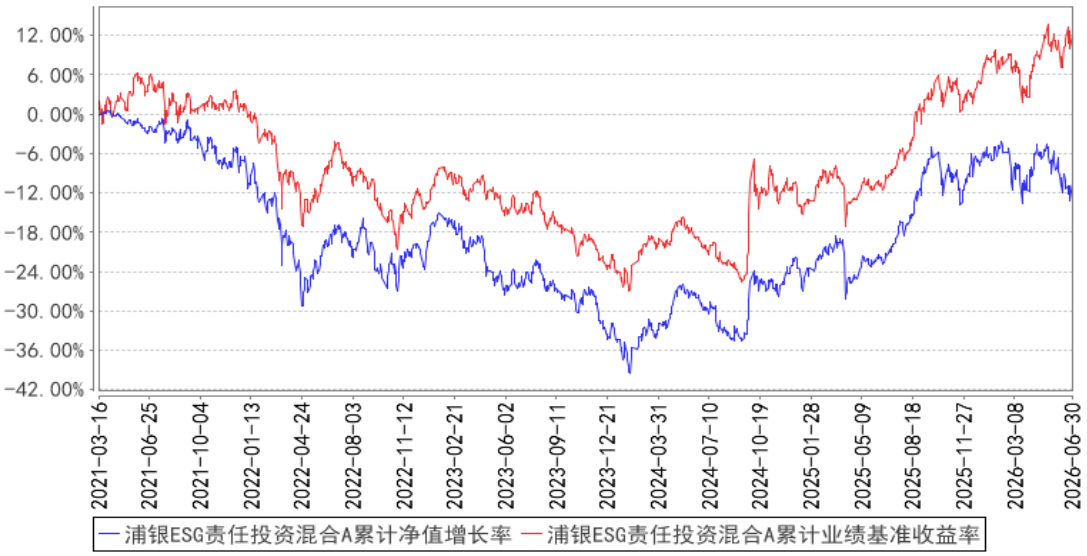
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.11%	1.28%	9.15%	1.05%	-8.04%	0.23%
过去六个月	-3.66%	1.23%	7.24%	0.98%	-10.90%	0.25%
过去一年	13.35%	1.09%	23.85%	0.87%	-10.50%	0.22%
过去三年	20.86%	1.04%	31.44%	0.91%	-10.58%	0.13%
过去五年	-8.71%	1.04%	6.08%	0.90%	-14.79%	0.14%
自基金合同生效起至今	-10.66%	1.02%	12.15%	0.90%	-22.81%	0.12%

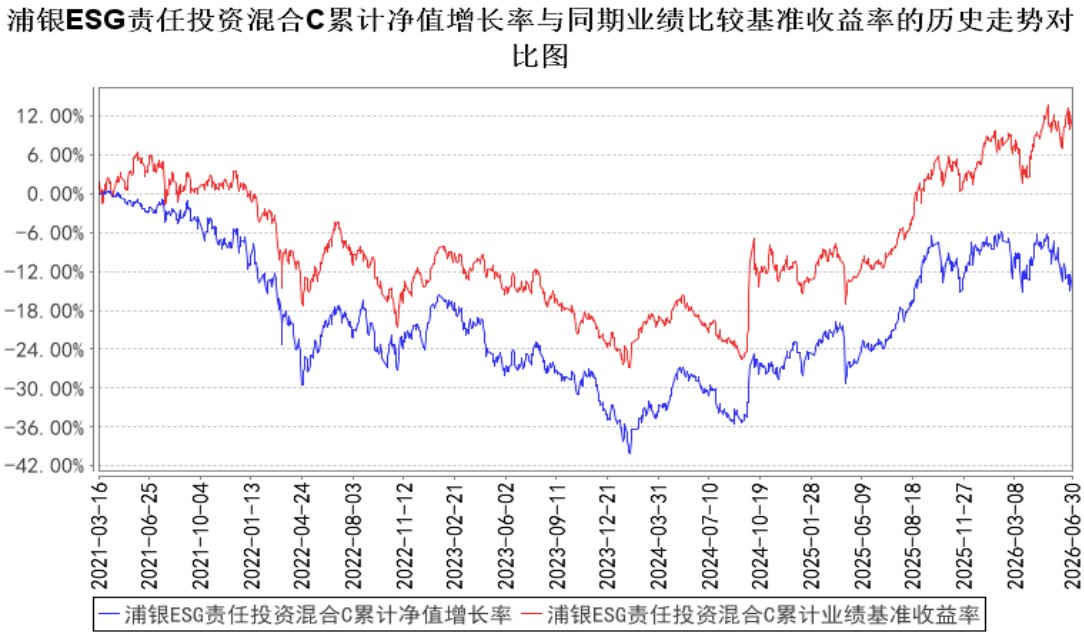
浦银 ESG 责任投资混合 C

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
过去三个月	1.03%	1.28%	9.15%	1.05%	-8.12%	0.23%
过去六个月	-3.83%	1.23%	7.24%	0.98%	-11.07%	0.25%
过去一年	12.94%	1.09%	23.85%	0.87%	-10.91%	0.22%
过去三年	19.59%	1.04%	31.44%	0.91%	-11.85%	0.13%
过去五年	-10.28%	1.04%	6.08%	0.90%	-16.36%	0.14%
自基金合同生效起至今	-12.29%	1.02%	12.15%	0.90%	-24.44%	0.12%

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ESG责任投资混合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





注：自 2025 年 1 月 27 日起，本基金业绩比较基准由原“MSCI 中国 A 股指数收益率*70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+中证全债指数收益率*20%”变更为“中证 A500 指数收益率*70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+中证全债指数收益率*20%”。具体内容详见基金管理人于 2025 年 1 月 27 日发布的《关于浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同相应条款的公告》。

§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

浦银基金管理有限公司（以下简称“浦银基金”）成立于 2007 年 8 月，股东为上海浦东发展银行股份有限公司、法国巴黎资产管理控股公司（BNP Paribas Asset Management Holding 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。2026 年 8 月 12 日，基金管理人的名称由“浦银安盛基金管理有限公司”变更为“浦银基金管理有限公司”。

截至 2026 年 6 月 30 日止，浦银基金旗下共管理 124 只基金，即浦银价值成长混合型证券投资基金、浦银优化收益债券型证券投资基金、浦银精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银红利精选混合型证券投资基金、浦银沪深 300 指数增强型证券投资基金、浦银货币市场证券投资基金、浦银稳健增利债券型证券投资基金（LOF）、浦银战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银 6 个月持有期债券型证券投资基金、浦银消费升级灵活配置混合型证券投资基金、浦银日日盈货

币市场基金、浦银新经济结构灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛世精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银增长动力灵活配置混合型证券投资基金、浦银医疗健康灵活配置混合型证券投资基金、浦银睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛鑫定期开放债券型证券投资基金、浦银日日丰货币市场基金、浦银盛泰纯债债券型证券投资基金、浦银日日鑫货币市场基金、浦银盛达纯债债券型证券投资基金、浦银经济带崛起灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛跃纯债债券型证券投资基金、浦银盛通定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银港股通量化优选灵活配置混合型证券投资基金、浦银量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、浦银盛泽定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银中短债债券型证券投资基金、浦银普益纯债债券型证券投资基金、浦银盛融定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银普瑞纯债债券型证券投资基金、浦银盛元定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银全球智能科技股票型证券投资基金（QDII）、浦银双债增强债券型证券投资基金、浦银盛勤 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银环保新能源混合型证券投资基金、浦银上海清算所高等级优选短期融资券指数证券投资基金、浦银盛煊 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银普丰纯债债券型证券投资基金、浦银盛诺 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银颐和稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银先进制造混合型证券投资基金、浦银盛智一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银盛晖一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银盛熙一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银科技创新优选混合型证券投资基金、浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金、浦银普嘉 87 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、浦银价值精选混合型证券投资基金、浦银普华 66 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银普天纯债债券型证券投资基金、浦银普庆纯债债券型证券投资基金、浦银睿和优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银中债 3-5 年农发行债券指数证券投资基金、浦银科技创新一年持有期混合型证券投资基金、浦银稳健丰利债券型证券投资基金、浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金、浦银盛华一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银均衡优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、浦银季季鑫 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银嘉和稳健一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银中证 ESG　120 策略交易型开放式指数证券投资基金、浦银安裕回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银双月鑫 60 天滚动持有短债债券型证券投资基金、浦银中证证券公司 30 交易型开放式指数证券投资基金、浦银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 CFETS　0-5 年期央企债券指数发起式证券投资基金、浦银颐享稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银盛瑞纯债债券型证券投资基金、浦银品质优选混合型证券投资基金、浦银创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、浦银兴荣稳健一年持有期混合型基金中基

金（FOF）、浦银泰和配置 6 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银安弘回报一年持有期混合型证券投资基金、浦银稳健回报 6 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、浦银普裕一年定期开放债券型证券投资基金、浦银兴耀优选一年持有期混合型证券投资基金、浦银中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银稳鑫 120 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银盛嘉一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浦银普诚纯债债券型证券投资基金、浦银中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、浦银季季盈 90 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、浦银普旭 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银光耀优选混合型证券投资基金、浦银中证证券公司 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、浦银景气优选混合型证券投资基金、浦银普兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银颐璇平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银普恒利率债债券型证券投资基金、浦银稳健富利 180 天持有期债券型证券投资基金、浦银悦享 30 天持有期债券型证券投资基金、浦银策略优选混合型证券投资基金、浦银普安利率债债券型证券投资基金、浦银养老目标日期 2050 五年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、浦银高端装备混合型发起式证券投资基金、浦银中证 A50 指数增强型证券投资基金、浦银上证科创板 100 指数增强型证券投资基金、浦银红利量化选股混合型证券投资基金、浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、浦银中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、浦银周期优选混合型发起式证券投资基金、浦银普航 3 个月定期开放债券型证券投资基金、浦银上证科创板综合指数增强型证券投资基金、浦银中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、浦银北证 50 成份指数型发起式证券投资基金、浦银港股通央企红利混合型证券投资基金、浦银医疗创新混合型发起式证券投资基金、浦银数字经济混合型发起式证券投资基金、浦银国证港股通科技指数型发起式证券投资基金、浦银盈丰多元配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银盈鑫多元配置 90 天持有期混合型基金中基金（ETF-FOF）、浦银港股通消费混合型发起式证券投资基金、浦银稳健双利债券型证券投资基金、浦银盈福多元配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银盈泰多元配置 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）、浦银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、浦银半导体产业混合型发起式证券投资基金、浦银产业机遇混合型发起式证券投资基金、浦银稳健鑫利债券型证券投资基金、浦银国证粮食产业交易型开放式指数证券投资基金、浦银资源精选混合型发起式证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术基础设施以及有关业务应用系统构成。公司信息技术基础设施包括机房、网络设备、服务器设备、监控设备等，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。同时在合肥建设有灾备托管机房，实现异地备份，形成了两地三中心的

数据中心布局，这些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实施。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、客户服务系统、信息披露系统、反洗钱系统等，这些系统主要是采购行业内主流的专业系统提供商的成熟产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行相关的系统功能升级。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浦事通数字化办公平台、数字化运营平台、新一代营销服务平台、全面风险管理平台、投研一体化平台，以及基于 CDH 和 Oceanbase 底座的两大数据开发平台，和集 RPA、OCR、NLP、AI 等创新技术为一体的创新研发平台等业务支持应用平台，持续为公司业务赋能。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		
李浩玄	公司权益投资二部总经理，公司旗下部分基金基金经理。	2024 年 9 月 13 日	-	10 年	李浩玄先生，同济大学金融专业硕士。2011 年 7 月至 2012 年 7 月在思高方达金融服务有限公司运营部任后台清算；2012 年 8 月至 2013 年 6 月在寰富投资咨询有限公司交易部任交易员；2013 年 7 月至 2015 年 2 月在上海龙德资源股份有限公司金融业务部任研究员；2015 年 3 月至 2015 年 8 月在上海展弘投资管理有限公司研究部任研究员；2015 年 9 月加盟本公司，在研究部从事研究员岗位工作，2022 年 12 月起任权益投资部基金经理。现任权益投资二部总经理兼基金经理。2022 年 12 月至 2025 年 6 月担任浦银安盛科技创新一年定期开放混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 9 月至 2026 年 5 月担任浦银先进制造混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 4 月至 2026 年 5 月担任浦银周期优选混合型发起式证券投资基金的基金经理。2023 年 3 月起担任浦银战略新兴产业混合型证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月起担任浦银高端装备混合型发起式证券投资基金

					的基金经理。2024 年 9 月起担任浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金的基金经理。2025 年 6 月起担任浦银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）的基金经理。2025 年 6 月起担任浦银品质优选混合型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 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

2026 年上半年，经历了地缘冲击、科技持续催化和传统经济的景气互相拉扯，指数大体走势震荡向上。但单看指数难以准确描述市场真实状态。K 型分化是大家对今年权益市场表现的精准总结，对比鲜明的是：年初至今个股涨跌幅中位数为负。涨幅分布直方图中 90%个股处于正态分布，但 10%个股处于极偏右的尾部。行业之间也分化极其显著，创造了近年来的标准差记录。

形成这一史诗级结构性行情的核心是景气度的持续背离，这种背离进一步撬动市场预期，加剧了估值分化。这两者不断交织正反馈，持续推动行情走向极致。

具体而言：一方面，AI 算力需求持续爆发，撑满了供给侧的每一个角落和管道，不仅是 GPU、存储、光通信等核心环节持续受益，更进一步蔓延到了光通信设备、PCB 上游材料及设备、MLCC 及其材料、存储上游半导体晶圆、设备和材料。“紫苏叶投资理论”等投资方法成效斐然。市场资金大幅倾向于供需失衡的景气趋势，淡化公司质地和竞争格局。因为在需求暴增而供给释放迟滞的环节，关注后者的意义很小，甚至适得其反——需求的外溢部分往往弹性更大。在另一方面，以制造和消费为代表的顺周期行业景气度接连遭遇打击。我们曾观察到在 25 年四季度至 26 年一季度，宏观数据初现企稳迹象，部分细分行业数据改善，供给出清，龙头竞争格局优化。但这一景气度的拐头趋势被人民币汇率超预期升值和海峡封锁两个因素打破。政策继续保持定力，维持后发的底线思维特征，与 2023 - 2024 年前三季度存在部分的相似点，但是当前的市场已经完全分割，科技与顺周期已然剔除了正相关性。

我们在一季度同时加仓了算力和制造业，效果彼此对冲。在二季度对组合进行了微调，结合上述的宏观逻辑和个股自身的基本面，我们对五六只个股进行了加减。整体我们保持着科技+制造的核心持仓，并辅以标配的消费、医药、周期等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末浦银 ESG 责任投资混合 A 的基金份额净值为 0.8934，本报告期基金份额净值增长率为-3.66%，同期业绩比较基准收益率为 7.24%；截至本报告期末浦银 ESG 责任投资混合 C 的基金份额净值为 0.8771，本报告期基金份额净值增长率为-3.83%，同期业绩比较基准收益率为 7.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

未来我们还是最关注科技成长和经济景气两条主线。

在科技板块，我们还是分上游算力和下游应用来讨论：

对于算力端，我们认为大的基本面趋势问题不大。当前的算力结构和商业模式都比 23-24 年要健康不少，因为目前算力需求主要由用户自发的、有一定 ROI 的、具有真实场景需求的推理主导（尽管部分场景如 tokenmaxing 有暂时的伪需求但无碍大局）。我们认为算力需求整体向上趋势不变。但我们警惕的部分是市场可能过度透支了这一趋势的节奏和速度。我们看到，除了在部分光通信和半导体个股上，大多数的算力相关标的——尤其是我们前文提到的需求外溢环节——所蕴含的 EPS 都过度乐观，同时叠加了更加乐观的估值。这让我们担心即便算力的整体逻辑出现轻微扰动，对这部分标的的甩鞭效应可能都加剧破坏力。比如，当前算力投入与产出的缺口、国产模型的低价替代、北美电力约束等都可能在算力主升浪上制造短期波动。因此，我们对这一领域的相关投资是比较谨慎的，我们在算力上主要持有的是光通信、AI 电力和少部分半导体。前两者的共同特征是处于需求的核心中央，即便水位波动也不会影响其自身需求，且光通信还能享受渗透率提升的 α 。而半导体则得益于供给端稀缺及国产算力的逻辑共振。

对于应用端，市场在上半年严苛地压缩了板块的估值。无论是算力成本侵蚀还是 AI 颠覆格局，都从或近或远的维度挑战着应用的逻辑。但作为最接近终端用户且算力开支（CSP 的资本开支）的最直接发动者，如果其自身出现问题，那么算力逻辑同样要出现裂缝。市场此前演绎的“买单冤大头”逻辑我们认为有待商榷。我们看到，模型尤其是国产模型能力没有拉开差距，且巨头的自有模型已经赶上。更重要的是这一模型能力也嵌入了其自身的生态和业务中。一些新产品增长迅猛，且有形成飞轮效应的态势。巨头的生态优势稳固并得到强化。

在大制造板块。我们认为上半年汇率和海峡两个因素已经步入尾声，且市场已经充分计价上述影响。我们对中国制造龙头在国内的韧性以及海外的广阔空间继续抱有充足的信心。当前时点的位置可能是一个长周期的底部，业绩和估值都压缩到很低的位置。当然如果我们的视角是长周期，那么一到两个季度的波动确实必须忍受（也已经承受）。我们在上半年做了一定应对，调整了部分结构和个股。接下来，我们会继续跟踪景气度趋势，同时也保持一定的灵活性，避免组合短期产生过大波动。

我们继续秉持以追求高夏普比率为核心目标的产品运作方式，在波动的市场环境中，力求为持有人实现可持续的、经风险调整后的稳健回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引

和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

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。估值委员会由公司基金运营条线分管领导、固定收益/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研部门负责人、基金会计业务骨干一人组成。

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。

本基金基金经理可参与估值委员会对于估值原则和方法的讨论，但对估值政策和估值方案无最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求履行基金估值及净值计算的复核责任。会计师事务所在管理人进行估值调整导致基金资产净值变化达到 0.25%以上时对其采用的估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，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 ESG 责任投资混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	4,147,908.12	59,921,278.62
结算备付金		346,455.31	20,137,785.32
存出保证金		265,932.16	646,654.86
交易性金融资产	6.4.7.2	854,975,415.59	1,196,492,302.98
其中：股票投资		808,531,030.60	1,128,093,406.46
基金投资		-	-
债券投资		46,444,384.99	68,398,896.52
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		8,574,539.19	107,206.49

应收股利		1,345,020.16	-
应收申购款		57,125.50	1,081.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		869,712,396.03	1,277,306,310.25
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		6,617,048.94	15,137,354.45
应付赎回款		1,404,334.26	2,405,666.39
应付管理人报酬		858,612.74	1,228,064.44
应付托管费		143,102.13	204,677.41
应付销售服务费		73,167.10	99,950.11
应付投资顾问费		-	-
应交税费		726.10	447.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	316,155.21	621,754.70
负债合计		9,413,146.48	19,697,914.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	968,189,056.53	1,362,243,402.40
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-107,889,806.98	-104,635,006.85
净资产合计		860,299,249.55	1,257,608,395.55
负债和净资产总计		869,712,396.03	1,277,306,310.25

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 968,189,056.53 份，其中 A 类基金份额净值 0.8934 元，份额总额 683,248,077.41 份；C 类基金份额净值 0.8771 元，份额总额 284,940,979.12 份。

6.2 利润表

会计主体：浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-24,151,171.06	20,573,397.71
1.利息收入		47,216.02	218,419.80

其中：存款利息收入	6.4.7.13	47,216.02	218,419.80
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		115,350,575.65	84,752,501.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	106,045,874.35	73,817,060.51
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	343,352.60	58,248.08
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	8,961,348.70	10,877,192.68
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	-139,635,503.58	-64,407,986.56
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	86,540.85	10,463.20
减：二、营业总支出		7,401,293.11	8,446,229.61
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	5,798,030.79	6,633,056.39
2．托管费	6.4.10.2.2	966,338.49	1,105,509.37
3．销售服务费	6.4.10.2.3	506,250.58	602,150.78
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		239.66	-
8．其他费用	6.4.7.23	130,433.59	105,513.07
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-31,552,464.17	12,127,168.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-31,552,464.17	12,127,168.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-31,552,464.17	12,127,168.10

6.3 净资产变动表

会计主体：浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	1,362,243,402.40	-104,635,006.85	1,257,608,395.55
二、本期期初净资产	1,362,243,402.40	-104,635,006.85	1,257,608,395.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-394,054,345.87	-3,254,800.13	-397,309,146.00
（一）、综合收益总额	-	-31,552,464.17	-31,552,464.17
（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）	-394,054,345.87	28,297,664.04	-365,756,681.83
其中：1.基金申购款	4,343,867.76	-349,465.87	3,994,401.89
2.基金赎回款	-398,398,213.63	28,647,129.91	-369,751,083.72
（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	968,189,056.53	-107,889,806.98	860,299,249.55
项目	上年度可比期间 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	1,207,171,228.62	-270,483,185.02	936,688,043.60
二、本期期初净资产	1,207,171,228.62	-270,483,185.02	936,688,043.60
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	351,240,557.43	-64,897,739.25	286,342,818.18
（一）、综合收益总额	-	12,127,168.10	12,127,168.10

（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）	351,240,557.43	-77,024,907.35	274,215,650.08
其中：1.基金申购款	473,605,508.54	-105,431,728.87	368,173,779.67
2.基金赎回款	-122,364,951.11	28,406,821.52	-93,958,129.59
（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	1,558,411,786.05	-335,380,924.27	1,223,030,861.78

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	喻庆	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 ESG 责任投资混合型证券投资基金(原名为浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金，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[2020]834 号《关于准予浦银安盛 ESG 责任投资股票型证券投资基金注册的批复》和证监许可[2020]2719 号《关于准予浦银安盛 ESG 责任投资股票型证券投资基金变更注册的批复》准予注册，由浦银基金管理有限公司(原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 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,417,818,515.60 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0280 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 16 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,418,719,500.87 份基金份额，其中认购资金利息折合 900,985.27 份基金份额。本基金的基金管理人为浦银基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据《浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同》和《浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据认购/申购费、赎回费及销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费、但不从本类别基金资产中计提销售服务费的为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资对象包括国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、超短期融资券)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货及法律法规或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的相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中港股通股票不超过股票资产的 50%)；本基金非现金资产中不低于 80%的资产将投资于通过 ESG 责任投资方法选择的证券；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率*70%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*10%+中证全债指数收益率*20%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则－基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》、《浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

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 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

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《财政部税务总局关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。2027 年 12 月 31 日前，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

2027 年 12 月 31 日前，对证券投资基金管理人运用基金资产买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对除持有金融债券外的金融同业往来利息收入亦免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。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。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)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。对基金从上市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。

对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(4)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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	4,147,908.12
等于：本金	4,147,331.54
加：应计利息	576.58
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	4,147,908.12

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		906,461,350.50	-	808,531,030.60	-97,930,319.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	46,013,259.00	419,644.99	46,444,384.99	11,481.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	46,013,259.00	419,644.99	46,444,384.99	11,481.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		952,474,609.50	419,644.99	854,975,415.59	-97,918,838.90

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

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

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：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提债权投资减值准备。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内未计提其他债权投资减值准备。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	117.86
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	212,517.80
其中：交易所市场	212,517.80
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	103,519.55
合计	316,155.21

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浦银 ESG 责任投资混合 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	997,483,094.73	997,483,094.73
本期申购	3,326,294.35	3,326,294.35
本期赎回（以“-”号填列）	-317,561,311.67	-317,561,311.67
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	683,248,077.41	683,248,077.41

浦银 ESG 责任投资混合 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	364,760,307.67	364,760,307.67
本期申购	1,017,573.41	1,017,573.41
本期赎回（以“-”号填列）	-80,836,901.96	-80,836,901.96
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	284,940,979.12	284,940,979.12

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

浦银 ESG 责任投资混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-212,759,819.04	140,241,695.16	-72,518,123.88
本期期初	-212,759,819.04	140,241,695.16	-72,518,123.88
本期利润	75,625,002.30	-96,801,137.97	-21,176,135.67
本期基金份额交易产生的变动数	58,980,099.86	-38,146,065.45	20,834,034.41
其中：基金申购款	-523,906.44	270,348.44	-253,558.00
基金赎回款	59,504,006.30	-38,416,413.89	21,087,592.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-78,154,716.88	5,294,491.74	-72,860,225.14

浦银 ESG 责任投资混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-82,162,018.85	50,045,135.88	-32,116,882.97
本期期初	-82,162,018.85	50,045,135.88	-32,116,882.97
本期利润	32,458,037.11	-42,834,365.61	-10,376,328.50
本期基金份额交易产生的变动数	12,778,207.93	-5,314,578.30	7,463,629.63
其中：基金申购款	-156,070.18	60,162.31	-95,907.87
基金赎回款	12,934,278.11	-5,374,740.61	7,559,537.50

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-36,925,773.81	1,896,191.97	-35,029,581.84

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	39,311.37
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	7,124.60
其他	780.05
合计	47,216.02

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	106,045,874.35
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	106,045,874.35

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	779,209,877.80
减：卖出股票成本总额	671,757,935.08
减：交易费用	1,406,068.37
买卖股票差价收入	106,045,874.35

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	326,238.60
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	17,114.00

券到期兑付）差价收入	
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	343,352.60

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	48,373,676.01
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	47,899,190.00
减：应计利息总额	457,372.01
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	17,114.00

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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,961,348.70
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	8,961,348.70

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-139,635,503.58
股票投资	-139,623,440.58
债券投资	-12,063.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
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	-139,635,503.58

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	85,803.59
基金转换费收入	737.26
合计	86,540.85

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	4,937.26
账户维护费	18,600.00
证券组合费	12,676.78
合计	130,433.59

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据本基金的基金管理人于 2026 年 8 月 13 日发布的《关于公司法定名称变更的公告》，基金管理人的中文法定名称自 2026 年 8 月 12 日起由“浦银安盛基金管理有限公司”变更为“浦银基金管理有限公司”。根据本基金的基金管理人于 2026 年 8 月 13 日发布的《浦银基金管理有限公司关于旗下基金名称变更的公告》，本基金的基金名称自 2026 年 8 月 13 日起由“浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金”变更为“浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金”。

6.4.9 关联方、关联关系

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

根据本基金的基金管理人于 2026 年 1 月 29 日发布的《浦银安盛基金管理有限公司关于公司股东变更的公告》，根据基金管理人 2025 年度第五次股东会会议决议及中国证券监督管理委员会证监许可[2026]177 号文核准，基金管理人原股东法国安盛投资管理公司（AXA Investment Managers S.A.）被法国巴黎资产管理控股公司（BNP Paribas Asset Management Holding S.A.）吸收合并。因此，法国巴黎资产管理控股公司（BNP Paribas Asset Management Holding S.A.）成为基金管理人股东，持有基金管理人 39%股权。

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
浦银基金管理有限公司(“浦银基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司(“上海浦东发展银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	5,798,030.79	6,633,056.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,629,477.81	2,644,008.24
应支付基金管理人的净管理费	3,168,552.98	3,989,048.15

注：支付基金管理人浦银基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.2%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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.2%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	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	966,338.49	1,105,509.37

注：支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.2%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：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.2%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银 ESG 责任投资混合 A	浦银 ESG 责任投资混合 C	合计
浦银基金	-	10,481.20	10,481.20
上海浦东发展银行	-	1,215.08	1,215.08
兴业银行	-	469,269.52	469,269.52
合计	-	480,965.80	480,965.80
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浦银 ESG 责任投资混合 A	浦银 ESG 责任投资混合 C	合计
浦银基金	-	16,692.90	16,692.90
上海浦东发展银行	-	1,844.28	1,844.28
兴业银行	-	536,087.89	536,087.89
合计	-	554,625.07	554,625.07

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.35%年费率计提。计算方法如下：

H＝E×0.35%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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与上年度可比期间均未持有本基金。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行-活期	4,147,908.12	39,311.37	91,629,244.80	199,844.45

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管，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：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

本基金本报告期内及上年度可比期间均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（2026 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										
证券代码	证券	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本总额	期末估值总额	备注

	名称	日		类型		单价	位：股）			
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股锁定	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	23,549	238,080.39	238,080.39	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	1 个月内（含）	新股流通受限	10.11	10.11	10,092	102,030.12	102,030.12	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股锁定	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁定	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	10.12	27.73	4,198	42,483.76	116,410.54	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁定	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-

603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁定	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁定	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股锁定	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

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

本基金为混合型基金，理论上其预期风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于

股票型基金。本基金可投资港股通标的股票，需承担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。

本基金的投资对象包括国内依法发行上市的股票(包括主板，中小板，创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)，港股通标的股票，股指期货，债券(包括国债，央行票据，金融债，企业债，公司债，次级债，地方政府债券，政府支持机构债券，政府支持债券，中期票据，可转换债券(含分离交易可转债)，短期融资券，超短期融资券)，资产支持证券，债券回购，银行存款，同业存单，货币市场工具，国债期货及法律法规或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的相关规定)。本基金的投资组合比例为：本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中港股通股票不超过股票资产的 50%)；本基金非现金资产中不低于 80%的资产将投资于通过 ESG 责任投资方法选择的证券；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理，设立了三层次的风险控制体系：第一层次为各业务部门对各自部门潜在风险的自我管理和检查；第二层次为公司总经理领导的管理层、风险管理委员会、风险管理部和法律合规部的风险管理；第三层次为董事会层面对公司的风险管理，包括董事会、审计委员会、合规风控委员会、督察长和内部审计。董事会对风险管理负最终责任。

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。

本基金管理人要求所有员工应自觉接受并配合董事会、及下设的审计委员会、合规风控委员会、督察长和审计部对各项业务和工作行为的检查监督，坚决执行公司规定的风险控制措施，以及采纳合理的风险分析和管理建议。

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兴业银行股份有限公司，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 2026 年 6 月 30 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券投资和资产支持证券投资(2025 年 12 月 31 日：同)。

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 2026 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 2026 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 2026 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、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	4,147,908.12	-	-	-	4,147,908.12
结算备付金	346,455.31	-	-	-	346,455.31
存出保证金	265,932.16	-	-	-	265,932.16
交易性金融资产	46,444,384.99	-	-	808,531,030.60	854,975,415.59
应收股利	-	-	-	1,345,020.16	1,345,020.16
应收申购款	-	-	-	57,125.50	57,125.50
应收清算款	-	-	-	8,574,539.19	8,574,539.19
资产总计	51,204,680.58	-	-	818,507,715.45	869,712,396.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,404,334.26	1,404,334.26
应付管理人报酬	-	-	-	858,612.74	858,612.74
应付托管费	-	-	-	143,102.13	143,102.13
应付清算款	-	-	-	6,617,048.94	6,617,048.94
应付销售服务费	-	-	-	73,167.10	73,167.10
应交税费	-	-	-	726.10	726.10
其他负债	-	-	-	316,155.21	316,155.21
负债总计	-	-	-	9,413,146.48	9,413,146.48
利率敏感度缺口	51,204,680.58	-	-	809,094,568.97	860,299,249.55
上年度末 2025 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	59,921,278.62	-	-	-	59,921,278.62
结算备付金	20,137,785.32	-	-	-	20,137,785.32
存出保证金	646,654.86	-	-	-	646,654.86
交易性金融资产	68,398,896.52	-	-	1,128,093,406.46	1,196,492,302.98
应收申购款	-	-	-	1,081.98	1,081.98
应收清算款	-	-	-	107,206.49	107,206.49
资产总计	149,104,615.32	-	-	1,128,201,694.93	1,277,306,310.25
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,405,666.39	2,405,666.39
应付管理人报酬	-	-	-	1,228,064.44	1,228,064.44
应付托管费	-	-	-	204,677.41	204,677.41
应付清算款	-	-	-	15,137,354.45	15,137,354.45
应付销售服务费	-	-	-	99,950.11	99,950.11
应交税费	-	-	-	447.20	447.20
其他负债	-	-	-	621,754.70	621,754.70
负债总计	-	-	-	19,697,914.70	19,697,914.70
利率敏感度缺口	149,104,615.32	-	-	1,108,503,780.23	1,257,608,395.55

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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.4%(2025 年 12 月 31 日：5.44%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2025 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。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	270,096,737.62	-	270,096,737.62

资产合计	-	270,096,737.62	-	270,096,737.62
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	270,096,737.62	-	270,096,737.62

项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	439,428,340.37	-	439,428,340.37
资产合计	-	439,428,340.37	-	439,428,340.37
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	439,428,340.37	-	439,428,340.37

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	1.所有外币相对人民币升值 5%	13,504,836.88	21,971,417.02
	2.所有外币相对人民币贬值 5%	-13,504,836.88	-21,971,417.02

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的

影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；同时采用“自下而上”的策略通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票资产占基金资产的比例为 60%-95%(其中港股通股票不超过股票资产的 50%)；本基金非现金资产中不低于 80%的资产将投资于通过 ESG 责任投资方法选择的证券；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金，存出保证金，应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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	808,531,030.60	93.98	1,128,093,406.46	89.70
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	808,531,030.60	93.98	1,128,093,406.46	89.70

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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月

			31 日 ）
	业绩比较基准上升 500 基点	39,340,387.92	57,598,173.41
	业绩比较基准下降 500 基点	-39,340,387.92	-57,598,173.41

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	807,876,935.44	1,126,970,151.13
第二层次	46,784,495.50	68,398,896.52
第三层次	313,984.65	1,123,255.33
合计	854,975,415.59	1,196,492,302.98

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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025 年 12 月 31 日：同)。

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	808,531,030.60	92.97
	其中：股票	808,531,030.60	92.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	46,444,384.99	5.34
	其中：债券	46,444,384.99	5.34
	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	4,494,363.43	0.52
8	其他各项资产	10,242,617.01	1.18
9	合计	869,712,396.03	100.00

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 270,096,737.62 元，占基金资产净值的比例为 31.40%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	538,071,039.01	62.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供	340,110.51	0.04

	应业		
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	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	21,560.00	0.00
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	538,434,292.98	62.59

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	-	-
非周期性消费品	72,808,470.67	8.46
周期性消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗	64,996,132.67	7.56
工业	14,502,874.64	1.69
信息科技	46,500,954.50	5.41
电信服务	71,288,305.14	8.29
公用事业	-	-
房地产	-	-
合计	270,096,737.62	31.40

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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

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	601058	赛轮轮胎	6,754,900	77,883,997.00	9.05
2	300502	新易盛	123,729	75,103,503.00	8.73
3	09690	途虎-W	6,597,500	72,774,284.54	8.46
4	00700	腾讯控股	190,900	71,263,502.61	8.28
5	002475	立讯精密	937,800	66,021,120.00	7.67

6	300750	宁德时代	150,600	59,187,306.00	6.88
7	603337	杰克科技	1,594,700	57,775,981.00	6.72
8	688036	传音控股	887,552	52,321,190.40	6.08
9	01093	石药集团	7,526,000	45,560,849.88	5.30
10	301345	涛涛车业	194,000	44,814,000.00	5.21
11	603100	川仪股份	1,498,524	27,048,358.20	3.14
12	002014	永新股份	2,485,650	26,248,464.00	3.05
13	01810	小米集团-W	1,315,200	24,719,739.01	2.87
14	00981	中芯国际	280,500	21,780,367.79	2.53
15	00512	远大医药	4,761,000	19,435,282.79	2.26
16	688789	宏华数科	314,702	16,732,705.34	1.94
17	605196	华通线缆	530,700	13,851,270.00	1.61
18	600079	ST 人福	776,100	12,759,084.00	1.48
19	01055	中国南方航空股份	3,903,068	11,492,132.92	1.34
20	688087	英科再生	124,176	4,149,961.92	0.48
21	603279	景津装备	314,700	3,776,400.00	0.44
22	00670	中国东方航空股份	732,000	2,009,060.38	0.23
23	00753	中国国航	272,000	1,001,681.34	0.12
24	001248	华润新能源	33,641	340,110.51	0.04
25	001399	惠科股份	4,198	116,410.54	0.01
26	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
27	688120	华海清科	187	60,247.66	0.01
28	02313	申洲国际	1,000	34,186.13	0.00
29	00941	中国移动	375	24,802.53	0.00
30	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
31	600919	江苏银行	2,000	21,560.00	0.00
32	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
33	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
34	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
35	001369	双欣材料	897	12,127.44	0.00
36	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
37	603306	华懋科技	100	10,369.00	0.00
38	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
39	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
40	603293	埃泰克	116	4,252.24	0.00
41	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
42	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
43	02382	舜宇光学科技	16	847.70	0.00
44	601026	道生天合	51	743.58	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	300502	新易盛	60,389,101.62	4.80
2	01093	石药集团	56,448,157.68	4.49
3	002475	立讯精密	47,078,227.00	3.74
4	301345	涛涛车业	40,840,632.00	3.25
5	03896	金山云	22,013,109.73	1.75
6	00981	中芯国际	20,974,788.17	1.67
7	605196	华通线缆	20,831,925.00	1.66
8	688789	宏华数科	20,207,374.12	1.61
9	00883	中国海洋石油	18,242,339.58	1.45
10	300751	迈为股份	18,171,612.00	1.44
11	603337	杰克科技	14,743,499.00	1.17
12	00700	腾讯控股	14,296,744.01	1.14
13	300866	安克创新	14,263,315.76	1.13
14	01055	中国南方航空股份	11,998,954.80	0.95
15	09690	途虎-W	11,802,506.16	0.94
16	000001	平安银行	11,534,344.00	0.92
17	688036	传音控股	10,790,579.22	0.86
18	600036	招商银行	10,728,069.00	0.85
19	003021	兆威机电	9,850,803.00	0.78
20	603100	川仪股份	9,721,297.00	0.77

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	06869	长飞光纤光缆	97,856,974.69	7.78
2	300751	迈为股份	74,369,188.01	5.91
3	300910	瑞丰新材	65,147,677.53	5.18
4	06198	青岛港	46,046,228.12	3.66
4	601298	青岛港	5,863,686.00	0.47
5	002475	立讯精密	39,683,067.00	3.16
6	300502	新易盛	37,319,031.40	2.97
7	600919	江苏银行	36,558,177.00	2.91
8	603337	杰克科技	30,582,213.00	2.43
9	01810	小米集团-W	29,037,559.29	2.31
10	600079	ST 人福	24,621,496.00	1.96

11	00512	远大医药	23,972,561.96	1.91
12	03896	金山云	23,028,719.62	1.83
13	601058	赛轮轮胎	19,085,637.00	1.52
14	688036	传音控股	18,937,309.25	1.51
15	00883	中国海洋石油	18,579,467.71	1.48
16	00700	腾讯控股	17,361,828.38	1.38
17	300866	安克创新	15,634,530.00	1.24
18	300750	宁德时代	13,932,948.00	1.11
19	603100	川仪股份	13,897,822.00	1.11
20	688087	英科再生	13,759,146.29	1.09

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	491,818,999.80
卖出股票收入（成交）总额	779,209,877.80

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	46,444,384.99	5.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	46,444,384.99	5.40

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019785	25 国债 13	238,000	24,100,486.41	2.80
2	019827	26 国债 01	222,000	22,343,898.58	2.60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

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	265,932.16
2	应收清算款	8,574,539.19
3	应收股利	1,345,020.16
4	应收利息	-
5	应收申购款	57,125.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,242,617.01

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
浦银 ESG 责任投资混合 A	6,779	100,788.92	183,020,905.28	26.79	500,227,172.13	73.21
浦银 ESG 责任投资混合 C	29,087	9,796.16	25,451.77	0.01	284,915,527.35	99.99
合计	35,866	26,994.62	183,046,357.05	18.91	785,142,699.48	81.09

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	93.43

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	浦银 ESG 责任投资混合 A	1,867,018.34	0.27
	浦银 ESG 责任投资混合 C	3,253.83	0.00
	合计	1,870,272.17	0.19

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浦银 ESG 责任投资混合 A	>100
	浦银 ESG 责任投资混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	浦银 ESG 责任投资混合 A	>100
	浦银 ESG 责任投资混合 C	0
	合计	>100

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浦银 ESG 责任投资混合 A	浦银 ESG 责任投资混合 C
基金合同生效日（2021 年 3 月 16 日）基金份额总额	1,483,922,110.54	934,797,390.33
本报告期期初基金份额总额	997,483,094.73	364,760,307.67
本报告期基金总申购份额	3,326,294.35	1,017,573.41
减：本报告期基金总赎回份额	317,561,311.67	80,836,901.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	683,248,077.41	284,940,979.12

注：总申购份额含转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人重大人事变动如下：

2026 年 2 月 12 日，黄俊麟先生新任公司首席信息官。具体信息请参见基金管理人于 2026 年 2 月 14 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》。

2026 年 3 月 11 日，顾佳女士新任公司督察长，喻庆先生离任公司督察长，喻庆先生新任公司副总经理兼财务负责人，顾佳女士离任公司副总经理兼财务负责人。具体信息请参见基金管理人于 2026 年 3 月 13 日在规定媒介披露的《浦银安盛基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》。

2026 年 5 月 8 日，公司 2026 年第三次股东会会议审议通过，同意黄雄先生接替屠旋旋先生续任公司第六届董事会董事。

报告期内托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

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容诚会计师事务所（特殊普通合伙），未有改聘情况发生。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人未有受到有权机关调查、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 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，管理人相关从业人员未有受到有权机关调查、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。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
国泰海通证券	2	1,073,553,702.47	84.53	503,104.22	85.16	-
天风证券	1	154,889,221.49	12.20	69,063.51	11.69	-
长江证券	2	41,657,715.31	3.28	18,575.11	3.14	-

国盛证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：1、证券公司交易单元选择的标准和程序：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

①基本情况：包括但不限于资本充足、近三年财务状况良好；主要股东经营稳健；具备高效、安全的通讯条件，能够提供有效交易执行服务。

②公司治理：公司治理完善，经营行为规范，具备健全的内控制度、合规管理体系，风险管理稳健。

③研究实力：有具备较强综合研究能力和行业分析能力的专职研究团队；研究覆盖面广，能涵盖宏观经济、行业、公司等各项领域；研究报告分析严谨，观点独立、客观，并有完善的研究报告质量和合规保障机制。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

对于符合选择证券公司参与证券交易标准的证券公司，经公司相关审批程序，可纳入公司备选池。在备选池中的证券公司方可参加券商考核，并被选择参与证券交易。公司会与被选中的证券公司签订协议，督察长及法律合规部在上述过程中履行合规审查职责。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过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(%)
国泰海通证券	22,721,120.00	41.29	-	-	-	-
天风证券	14,117,229.00	25.65	-	-	-	-
长江证券	18,196,198.00	33.06	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
招商证	-	-	-	-	-	-

券						

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026 年 1 月 22 日
2	浦银安盛基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	报刊及规定网站	2026 年 1 月 29 日
3	浦银安盛基金管理有限公司关于上海分公司负责人变更的公告	报刊及规定网站	2026 年 1 月 29 日
4	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	2026 年 2 月 14 日
5	浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2026 年 3 月 6 日
6	浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金招募说明书（更新）2026 年第 1 号	规定网站	2026 年 3 月 6 日
7	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	2026 年 3 月 13 日
8	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（2025 年度）	报刊及规定网站	2026 年 3 月 30 日
9	浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026 年 3 月 31 日
10	浦银安盛 ESG 责任投资混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026 年 4 月 22 日
11	2025 年度浦银安盛基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	报刊及规定网站	2026 年 4 月 30 日

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：本基金报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、 中国证监会批准本基金募集的文件

2、 浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金基金合同

3、 浦银 ESG 责任投资混合型证券投资基金招募说明书

4、 浦银 ESG 责任投资混合型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.spdbfunds.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。

浦银基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日