

平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资
基金
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 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

3.3 其他指标..... 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合规守信情况的说明..... 10

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... 10

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..... 10

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... 11

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... 11

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... 11

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..... 11

§ 5 托管人报告..... 12

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... 12

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... 12

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见..... 12

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）..... 12

6.1 资产负债表..... 12

6.2 利润表..... 13

6.3 净资产变动表..... 15

6.4 报表附注..... 16

§ 7 投资组合报告..... 39

7.1 期末基金资产组合情况..... 39

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... 39

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..... 41

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..... 50

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..... 50

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..... 50

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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
8.3 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	52
§ 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	52
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	54
§ 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
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	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	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 平安
基金主代码	510390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 25 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	118,549,992.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 1 月 26 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数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。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票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		平安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李海波	郭明
	联系电话	0755-88622632	(010)66105799
	电子邮箱	funds@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	北京市西城区复兴门内大街 55

	5033 号平安金融中心 34 层	号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	罗春风	廖林

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	fund.pingan.com
基金中期报告置备地点	基金管理人、基金托管人住所

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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	24,044,687.25
本期利润	48,371,869.81
加权平均基金份额本期利润	0.4847
本期加权平均净值利润率	9.09%
本期基金份额净值增长率	8.99%
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	173,599,028.76
期末可供分配基金份额利润	1.4644
期末基金资产净值	668,994,013.73
期末基金份额净值	5.6431
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	49.58%

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；

2. 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（为期末余额，而非当期发生数）；

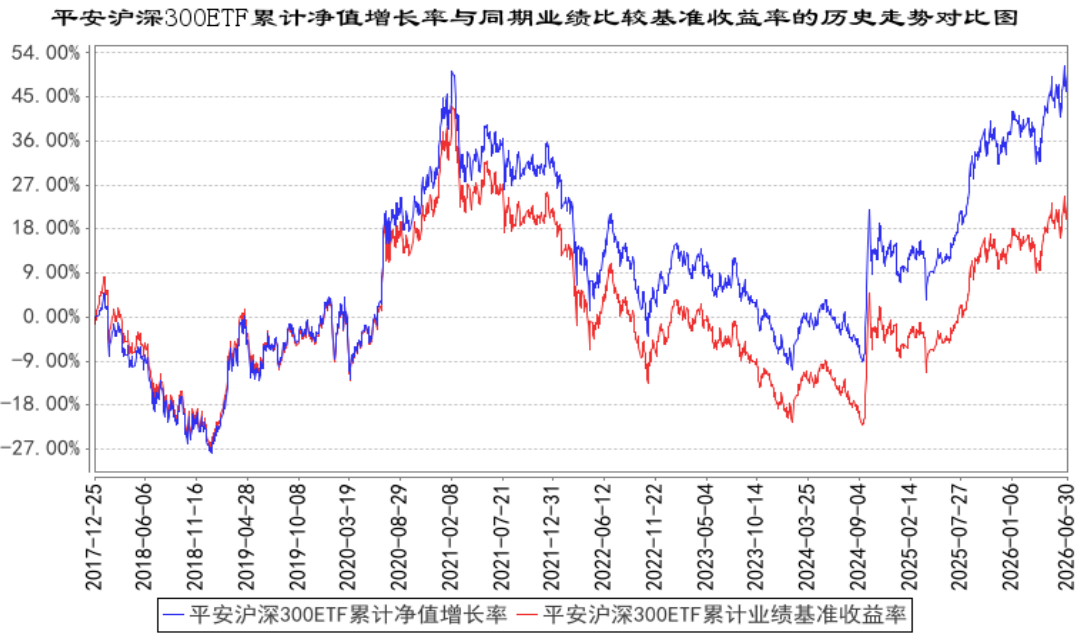
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

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	13.11%	1.24%	11.90%	1.26%	1.21%	-0.02%
过去六个月	8.99%	1.12%	7.55%	1.13%	1.44%	-0.01%
过去一年	30.40%	1.01%	26.51%	1.02%	3.89%	-0.01%
过去三年	40.65%	1.10%	29.59%	1.11%	11.06%	-0.01%
过去五年	8.81%	1.11%	-4.68%	1.12%	13.49%	-0.01%
过去七年	59.11%	1.16%	30.16%	1.17%	28.95%	-0.01%
自基金合同生效起至今	49.58%	1.20%	22.81%	1.21%	26.77%	-0.01%

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



注：1、本基金基金合同于 2017 年 12 月 25 日正式生效；

2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

§ 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

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，总部位于深圳，是中国平安集团投资板块的重要成员。公司业务范围涵盖公募基金管理业务、资本市场专户管理业务，具有受托管理保险资金资产管理人资格、合格境内机构投资者（QDII）资格。截至 2026 年上半年末，公司综合管理规模超 9500 亿元，公募管理规模 7900 亿元，累计服务客户数超 1.7 亿人，产品线涵盖货币、债券、混合、股票、指数、FOF、MOM、REITs 等各类产品。公司以“为持有人创造价值”为使命，打造了一支人才梯队完善、长期业绩优异的近 170 人投研团队，构建起“业绩可归因、策略可复制、人才可持续”的专业投研平台，为投资者创造长期稳健的投资回报，致力成为受投资者信赖、行业领先的综合型资产管理公司。

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		
李严	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 12 月 25 日	-	5 年	李严先生，复旦大学应用统计学专业硕士，曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心高级研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证

					A500 交易型开放式指数证券投资基金、平安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理。平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、平安上证 180 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决

定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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，本基金管理人严格遵守《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，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规的规定及基金合同的约定。

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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人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超过该证券当日成交量的 5%的交易共有 5 次，为公司旗下的指数量化投资组合与其他组合因投资策略需要而发生的同日反向交易，或为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

作为一只投资于沪深 300 指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。报告期内，本基金的日均偏离度为 0.02%，年化跟踪误差 0.60%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.6431 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.99%，业绩比较基准收益率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年 A 股市场整体呈现结构性行情，股价波动明显加大。展望下半年，我们对 A 股市场仍然维持乐观判断。基本面方面，国内通胀水平温和回升有望带动企业盈利整体向好；经济内部 K 型分化明显，预计传统内需板块在政策发力下有望企稳，高端制造及出口链在 AI 产业趋势下仍将保持高景气；整体看下半年基本面将对市场形成更有力支撑。流动性方面，市场对于美联储年内利率变化仍有分歧，若地缘冲突缓和、油价回落，则相关冲击会明显淡化，国内宏观流动性整体充裕，低利率环境下 A 股增量资金可期。方向上，全球 AI 浪潮加速，并进入盈利兑现阶段，有望继续带动科技、能源、先进制造等多维度投资机会；低波红利类资产也有望受益低利率环境下配置资金流入。

作为指数化产品管理者，积极做好组合管理，为投资者提供优质投资工具。

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。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究部及投资管理部门、运营部、风险管理部及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

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，符合基金合同的约定。

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

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 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

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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：平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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	6,057,891.37	2,461,374.25
结算备付金		1,385,308.58	1,456,987.38
存出保证金		386,750.00	515,669.08
交易性金融资产	6.4.7.2	661,755,969.99	494,039,632.39
其中：股票投资		661,755,969.99	494,039,632.39
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	-	-

应收清算款		2,056,807.29	134,886.62
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		671,703,219.86	498,608,549.72
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		-	365,025.63
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		249,800.38	215,826.53
应付托管费		49,960.09	43,165.33
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		9,359.72	7,259.56
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,400,085.94	649,165.53
负债合计		2,709,206.13	1,280,442.58
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	495,394,984.97	401,372,311.77
未分配利润	6.4.7.12	173,599,028.76	95,955,795.37
净资产合计		668,994,013.73	497,328,107.14
负债和净资产总计		671,703,219.86	498,608,549.72

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 5.6431 元，基金份额总额 118,549,992.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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		50,099,484.83	9,632,214.14
1. 利息收入		16,896.47	18,594.91
其中：存款利息收入	6.4.7.13	16,896.47	18,594.91

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）		25,952,146.31	4,240,891.66
其中：股票投资收益	6.4.7.14	20,000,269.61	-3,407,357.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	12,466.93
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	277,963.69	121,785.82
股利收益	6.4.7.19	5,673,913.01	7,513,996.28
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	24,327,182.56	5,370,460.03
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	-196,740.51	2,267.54
减：二、营业总支出		1,727,615.02	1,925,430.22
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,314,614.71	1,435,411.60
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	262,922.96	287,082.33
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		1,002.83	445.45
8. 其他费用	6.4.7.23	149,074.52	202,490.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		48,371,869.81	7,706,783.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		48,371,869.81	7,706,783.92

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		48,371,869.81	7,706,783.92

6.3 净资产变动表

会计主体：平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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	401,372,311.77	95,955,795.37	497,328,107.14
二、本期期初净资产	401,372,311.77	95,955,795.37	497,328,107.14
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	94,022,673.20	77,643,233.39	171,665,906.59
(一)、综合收益总额	-	48,371,869.81	48,371,869.81
(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)	94,022,673.20	29,271,363.58	123,294,036.78
其中：1. 基金申购款	173,001,718.74	51,498,037.81	224,499,756.55
2. 基金赎回款	-78,979,045.54	-22,226,674.23	-101,205,719.77
(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	495,394,984.97	173,599,028.76	668,994,013.73
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	589,417,658.26	12,818,272.56	602,235,930.82
二、本期期初净资产	589,417,658.26	12,818,272.56	602,235,930.82
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-52,652,697.01	6,296,978.49	-46,355,718.52

(一)、综合收益总额	-	7,706,783.92	7,706,783.92
(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)	-52,652,697.01	-1,409,805.43	-54,062,502.44
其中:1.基金申购款	11,282,720.79	-227,751.30	11,054,969.49
2.基金赎回款	-63,935,417.80	-1,182,054.13	-65,117,471.93
(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	536,764,961.25	19,115,251.05	555,880,212.30

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:

<u>罗春风</u>	<u>肖宇鹏</u>	<u>马杰</u>
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

平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华沪深 300 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[2017]2055 号《关于准予平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 5,721,050,037.00 元(含募集股票市值),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(2017)第 1086 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,723,055,617.00 份,其中认购资金利息折合 2,005,580.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为

中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]15 号审核同意,本基金 1,369,549,992.000 份基金份额于 2018 年 1 月 26 日在上交所挂牌交易。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深 300 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股及其备选成份股;此外,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券、债券回购以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)。本基金在履行适当程序后,参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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%。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 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率。

本基金的基金管理人平安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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》、《平安沪深 300 交易型开放式指数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于 2026 年 06 月 30 日的财

务状况以及自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

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[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[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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(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。

(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	6,057,891.37
等于：本金	6,057,529.76
加：应计利息	361.61
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	6,057,891.37

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		560,900,948.64	-	661,755,969.99	100,855,021.35
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		560,900,948.64	-	661,755,969.99	100,855,021.35

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 2026 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	2, 912, 760. 00	-	-	
其中： 股指期货 投资	2, 912, 760. 00	-	-	
其他衍 生工具	-	-	-	
合计	2, 912, 760. 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
IF2609	IF2609	2.00	2,909,880.00	-2,880.00
合计				-2,880.00

减:可抵销期货 暂收款				-2,880.00
净额				0.00

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：本基金于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

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

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：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	—

其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	34,613.44
其中：交易所市场	34,613.44
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
应退退补款	2,218,607.57
可退替代款	57,604.78
合计	2,400,085.94

注：1、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购（赎回）本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额；

2、应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购（赎回）本基金时，替代价格与实际买入成本（实际卖出金额）或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,049,992.00	401,372,311.77
本期申购	41,400,000.00	173,001,718.74
本期赎回（以“-”号填列）	-18,900,000.00	-78,979,045.54
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	118,549,992.00	495,394,984.97

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

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	126,934,454.57	-30,978,659.20	95,955,795.37
本期期初	126,934,454.57	-30,978,659.20	95,955,795.37
本期利润	24,044,687.25	24,327,182.56	48,371,869.81
本期基金份额交易产生的变动数	34,260,512.44	-4,989,148.86	29,271,363.58
其中：基金申购款	61,380,849.24	-9,882,811.43	51,498,037.81
基金赎回款	-27,120,336.80	4,893,662.57	-22,226,674.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	185,239,654.26	-11,640,625.50	173,599,028.76

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	9,647.82
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	7,196.90
其他	51.75
合计	16,896.47

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	12,709,225.04
股票投资收益——赎回差价收入	7,291,044.57
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	20,000,269.61

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	92,796,214.32
减：卖出股票成本总额	79,980,326.63

减：交易费用	106,662.65
买卖股票差价收入	12,709,225.04

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 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	101,205,719.77
减：现金支付赎回款总额	42,485,955.77
减：赎回股票成本总额	51,428,719.43
减：交易费用	-
赎回差价收入	7,291,044.57

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

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买卖差价收入。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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。

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	277,963.69

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	5,673,913.01
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	5,673,913.01

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	24,250,562.56
股票投资	24,250,562.56
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	76,620.00
权证投资	-
期货投资	76,620.00
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	24,327,182.56

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	-
替代损益	-196,740.51
合计	-196,740.51

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	307.00
其他	69,424.36
合计	149,074.52

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

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

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

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
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“平安 300ETF 联接基金”）	本基金管理人管理的其他基金

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。

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
平安证券	-	-	47,823,707.83	79.56

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无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：本基金本报告期及上年度可比期间均无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：本基金本报告期及上年度可比期间均无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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
-	-	-	-	-
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 佣金	占当期佣金总量的 比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 （%）
平安证券	8,890.02	79.56	7,139.63	78.83

注：1、上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

2、该类佣金协议的服务范围仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

3、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

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	1,314,614.71	1,435,411.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	44,341.29	51,233.57
应支付基金管理人的净管理费	1,270,273.42	1,384,178.03

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	262,922.96	287,082.33

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

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转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

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：无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
平 安 300ETF 联接基金	101,663,848.00	85.7561	83,756,151.00	87.2006

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

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
工商银行-活期	6,057,891.37	9,647.82	8,975,410.41	10,432.90

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

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

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人的最终控股母公司平安集团发行的股票中国平安、基金管理人关联方平安银行发行的股票平安银行、本基金托管行发行的股票工商银行和基金管理人关联方方正证券发行的股票方正证券。

(1) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 754,900.00 股工商银行的普通股，成本总额为人民币 4,627,776.56 元，估值总额为人民币 5,337,143.00 元，占基金资产净值的比例为 0.80%(2025 年 12 月 31 日：数量：631,700.00 股；成本：3,338,945.32 元；市值 5,009,381.00 元；占基金资产净值的比例为 1.01%)。

(2) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 248,562.00 股中国平安的普通股，成本总额为人民币 13,624,972.16 元，估值总额为人民币 11,866,349.88 元，占基金资产净值的比例为 1.77%(2025 年 12 月 31 日：数量：208,162.00 股；成本：11,274,062.48 元；市值：14,238,280.80 元；占基金资产净值的比例：2.86%)。

(3) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 223,926.00 股平安银行的普通股，成本总额为人民币 2,841,734.08 元，估值总额为人民币 2,250,456.30 元，占基金资产净值的比例为 0.34%(2025 年 12 月 31 日：数量：189,626.00 股；成本：2,576,886.89 元；市值：2,163,632.66 元；占基金资产净值的比例：0.44%)。

(4) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 96,500.00 股方正证券的普通股，成本总额为人民币 717,397.97 元，估值总额为人民币 694,800.00 元，占基金资产净值的比例为 0.10%（2025 年 12 月 31 日：数量：80,700.00 股；成本：612,221.59 元；市值：629,460.00 元；占基金资产净值的比例：0.13%）。

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	证	成功	受限	流	认购	期末	数量	期末	期末估值总额	备

代码	券名称	认购日	期	通受限类型	价格	估值单价	(单位:股)	成本总额		注
001248	华润新能源	2026年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	8,931	90,292.41	90,292.41	-
001248	华润新能源	2026年6月24日	6个月	新股锁定	10.11	10.11	20,841	210,702.51	210,702.51	-
001393	维通利	2026年5月8日	6个月	新股锁定	30.38	38.99	363	11,027.94	14,153.37	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股锁定	10.12	27.73	3,244	32,829.28	89,956.12	-
301513	尚水智能	2026年4月10日	6个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301682	宏明电子	2026年3月18日	6个月	新股锁定	69.66	160.06	459	31,973.94	73,467.54	-
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	-
301696	三瑞智能	2026年3月31日	6个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
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	-
603459	红	2026	6个月	新	17.70	84.32	325	5,752.50	27,404.00	-

	板科技	年 3 月 31 日		股锁定						
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股锁定	8.62	57.42	24,363	210,009.06	1,398,923.46	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	2,018	230,617.04	1,366,064.92	-
688818	电科蓝天	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股锁定	9.47	70.14	1,527	14,460.69	107,103.78	-
688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股锁定	19.68	141.49	717	14,110.56	101,448.33	-

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。4. 基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。5. 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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日期	停牌原	期末估值单价	复牌日	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	------	-----	--------	-----	--------	-------	--------	--------	----

	称		因		期					
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大 事项 停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	4,300	2,798,206.47	3,577,600.00	

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市场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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、审计与风险控制委员会、风控负责人、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

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同责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生

的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

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》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）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组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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的发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%，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%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内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 个工作日内可变现资产的可变现价值。

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

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

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因市场利率变动而发生波动的风险。
本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

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	6,057,891.37	-	-	-	6,057,891.37
结算备付金	1,385,308.58	-	-	-	1,385,308.58
存出保证金	37,564.40	-	-	349,185.60	386,750.00
交易性金融资产	-	-	-	661,755,969.99	661,755,969.99
应收清算款	-	-	-	2,056,807.29	2,056,807.29
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	7,480,764.35	-	-	664,222,455.51	671,703,219.86
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	249,800.38	249,800.38
应付托管费	-	-	-	49,960.09	49,960.09
应交税费	-	-	-	9,359.72	9,359.72
其他负债	-	-	-	2,400,085.94	2,400,085.94
负债总计	-	-	-	2,709,206.13	2,709,206.13
利率敏感度缺口	7,480,764.35	-	-	-661,513,249.38	668,994,013.73
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	2,461,374.25	-	-	-	2,461,374.25
结算备付金	1,456,987.38	-	-	-	1,456,987.38
存出保证金	19,603.48	-	-	496,065.60	515,669.08
交易性金融资产	-	-	-	-494,039,632.39	494,039,632.39
应收清算款	-	-	-	134,886.62	134,886.62
资产总计	3,937,965.11	-	-	-494,670,584.61	498,608,549.72
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	215,826.53	215,826.53
应付托管费	-	-	-	43,165.33	43,165.33
应付清算款	-	-	-	365,025.63	365,025.63
应交税费	-	-	-	7,259.56	7,259.56
其他负债	-	-	-	649,165.53	649,165.53
负债总计	-	-	-	1,280,442.58	1,280,442.58
利率敏感度缺口	3,937,965.11	-	-	-493,390,142.03	497,328,107.14

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：于本报告期末，本基金未持有交易性债券资产投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场

价格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证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

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	661,755,969.99	98.92	494,039,632.39	99.34
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	661,755,969.99	98.92	494,039,632.39	99.34

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”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）
	沪深 300 指数上升 5%	33,214,520.31	24,662,253.81
	沪深 300 指数下降 5%	-33,214,520.31	-24,662,253.81

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

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	654,562,288.49	488,835,410.44
第二层次	3,878,594.92	3,445,261.56
第三层次	3,315,086.58	1,758,960.39
合计	661,755,969.99	494,039,632.39

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的当期期初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；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

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 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	661,755,969.99	98.52
	其中：股票	661,755,969.99	98.52
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	7,443,199.95	1.11
8	其他各项资产	2,504,049.92	0.37
9	合计	671,703,219.86	100.00

注：投资组合报表中股票投资市值与按行业分类股票投资组合报表中股票总市值之间的差异是由于可退替代款估值增值引起的。

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	3,750,193.99	0.56
B	采矿业	27,557,090.40	4.12
C	制造业	422,986,823.69	63.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,394,403.06	2.45
E	建筑业	7,560,461.36	1.13
F	批发和零售业	972,534.40	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	15,100,204.05	2.26
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务	34,233,856.93	5.12

	业		
J	金融业	115,559,941.68	17.27
K	房地产业	2,089,506.80	0.31
L	租赁和商务服务业	3,022,459.72	0.45
M	科学研究和技术服务业	7,120,477.88	1.06
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	905,799.86	0.14
R	文化、体育和娱乐业	385,932.00	0.06
S	综合	—	—
	合计	657,639,685.82	98.30

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	3,817,993.75	0.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	300,994.92	0.04
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	4,118,988.67	0.62

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	300308	中际旭创	26,080	33,121,600.00	4.95
2	300750	宁德时代	61,960	24,350,899.60	3.64
3	300502	新易盛	33,056	20,064,992.00	3.00
4	600519	贵州茅台	14,476	17,161,153.24	2.57
5	603986	兆易创新	15,333	12,496,395.00	1.87
6	601318	中国平安	248,562	11,866,349.88	1.77
7	688256	寒武纪	6,860	10,945,473.00	1.64
8	600036	招商银行	288,503	10,241,856.50	1.53
9	601899	紫金矿业	384,850	9,675,129.00	1.45
10	002371	北方华创	10,340	9,146,350.40	1.37
11	000333	美的集团	113,698	8,587,609.94	1.28
12	688012	中微公司	18,171	8,513,113.50	1.27
13	002475	立讯精密	118,765	8,361,056.00	1.25
14	688008	澜起科技	26,754	8,291,064.60	1.24
15	688041	海光信息	22,089	8,179,556.70	1.22
16	002384	东山精密	29,700	7,791,795.00	1.16
17	600900	长江电力	285,498	7,557,132.06	1.13
18	688981	中芯国际	47,139	7,486,615.98	1.12
19	000725	京东方 A	845,700	7,340,676.00	1.10
20	603259	药明康德	57,188	7,120,477.88	1.06
21	601138	工业富联	92,500	6,673,875.00	1.00
22	600030	中信证券	228,341	6,560,236.93	0.98
23	601166	兴业银行	394,679	6,535,884.24	0.98
24	300059	东方财富	294,862	6,009,287.56	0.90
25	600183	生益科技	34,425	5,969,295.00	0.89
26	300274	阳光电源	34,180	5,435,303.60	0.81
27	600276	恒瑞医药	104,153	5,420,122.12	0.81

28	601398	工商银行	754,900	5,337,143.00	0.80
29	300408	三环集团	30,835	5,146,361.50	0.77
30	002594	比亚迪	63,500	5,060,950.00	0.76
31	300476	胜宏科技	14,200	4,919,306.00	0.74
32	601211	国泰海通	262,200	4,772,040.00	0.71
33	002463	沪电股份	31,000	4,736,800.00	0.71
34	300394	天孚通信	15,140	4,582,575.20	0.68
35	301308	江波龙	6,500	4,574,700.00	0.68
36	000988	华工科技	23,600	4,356,796.00	0.65
37	601288	农业银行	671,100	4,073,577.00	0.61
38	600176	中国巨石	55,411	4,038,353.68	0.60
39	601328	交通银行	620,131	3,987,442.33	0.60
40	000651	格力电器	104,016	3,900,600.00	0.58
41	600522	中天科技	63,500	3,853,180.00	0.58
42	603019	中科曙光	34,340	3,682,278.20	0.55
43	600919	江苏银行	340,230	3,667,679.40	0.55
44	688072	拓荆科技	4,300	3,577,600.00	0.53
45	603993	洛阳钼业	203,000	3,562,650.00	0.53
46	600150	中国船舶	104,800	3,541,192.00	0.53
47	600887	伊利股份	146,797	3,517,256.12	0.53
48	600584	长电科技	33,600	3,479,280.00	0.52
49	000338	潍柴动力	125,400	3,417,150.00	0.51
50	688521	芯原股份	9,000	3,340,260.00	0.50
51	000858	五粮液	44,510	3,293,740.00	0.49
52	002916	深南电路	6,835	3,129,746.50	0.47
53	601816	京沪高铁	685,700	3,106,221.00	0.46
54	600309	万华化学	43,301	2,962,221.41	0.44
55	002415	海康威视	85,916	2,938,327.20	0.44
56	300124	汇川技术	43,750	2,901,937.50	0.43
57	600111	北方稀土	59,050	2,837,352.50	0.42
58	601688	华泰证券	136,501	2,814,650.62	0.42
59	000100	TCL 科技	476,580	2,773,695.60	0.41
60	000063	中兴通讯	75,100	2,717,869.00	0.41
61	600000	浦发银行	311,175	2,679,216.75	0.40
62	600089	特变电工	117,520	2,644,200.00	0.40
63	601857	中国石油	301,700	2,618,756.00	0.39
64	300433	蓝思科技	46,838	2,513,327.08	0.38
65	002028	思源电气	14,500	2,508,500.00	0.37
66	601088	中国神华	64,200	2,506,368.00	0.37
67	600031	三一重工	137,800	2,381,184.00	0.36
68	300014	亿纬锂能	35,722	2,323,001.66	0.35
69	002142	宁波银行	77,174	2,291,296.06	0.34
70	002050	三花智控	51,917	2,275,522.11	0.34

71	601601	中国太保	79,727	2,273,814.04	0.34
72	000001	平安银行	223,926	2,250,456.30	0.34
73	000792	盐湖股份	73,800	2,228,022.00	0.33
74	002714	牧原股份	63,477	2,221,060.23	0.33
75	600549	厦门钨业	25,900	2,206,680.00	0.33
76	002353	杰瑞股份	14,300	2,180,750.00	0.33
77	600406	国电南瑞	92,624	2,116,458.40	0.32
78	601668	中国建筑	481,900	2,091,446.00	0.31
79	000657	中钨高新	21,500	2,057,980.00	0.31
80	601229	上海银行	230,570	2,001,347.60	0.30
81	002602	世纪华通	137,300	1,935,930.00	0.29
82	601919	中远海控	144,670	1,918,324.20	0.29
83	601988	中国银行	334,600	1,913,912.00	0.29
84	603501	豪威集团	20,144	1,910,658.40	0.29
85	300760	迈瑞医疗	14,000	1,901,620.00	0.28
86	601939	建设银行	196,621	1,893,460.23	0.28
87	600660	福耀玻璃	37,284	1,880,604.96	0.28
88	601728	中国电信	362,300	1,880,337.00	0.28
89	600016	民生银行	575,800	1,854,076.00	0.28
90	601012	隆基绿能	140,774	1,846,954.88	0.28
91	600941	中国移动	21,400	1,843,182.00	0.28
92	601225	陕西煤业	90,400	1,839,640.00	0.27
93	600999	招商证券	86,094	1,816,583.40	0.27
94	002230	科大讯飞	44,403	1,813,418.52	0.27
95	300033	同花顺	7,484	1,803,644.00	0.27
96	600690	海尔智家	87,100	1,777,711.00	0.27
97	002352	顺丰控股	55,313	1,729,084.38	0.26
98	002709	天赐材料	33,600	1,728,048.00	0.26
99	002460	赣锋锂业	26,300	1,720,020.00	0.26
100	603799	华友钴业	35,551	1,715,691.26	0.26
101	601985	中国核电	189,800	1,713,894.00	0.26
102	600926	杭州银行	117,500	1,697,875.00	0.25
103	000977	浪潮信息	24,108	1,687,560.00	0.25
104	601169	北京银行	343,554	1,683,414.60	0.25
105	002938	鹏鼎控股	15,800	1,665,004.00	0.25
106	600160	巨化股份	30,700	1,627,407.00	0.24
107	000776	广发证券	68,100	1,593,540.00	0.24
108	300442	润泽科技	18,700	1,553,409.00	0.23
109	000425	徐工机械	190,900	1,544,381.00	0.23
110	688126	沪硅产业	38,507	1,536,044.23	0.23
111	300498	温氏股份	124,118	1,529,133.76	0.23
112	600028	中国石化	340,100	1,516,846.00	0.23
113	000938	紫光股份	52,373	1,511,484.78	0.23

114	601600	中国铝业	183,200	1,505,904.00	0.23
115	600938	中国海油	55,200	1,498,680.00	0.22
116	002466	天齐锂业	24,245	1,486,703.40	0.22
117	600460	士兰微	27,100	1,481,286.00	0.22
118	300661	圣邦股份	10,323	1,481,144.04	0.22
119	002600	领益智造	85,000	1,473,900.00	0.22
120	002202	金风科技	60,700	1,450,730.00	0.22
121	601766	中国中车	278,730	1,449,396.00	0.22
122	600050	中国联通	360,700	1,442,800.00	0.22
123	601009	南京银行	142,513	1,409,453.57	0.21
124	002049	紫光国微	15,740	1,396,925.00	0.21
125	002837	英维克	17,500	1,392,300.00	0.21
126	601628	中国人寿	38,900	1,375,115.00	0.21
127	002179	中航光电	29,280	1,352,736.00	0.20
128	688082	盛美上海	3,100	1,339,200.00	0.20
129	601100	恒立液压	12,356	1,329,011.36	0.20
130	601872	招商轮船	75,100	1,319,507.00	0.20
131	000568	泸州老窖	16,800	1,302,336.00	0.19
132	002241	歌尔股份	57,418	1,293,627.54	0.19
133	688396	华润微	13,234	1,290,976.70	0.19
134	603288	海天味业	38,676	1,282,496.16	0.19
135	601658	邮储银行	257,800	1,270,954.00	0.19
136	601006	大秦铁路	275,357	1,269,395.77	0.19
137	605117	德业股份	11,847	1,257,914.46	0.19
138	600809	山西汾酒	11,420	1,249,005.40	0.19
139	000408	藏格矿业	17,800	1,233,896.00	0.18
140	601818	光大银行	426,600	1,232,874.00	0.18
141	600489	中金黄金	68,100	1,229,205.00	0.18
142	600905	三峡能源	330,300	1,225,413.00	0.18
143	601888	中国中免	22,732	1,220,935.72	0.18
144	002625	光启技术	40,000	1,212,800.00	0.18
145	000630	铜陵有色	186,700	1,187,412.00	0.18
146	601336	新华保险	19,900	1,187,234.00	0.18
147	600893	航发动力	30,563	1,171,785.42	0.18
148	601689	拓普集团	20,475	1,155,199.50	0.17
149	600958	东方证券	120,952	1,141,786.88	0.17
150	002027	分众传媒	234,300	1,134,012.00	0.17
151	601127	赛力斯	18,500	1,133,125.00	0.17
152	600118	中国卫星	13,700	1,124,085.00	0.17
153	600010	包钢股份	489,700	1,092,031.00	0.16
154	600019	宝钢股份	200,838	1,090,550.34	0.16
155	688271	联影医疗	10,700	1,083,161.00	0.16
156	600760	中航沈飞	26,195	1,076,614.50	0.16

157	000807	云铝股份	48,400	1,071,576.00	0.16
158	688111	金山办公	5,016	1,068,658.80	0.16
159	601838	成都银行	59,300	1,049,610.00	0.16
160	600362	江西铜业	24,200	1,047,860.00	0.16
161	600989	宝丰能源	51,500	1,046,995.00	0.16
162	300450	先导智能	25,600	1,042,432.00	0.16
163	600104	上汽集团	105,606	1,030,714.56	0.15
164	600875	东方电气	35,600	1,024,212.00	0.15
165	002001	新 和 成	35,839	1,018,544.38	0.15
166	002422	科伦药业	26,400	1,016,928.00	0.15
167	601825	沪农商行	135,700	1,016,393.00	0.15
168	601727	上海电气	144,300	1,010,100.00	0.15
169	601390	中国中铁	239,800	999,966.00	0.15
170	000538	云南白药	21,020	995,717.40	0.15
171	601377	兴业证券	162,840	983,553.60	0.15
172	603296	华勤技术	13,220	981,849.40	0.15
173	600795	国电电力	209,000	976,030.00	0.15
174	601995	中金公司	26,900	972,435.00	0.15
175	600547	山东黄金	41,940	968,394.60	0.14
176	688183	生益电子	7,300	966,520.00	0.14
177	601669	中国电建	203,400	955,980.00	0.14
178	600585	海螺水泥	55,289	937,148.55	0.14
179	600015	华夏银行	146,200	934,218.00	0.14
180	002648	卫星化学	39,717	932,952.33	0.14
181	601916	浙商银行	353,800	930,494.00	0.14
182	300316	晶盛机电	15,400	930,160.00	0.14
183	000166	申万宏源	210,061	924,268.40	0.14
184	300015	爱尔眼科	109,661	905,799.86	0.14
185	601868	中国能建	330,200	881,634.00	0.13
186	600346	恒力石化	49,280	872,748.80	0.13
187	600482	中国动力	26,600	872,480.00	0.13
188	601066	中信建投	30,000	872,100.00	0.13
189	601698	中国卫通	28,800	871,200.00	0.13
190	300418	昆仑万维	21,500	867,740.00	0.13
191	603893	瑞芯微	4,600	866,456.00	0.13
192	601998	中信银行	124,100	860,013.00	0.13
193	002558	巨人网络	30,600	843,336.00	0.13
194	000625	长安汽车	117,396	841,729.32	0.13
195	688036	传音控股	14,276	841,570.20	0.13
196	002311	海大集团	18,700	834,207.00	0.12
197	300803	指南针	9,100	834,197.00	0.12
198	600066	宇通客车	31,100	833,791.00	0.12
199	600426	华鲁恒升	34,600	827,632.00	0.12

200	000157	中联重科	117,100	816,187.00	0.12
201	002532	天山铝业	75,400	809,042.00	0.12
202	600436	片仔癀	7,400	808,672.00	0.12
203	605499	东鹏饮料	6,453	796,493.79	0.12
204	600011	华能国际	103,300	784,047.00	0.12
205	600438	通威股份	63,600	770,196.00	0.12
206	600570	恒生电子	36,264	768,434.16	0.11
207	600115	中国东航	200,300	763,143.00	0.11
208	002236	大华股份	46,000	758,540.00	0.11
209	601077	渝农商行	123,000	751,530.00	0.11
210	600886	国投电力	56,100	746,691.00	0.11
211	002493	荣盛石化	68,675	738,256.25	0.11
212	600188	兖矿能源	40,940	727,503.80	0.11
213	003816	中国广核	184,000	719,440.00	0.11
214	000301	东方盛虹	62,700	717,915.00	0.11
215	002736	国信证券	71,200	711,288.00	0.11
216	600048	保利发展	153,350	710,010.50	0.11
217	601360	三六零	80,522	699,736.18	0.10
218	002074	国轩高科	25,400	698,754.00	0.10
219	601901	方正证券	96,500	694,800.00	0.10
220	600026	中远海能	38,600	692,484.00	0.10
221	688047	龙芯中科	4,400	680,548.00	0.10
222	600196	复星医药	30,000	674,100.00	0.10
223	000975	山金国际	39,600	673,200.00	0.10
224	000768	中航西飞	32,769	671,109.12	0.10
225	600415	小商品城	65,700	667,512.00	0.10
226	601788	光大证券	45,700	659,451.00	0.10
227	600674	川投能源	46,500	658,905.00	0.10
228	600009	上海机场	28,517	658,742.70	0.10
229	601058	赛轮轮胎	56,900	656,057.00	0.10
230	600029	南方航空	126,200	653,716.00	0.10
231	601111	中国国航	107,000	647,350.00	0.10
232	601456	国联民生	73,200	647,088.00	0.10
233	601186	中国铁建	107,300	638,435.00	0.10
234	601117	中国化学	86,600	636,510.00	0.10
235	601877	正泰电器	25,385	636,401.95	0.10
236	600219	南山铝业	159,200	635,208.00	0.09
237	601881	中国银河	50,316	632,472.12	0.09
238	600233	圆通速递	40,000	630,000.00	0.09
239	601878	浙商证券	64,700	614,650.00	0.09
240	301236	软通动力	14,400	611,280.00	0.09
241	600372	中航机载	55,900	606,515.00	0.09
242	002920	德赛西威	7,400	603,100.00	0.09

243	301269	华大九天	4,900	585,158.00	0.09
244	000963	华东医药	20,620	579,834.40	0.09
245	600741	华域汽车	37,167	576,831.84	0.09
246	000895	双汇发展	24,610	551,264.00	0.08
247	001979	招商蛇口	85,122	547,334.46	0.08
248	601021	春秋航空	11,900	542,402.00	0.08
249	688506	百利天恒	1,800	529,254.00	0.08
250	002304	洋河股份	13,781	525,745.15	0.08
251	601319	中国人保	74,667	504,748.92	0.08
252	601898	中煤能源	41,100	500,598.00	0.07
253	300866	安克创新	4,700	491,150.00	0.07
254	600023	浙能电力	92,300	485,498.00	0.07
255	601800	中国交建	84,100	480,211.00	0.07
256	600039	四川路桥	61,180	478,427.60	0.07
257	000002	万科A	158,854	470,207.84	0.07
258	600600	青岛啤酒	8,600	449,178.00	0.07
259	600588	用友网络	48,671	446,799.78	0.07
260	001965	招商公路	48,500	444,260.00	0.07
261	688223	晶科能源	93,405	443,673.75	0.07
262	302132	中航成飞	7,300	425,736.00	0.06
263	601633	长城汽车	28,200	425,538.00	0.06
264	603369	今世缘	17,672	419,003.12	0.06
265	600027	华电国际	93,100	414,295.00	0.06
266	300832	新产业	9,800	411,600.00	0.06
267	300628	亿联网络	12,141	410,608.62	0.06
268	603260	合盛硅业	8,500	410,210.00	0.06
269	601618	中国中冶	163,054	397,851.76	0.06
270	600918	中泰证券	74,200	394,744.00	0.06
271	000617	中油资本	59,800	394,082.00	0.06
272	601607	上海医药	25,500	392,700.00	0.06
273	600061	国投资本	59,645	390,674.75	0.06
274	300251	光线传媒	34,800	385,932.00	0.06
275	600025	华能水电	43,400	385,826.00	0.06
276	688472	阿特斯	34,957	378,234.74	0.06
277	601059	信达证券	23,000	372,370.00	0.06
278	600930	华电新能	77,600	370,152.00	0.06
279	600515	海南机场	132,100	361,954.00	0.05
280	600085	同仁堂	15,500	358,205.00	0.05
281	600803	新奥股份	22,600	357,080.00	0.05
282	600845	宝信软件	21,107	351,009.41	0.05
283	000999	华润三九	15,077	339,081.73	0.05
284	300122	智飞生物	27,971	326,980.99	0.05
285	300999	金龙鱼	13,900	323,314.00	0.05

286	600018	上港集团	66,800	315,296.00	0.05
287	000708	中信特钢	23,930	301,996.60	0.05
288	688009	中国通号	62,400	297,024.00	0.04
289	300896	爱美客	3,340	291,248.00	0.04
290	000596	古井贡酒	3,600	287,280.00	0.04
291	601018	宁波港	85,800	270,270.00	0.04
292	688303	大全能源	15,500	270,165.00	0.04
293	601238	广汽集团	51,540	261,823.20	0.04
294	603392	万泰生物	9,479	255,648.63	0.04
295	300413	芒果超媒	17,036	249,236.68	0.04
296	001280	中国铀业	3,600	240,120.00	0.04
297	301165	锐捷网络	2,800	225,260.00	0.03
298	601136	首创证券	12,800	178,560.00	0.03
299	001391	国货航	34,400	140,008.00	0.02

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	688783	西安奕材	24,363	1,398,923.46	0.21
2	688795	摩尔线程	2,018	1,366,064.92	0.20
3	688785	恒运昌	1,155	556,632.57	0.08
4	001248	华润新能源	29,772	300,994.92	0.04
5	688818	电科蓝天	1,527	107,103.78	0.02
6	688820	盛合晶微	717	101,448.33	0.02
7	001399	惠科股份	3,244	89,956.12	0.01
8	301682	宏明电子	459	73,467.54	0.01
9	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
10	603459	红板科技	325	27,404.00	0.00
11	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
12	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
13	001393	维通利	363	14,153.37	0.00
14	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
15	603293	埃泰克	72	2,442.96	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	300750	宁德时代	10,079,652.00	2.03
2	300308	中际旭创	9,154,533.00	1.84
3	300502	新易盛	5,717,043.00	1.15
4	301308	江波龙	3,803,463.00	0.76

5	000988	华工科技	3,754,486.00	0.75
6	000333	美的集团	3,483,294.00	0.70
7	002475	立讯精密	3,011,821.00	0.61
8	002371	北方华创	2,858,691.00	0.57
9	688072	拓荆科技	2,798,206.47	0.56
10	002594	比亚迪	2,294,853.00	0.46
11	300059	东方财富	2,267,787.00	0.46
12	002353	杰瑞股份	2,191,632.00	0.44
13	002602	世纪华通	2,120,047.00	0.43
14	300274	阳光电源	2,097,008.00	0.42
15	688521	芯原股份	2,096,857.22	0.42
16	002384	东山精密	1,897,607.00	0.38
17	000657	中钨高新	1,860,494.00	0.37
18	002916	深南电路	1,729,544.92	0.35
19	000858	五粮液	1,715,702.00	0.34
20	600549	厦门钨业	1,671,086.00	0.34

注：“买入金额”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。

7.4.2 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	300750	宁德时代	5,563,871.00	1.12
2	300308	中际旭创	4,502,683.10	0.91
3	300502	新易盛	3,019,644.20	0.61
4	000333	美的集团	2,111,865.00	0.42
5	600519	贵州茅台	1,734,243.00	0.35
6	002371	北方华创	1,597,621.00	0.32
7	002475	立讯精密	1,538,429.00	0.31
8	002594	比亚迪	1,315,843.00	0.26
9	300059	东方财富	1,314,283.00	0.26
10	300274	阳光电源	1,300,079.00	0.26
11	601088	中国神华	1,193,028.00	0.24
12	000858	五粮液	1,096,369.00	0.22
13	002916	深南电路	1,061,788.00	0.21
14	300782	卓胜微	1,030,080.76	0.21
15	300394	天孚通信	927,670.00	0.19
16	000725	京东方 A	913,174.00	0.18
17	002230	科大讯飞	893,756.00	0.18
18	688818	电科蓝天	890,352.00	0.18
19	000651	格力电器	856,576.00	0.17
20	300476	胜宏科技	855,167.00	0.17

注：“卖出金额”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。

7.4.3 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	149,380,983.10
卖出股票收入（成交）总额	92,796,214.32

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”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投资。

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

本基金以跟踪误差最小化为目标，选用流动性较好的股指期货合约作为投资标的。报告期内，较好的实现了投资目标。

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

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

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

根据发布的相关公告，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本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

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	386,750.00
2	应收清算款	2,056,807.29
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	60,492.63
8	其他	-
9	合计	2,504,049.92

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：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

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	688783	西安奕材	1,398,923.46	0.21	新股锁定
2	688795	摩尔线程	1,366,064.92	0.20	新股锁定
3	001248	华润新能源	210,702.51	0.03	新股锁定
3	001248	华润新能源	90,292.41	0.01	新股未上市
4	688818	电科蓝天	107,103.78	0.02	新股锁定
5	688785	恒运昌	53,725.40	0.01	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 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 (%)
1,150	103,086.95	111,734,395.00	94.25	6,815,597.00	5.75

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
平安 300ETF 联接基金	101,663,848.00	85.76

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

8.3 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(2017 年 12 月 25 日) 基金份额总额	5,723,055,617.00
本报告期期初基金份额总额	96,049,992.00
本报告期基金总申购份额	41,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	18,900,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	118,549,992.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

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

管理人：公司副总经理林婉文因达到退休年龄，于报告期辞去公司副总经理兼财务负责人职务。林婉文离任后，由公司总经理肖宇鹏兼任公司财务负责人。

托管人：本报告期基金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

管理人：本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务的诉讼或仲裁。

托管人：本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用容诚会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

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，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人无重大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：本报告期内托管人相关从业人员无重大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 (%)	
长江证券	1	131,724,606.91	54.65	24,488.34	54.65	
国泰海通证券	2	109,042,953.20	45.24	20,271.51	45.24	
中信建投证券	2	267,622.16	0.11	49.74	0.11	
诚通证券	2	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国盛证券	1	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
太平洋证券	2	-	-	-	-	
招商证券	1	-	-	-	-	
中泰证券	2	-	-	-	-	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好
 - (2) 经营行为规范
 - (3) 合规风控能力较高
- 2、基金管理人根据上述标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。
- 3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况。

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(%)
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 01 月 21 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下 ETF 基金新增华福证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 16 日
3	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 30 日
4	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 31 日

5	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 04 月 22 日
6	平安基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 04 月 30 日
7	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 05 月 29 日
8	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 05 月 29 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 26 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日	83,756,151.00	32,691,800.00	14,784,103.00	101,663,848.00	85.76
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- （3）平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议

(4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2026 年 08 月 31 日