平安中证500指数增强型发起式证券投资基金
2026年第3季度报告

2026年9月30日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：2026年10月26日

§1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安中证 500 指数增强	
基金主代码	009336	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 27 日	
报告期末基金份额总额	21,104,639.82 份	
投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。	
投资策略	本基金为增强型指数产品，在参考标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。	
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期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，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C

下属分级基金的交易代码	009336	009337
报告期末下属分级基金的份额总额	9,645,183.14份	11,459,456.68份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026年7月1日-2026年9月30日）	
	平安中证500指数增强A	平安中证500指数增强C
1.本期已实现收益	72,635.45	9,919.87
2.本期利润	-2,632,254.65	-3,405,130.67
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2885	-0.2987
4.期末基金资产净值	13,183,742.75	15,171,876.49
5.期末基金份额净值	1.3669	1.3240

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.所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

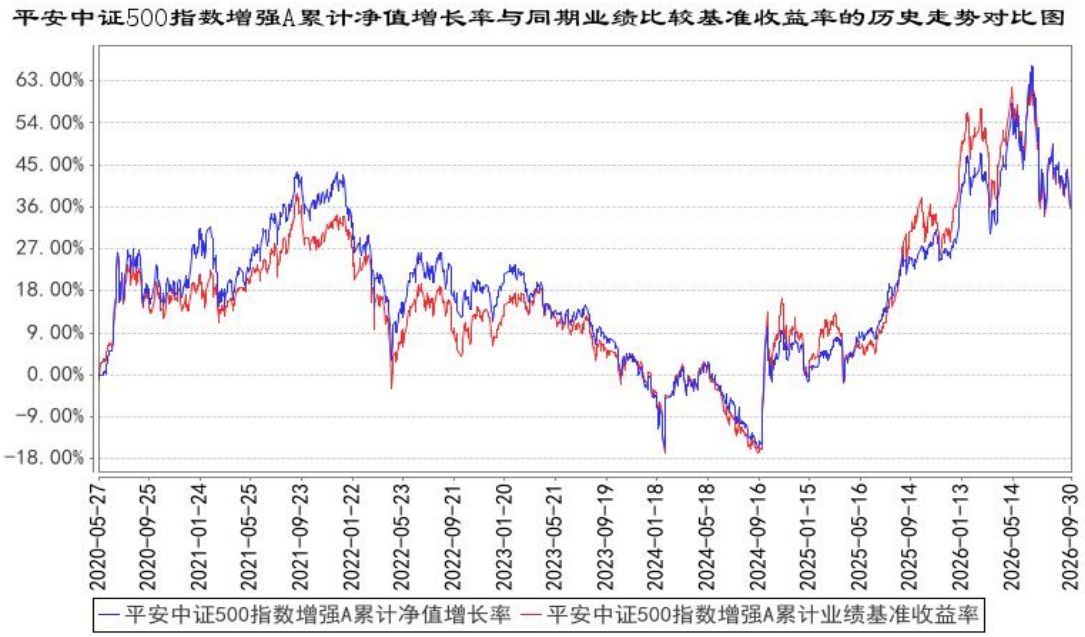
平安中证500指数增强A

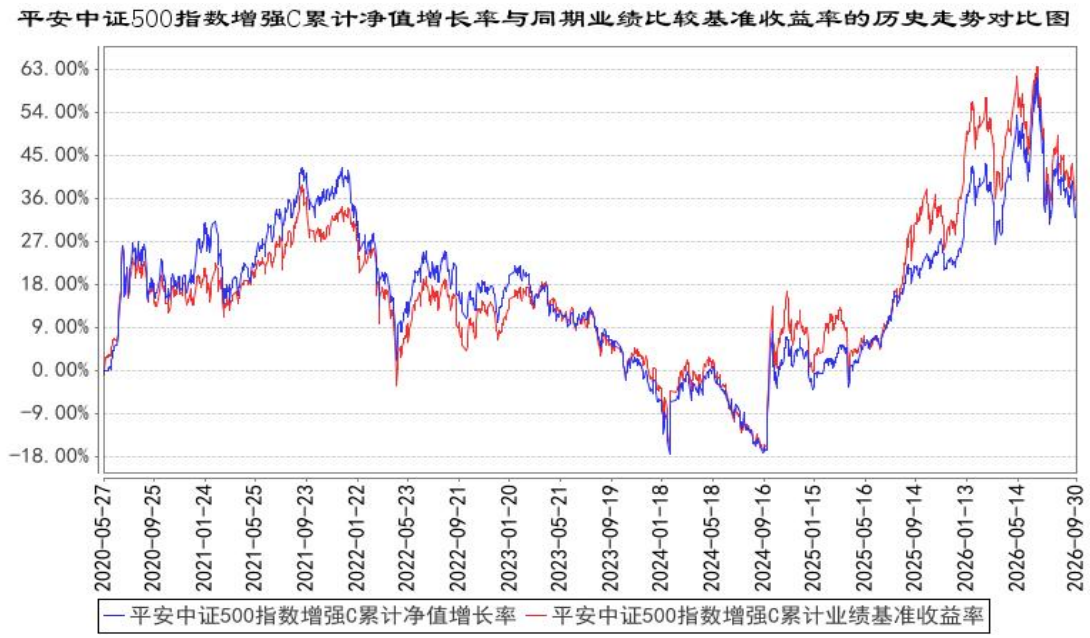
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-17.80%	1.91%	-16.81%	1.89%	-0.99%	0.02%
过去六个月	2.68%	1.81%	-2.17%	1.75%	4.85%	0.06%
过去一年	8.72%	1.51%	0.47%	1.58%	8.25%	-0.07%
过去三年	26.78%	1.34%	29.54%	1.50%	-2.76%	-0.16%
过去五年	0.15%	1.23%	5.13%	1.34%	-4.98%	-0.11%
自基金合同生效起至今	36.69%	1.24%	36.11%	1.30%	0.58%	-0.06%

平安中证500指数增强C

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-17.91%	1.91%	-16.81%	1.89%	-1.10%	0.02%
过去六个月	2.43%	1.81%	-2.17%	1.75%	4.60%	0.06%
过去一年	8.18%	1.51%	0.47%	1.58%	7.71%	-0.07%
过去三年	24.88%	1.34%	29.54%	1.50%	-4.66%	-0.16%
过去五年	-2.32%	1.23%	5.13%	1.34%	-7.45%	-0.11%
自基金合同生效起至今	32.40%	1.24%	36.11%	1.30%	-3.71%	-0.06%

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





注：1、本基金合同于 2020 年 05 月 27 日生效；

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合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
胡涛	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理	2026 年 1 月 21 日	-	17 年	胡涛先生，清华大学计算机科学与技术本科，清华大学计算机科学与技术硕士，曾任博时基金管理有限公司程序员、太平洋资产管理有限责任公司量化投资副总裁 。2025 年 12 月加入平安基金管理有限公司。现担任平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。

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。

4.1.1 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遵规守信情况的说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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2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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026年前三季度，A股市场呈现宽幅震荡、K型分化的运行格局。地缘冲突是贯穿全期的核心主线，美伊冲突在2月底与7月两度升级。

霍尔木兹海峡通行受阻推动国际油价飙升，并通过油价→通胀→美联储政策预期→全球风险偏好的链条反复冲击A股。

三季度末，全球货币政策同步收紧，10年期美债收益率突破5%、创2007年以来新高，高估值成长板块承压。

国内方面，政策在下半年逐步加力，叠加中美元首会晤达成中美八点共识，为市场企稳提供支撑。

中证500指数去年底收于7465.57点，三季度末收于7435.16点，基本持平，但全年振幅超过25%。7月单月下跌约17%，8月修复6.11%，9月再跌6.50%。

中证500兼具科技成长、周期制造与盈利修复属性，全年波动主要由地缘风险与风格切换驱动。

从其他宽基指数表现看，前三季度分化显著。科创50指数领涨，但季度间振幅极大。

市场风格在科技抱团与避险红利之间剧烈摆动，红利风格在7月市场急跌中逆势活跃。

我们在第三季度收缩了产品的整体的风险预算，超额的回撤主要发生在7月。我们会在后续市场企稳后增加产品的风险预算。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安中证500指数增强A的基金份额净值1.3669元，本报告期基金份额净值增长率为-17.80%，同期业绩比较基准收益率为-16.81%；截至本报告期末平安中证500指数增强C的基金份额净值1.3240元，本报告期基金份额净值增长率为-17.91%，同期业绩比较基准收益率为-16.81%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金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人的情形。本基金本报告期内出现连续60个工作日基金资产净值低于5,000万元的情形。截至报告期末，以上情况未消除。根据2014年8月8日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,122,699.85	80.99
	其中：股票	23,122,699.85	80.99
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	5,074,071.51	17.77
8	其他资产	354,899.87	1.24
9	合计	28,551,671.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	25,260.00	0.09
B	采矿业	673,989.00	2.38
C	制造业	16,735,780.18	59.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	606,029.00	2.14
E	建筑业	79,067.00	0.28
F	批发和零售业	551,964.60	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	368,599.00	1.30
H	住宿和餐饮业	10,830.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,772,706.67	6.25
J	金融业	1,449,152.40	5.11
K	房地产业	151,513.00	0.53
L	租赁和商务服务业	126,119.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	131,564.00	0.46
N	水利、环境和公共设施管理业	209,829.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	173,966.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	56,331.00	0.20
S	综合	-	-
	合计	23,122,699.85	81.55

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688498	源杰科技	400	645,200.00	2.28
2	688002	睿创微纳	2,041	353,950.22	1.25
3	601869	长飞光纤	800	328,928.00	1.16
4	002008	大族激光	3,600	288,108.00	1.02

5	300454	深信服	2,000	274,840.00	0.97
6	300857	协创数据	1,060	266,229.60	0.94
7	603256	宏和科技	1,900	248,330.00	0.88
8	300458	全志科技	7,600	244,568.00	0.86
9	301377	鼎泰高科	700	238,700.00	0.84
10	600909	华安证券	30,600	237,762.00	0.84

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IC2610	IC2610	1	1,485,840.00	-48,880.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-48,880.00
股指期货投资本期收益（元）					-133,077.31
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-225,840.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货是根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好的期货合约，

利用股指期货的杠杆作用和基差水平，达到跟踪并力争超越基准的目的。

本基金投资于股指期货，是以多头套保为目的，符合既定的投资政策和投资目标。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期内无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

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，华安证券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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	181,601.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	173,298.75
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	354,899.87

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安中证500指数增强A	平安中证500指数增强C
报告期期初基金份额总额	8,734,410.56	9,901,651.20
报告期期间基金总申购份额	1,560,573.91	8,058,320.04
减：报告期期间基金总赎回份额	649,801.33	6,500,514.56
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	9,645,183.14	11,459,456.68

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

项目	平安中证500指数增强A	平安中证500指数增强C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,002,250.23	-
报告期期间买入/申购总份额	0.00	-
报告期期间卖出/赎回总份额	0.00	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,002,250.23	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	51.86	-

注：1、申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	5,002,250.23	23.70	10,000,000.00	47.38	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	5,002,250.23	23.70	10,000,000.00	47.38	三年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	2026/07/01-2026/09/30	5,002,250.23	0.00	0.00	5,002,250.23	23.70
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。							

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

（1）中国证监会准予平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件

（2）平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同

（3）平安中证 500 指数增强型发起式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

10.2 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

10.3 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 10 月 26 日