

平安中证 A500 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 27 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 26 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	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54

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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9 开放式基金份额变动	57
§ 10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
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	58
10.8 其他重大事件	59
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§ 12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 A500ETF
场内简称	A500ETF 平安
基金主代码	159215
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 26 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	925,582,803.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 7 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。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要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	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李海波	任航
	联系电话	0755-88622632	010-66060069
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95599
传真		0755-23997878	010-68121816
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		罗春风	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	176,304,497.79
本期利润	186,832,190.44
加权平均基金份额本期利润	0.1726
本期加权平均净值利润率	13.00%
本期基金份额净值增长率	13.30%
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	234,370,576.61
期末可供分配基金份额利润	0.2532
期末基金资产净值	1,324,031,341.39
期末基金份额净值	1.4305
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	43.05%

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	15.63%	1.40%	14.26%	1.41%	1.37%	-0.01%
过去六个月	13.30%	1.28%	11.91%	1.29%	1.39%	-0.01%
过去一年	40.01%	1.14%	36.38%	1.14%	3.63%	0.00%
自基金合同生效起至今	43.05%	1.13%	35.71%	1.15%	7.34%	-0.02%

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 2025 年 03 月 26 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	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2025 年 3 月 26 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

作为一只投资于中证 A500 指数的被动型产品，基金在投资管理上，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 0.52%，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 1.4305 元，本报告期基金份额净值增长率为 13.30%，业绩比较基准收益率为 11.91%。

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，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金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进行核查，以上内容真实、准确、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：平安中证 A500 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	3,524,561.72	8,051,822.82
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,321,075,629.23	1,858,184,340.68
其中：股票投资		1,321,010,626.24	1,858,184,340.68
基金投资		-	-
债券投资		65,002.99	-
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		-	-
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		1,324,660,683.58	1,866,236,163.50
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		88,376.84	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		158,570.16	209,334.41
应付托管费		52,856.71	69,778.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	329,538.48	380,427.05
负债合计		629,342.19	659,539.61
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	925,582,803.00	1,477,582,803.00
未分配利润	6.4.7.12	398,448,538.39	387,993,820.89
净资产合计		1,324,031,341.39	1,865,576,623.89
负债和净资产总计		1,324,660,683.58	1,866,236,163.50

注：（1）报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4305 元，基金份额总额 925,582,803.00 份。

（2） 本基金财务报表上年度实际可比期间为 2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：平安中证 A500 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 3 月 26 日（基金合 同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		188,414,597.75	36,754,905.07
1. 利息收入		2,316.51	93,704.50
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,316.51	93,704.50
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）		177,963,733.48	1,052,901.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	167,058,984.67	-20,556,655.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	2.99	-
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	10,904,745.82	21,609,557.25
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	10,527,692.65	34,489,587.77
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	-79,144.89	1,118,711.22
减：二、营业总支出		1,582,407.31	1,126,897.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,066,903.33	765,007.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	355,634.47	255,002.59
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		-	-

8. 其他费用	6.4.7.23	159,869.51	106,887.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		186,832,190.44	35,628,007.20
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		186,832,190.44	35,628,007.20
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		186,832,190.44	35,628,007.20

6.3 净资产变动表

会计主体：平安中证 A500 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	1,477,582,803.00	387,993,820.89	1,865,576,623.89
二、本期期初净资产	1,477,582,803.00	387,993,820.89	1,865,576,623.89
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-552,000,000.00	10,454,717.50	-541,545,282.50
（一）、综合收益总额	-	186,832,190.44	186,832,190.44
（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）	-552,000,000.00	-176,377,472.94	-728,377,472.94
其中：1. 基金申购款	90,000,000.00	31,007,738.90	121,007,738.90
2. 基金赎回款	-642,000,000.00	-207,385,211.84	-849,385,211.84
（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	925,582,803.00	398,448,538.39	1,324,031,341.39
项目	上年度可比期间 2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）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	-	-	-

二、本期期初净资产	2,026,582,803.00	-	2,026,582,803.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-30,000,000.00	43,407,272.81	13,407,272.81
(一)、综合收益总额	-	35,628,007.20	35,628,007.20
(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)	-30,000,000.00	7,779,265.61	-22,220,734.39
其中: 1. 基金申购款	996,000,000.00	-5,855,014.28	990,144,985.72
2. 基金赎回款	-1,026,000,000.00	13,634,279.89	-1,012,365,720.11
(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	1,996,582,803.00	43,407,272.81	2,039,990,075.81

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：

罗春风

肖宇鹏

马杰

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

平安中证 A500 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[2025]311 号文《关于准予平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由平安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《平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》作为管理人向社会公开募集，经向中国证监会备案，《平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 26 日正式生效。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，本基金的募集期间为 2025 年 3 月 17 日至 2025 年 3 月 21 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 2,026,438,000.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 150,046.68 元，其中人民币 144,803.00 元折合 144,803.00 份基金份额，剩余人民币 5,243.68 元 归入基金财产，以上

实收基金（本息）合计为人民币 2,026,582,803.00 元，折合 2,026,582,803.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70039114_H07 号验资报告予以验证。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2025]270 号文审核同意，本基金 2,026,582,803.00 份基金份额于 2025 年 4 月 7 日在深交所挂牌交易。本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、现金等，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。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于中证 A500 指数的成份股及其备选成份股的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%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权合约的投资比例遵循国家相关法律法规。如果法律法规或中国证监会允许基金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。

本基金的业绩比较基准为：标的指数收益率，即中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集

证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《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》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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

本基金的主要税项列示如下：

（1）增值税及附加

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定：资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，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% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收

增值税。

根据财政部、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》的规定，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，继续免征增值税直至债券到期。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按 7%、3% 和 2% 的比例缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部 国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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。根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（4）印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税

实施减半征收。

(5) 境外投资

本基金运作过程中如有涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81号《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[2016]127号《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》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	500,043.76
等于：本金	500,000.00
加：应计利息	43.76
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	3,024,517.96
等于：本金	3,024,449.87
加：应计利息	68.09
合计	3,524,561.72

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商基金专用账户的证券交易结算资金。

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		1,049,320,734.45	-	1,321,010,626.24	271,689,891.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	65,000.00	2.99	65,002.99	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	65,000.00	2.99	65,002.99	0.00
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1, 049, 385, 734. 45	2. 99	1, 321, 075, 629. 23	271, 689, 891. 79

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,177.14
应退退补款	189,918.84
其他	40,442.50
合计	329,538.48

注：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	1,477,582,803.00	1,477,582,803.00
本期申购	90,000,000.00	90,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-642,000,000.00	-642,000,000.00
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	925,582,803.00	925,582,803.00

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	140,343,257.73	247,650,563.16	387,993,820.89
本期期初	140,343,257.73	247,650,563.16	387,993,820.89
本期利润	176,304,497.79	10,527,692.65	186,832,190.44
本期基金份额交易产生的变动数	-82,277,178.91	-94,100,294.03	-176,377,472.94
其中：基金申购款	17,611,574.09	13,396,164.81	31,007,738.90
基金赎回款	-99,888,753.00	-107,496,458.84	-207,385,211.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	234,370,576.61	164,077,961.78	398,448,538.39

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	941.29
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,375.22
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	2,316.51

注：其他存款利息收入为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金产生的利息收入。

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	85,077,487.71
股票投资收益——赎回差价收入	81,981,496.96
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	167,058,984.67

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	622,851,061.21
减：卖出股票成本总额	537,238,717.98
减：交易费用	534,855.52
买卖股票差价收入	85,077,487.71

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	849,385,211.84
减：现金支付赎回款总额	456,748,264.84
减：赎回股票成本总额	310,655,450.04
减：交易费用	—
赎回差价收入	81,981,496.96

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

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	2.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）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	2.99

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

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	10,904,745.82
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	10,904,745.82

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	10,527,692.65
股票投资	10,527,692.65
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	-
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	10,527,692.65

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	-79,144.89
合计	-79,144.89

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	785.00
其他	69,824.36
合计	159,869.51

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
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	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
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
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 A500ETF 联接”）	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	上年度可比期间
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）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	866, 232, 110. 13	100. 00	3, 631, 888, 204. 69	100. 00

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 (%)
平安证券	167, 865. 61	100. 00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年3月26日（基金合同生效日）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	700, 334. 09	100. 00	-	-

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 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月

		30 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,066,903.33	765,007.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	101,731.66	233,225.73
应支付基金管理人的净管理费	965,171.67	531,782.06

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 0.15%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×0.15%/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 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	355,634.47	255,002.59

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/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 (%)
方正证券	381, 409. 00	0. 0412	10, 648, 929. 00	0. 7207
平安人寿	500, 040, 666. 00	54. 0244	798, 468, 332. 00	54. 0388
平 安 中 证 A500ETF联接	168, 047, 900. 00	18. 1559	187, 787, 900. 00	12. 7091

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3月26日（基金合同生效日）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
农业银行-活期	500, 043. 76	941. 29	515, 806. 69	44, 889. 53

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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

为了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农业银行。

(1) 于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 422, 614. 00 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为 23, 828, 834. 58 人民币元，估值总额为 20, 175, 592. 36 人民币元，占基金资产净值的比例为 1. 52%(2025 年 12 月 31 日：数量： 691, 014. 00 股；成本： 38, 945, 759. 53 元；市值 47, 265, 357. 60 元；占基金资产净值的比例为 2. 53%)。

(2) 于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 384, 500. 00 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 4, 410, 958. 55 元，估值总额为人民币 3, 864, 225. 00 元，占基金资产净值的比例 0. 29%(2025 年 12 月 31 日：数量： 628, 500. 00 股；成本： 7, 271, 961. 84 元；市值 7, 171, 185. 00 元；占基金资产净值的比例为 0. 38%)。

(3) 于 2026 年 6 月 30 日，本基金持有 1, 138, 700. 00 股农业银行的 A 股普通股，成本总额为

人民币 6,933,817.27 元，估值总额为人民币 6,911,909.00 元，占基金资产净值的比例为 0.52%(2025 年 12 月 31 日: 数量: 1,861,800.00 股; 成本: 11,178,106.70 元; 市值 14,298,624.00 元; 占基金资产净值的比例为 0.77%)。

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	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	18,855	190,624.05	190,624.05	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	43,998	444,819.78	444,819.78	-
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	6,488	65,658.56	179,912.24	-
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	714	49,737.24	114,282.84	-

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	红板科技	2026年3月31日	6个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
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	-
688781	视涯科技	2026年3月18日	9个月	新股锁定	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688783	西安奕材	2025年10月20日	9个月	新股锁定	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
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	5,906	674,937.68	3,998,007.64	-
688802	沐曦股份	2025年12月9日	9个月	新股锁定	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688818	电科蓝天	2026年2月3日	6个月	新股锁定	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

688820	盛合晶微	2026年4月13日	6个月	新股锁定	19.68	141.49	1,933	38,041.44	273,500.17	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026年6月10日	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	650	65,000.00	65,002.99	-

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	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
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	7,927	1,794,703.17	6,595,264.00	

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约责任，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，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.0049%（上年度末：本基金未持有债券和资产支持证券投资）。

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的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。

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	3,524,561.72	-	-	-	3,524,561.72
交易性金融资产	65,002.99	-	-	1,321,010,626.24	1,321,075,629.23
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	3,589,564.71	-	-	1,321,071,118.87	1,324,660,683.58
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	158,570.16	158,570.16
应付托管费	-	-	-	52,856.71	52,856.71
应付清算款	-	-	-	88,376.84	88,376.84
其他负债	-	-	-	329,538.48	329,538.48
负债总计	-	-	-	629,342.19	629,342.19
利率敏感度缺口	3,589,564.71	-	-	1,320,441,776.68	1,324,031,341.39
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	8,051,822.82	-	-	-	8,051,822.82
交易性金融资产	-	-	-	1,858,184,340.68	1,858,184,340.68
资产总计	8,051,822.82	-	-	1,858,184,340.68	1,866,236,163.50
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	209,334.41	209,334.41
应付托管费	-	-	-	69,778.15	69,778.15
其他负债	-	-	-	380,427.05	380,427.05
负债总计	-	-	-	659,539.61	659,539.61
利率敏感度缺口	8,051,822.82	-	-	-1,857,524,801.	1,865,576,623.89

				07	
--	--	--	--	----	--

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（不包括可转债和可交换债）（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	1,321,010,626.24	99.77	1,858,184,340.68	99.60
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	1,321,010,626.24	99.77	1,858,184,340.68	99.60

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%	73,473,188.44	98,602,613.43
	沪深 300 指数下降 5%	-73,473,188.44	-98,602,613.43

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	1,303,028,549.69	1,842,605,363.66
第二层次	7,295,710.82	10,087,973.76
第三层次	10,751,368.72	5,491,003.26
合计	1,321,075,629.23	1,858,184,340.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	1,321,010,626.24	99.72
	其中：股票	1,321,010,626.24	99.72
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	65,002.99	0.00
	其中：债券	65,002.99	0.00
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	3,524,561.72	0.27
8	其他各项资产	60,492.63	0.00
9	合计	1,324,660,683.58	100.00

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	4,134,749.00	0.31

B	采矿业	54,010,588.90	4.08
C	制造业	928,115,615.47	70.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,043,858.00	2.04
E	建筑业	15,995,724.00	1.21
F	批发和零售业	10,104,685.00	0.76
G	交通运输、仓储和邮政业	27,454,157.00	2.07
H	住宿和餐饮业	618,982.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	73,416,631.25	5.54
J	金融业	127,085,696.80	9.60
K	房地产业	7,330,374.00	0.55
L	租赁和商务服务业	9,480,383.80	0.72
M	科学研究和技术服务业	15,709,533.00	1.19
N	水利、环境和公共设施管理业	2,239,864.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	434,520.00	0.03
Q	卫生和社会工作	2,562,676.30	0.19
R	文化、体育和娱乐业	1,005,764.00	0.08
S	综合	2,377,104.00	0.18
	合计	1,309,120,906.52	98.87

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	11,254,275.89	0.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	635,443.83	0.05
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	11,889,719.72	0.90

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	44,300	56,261,000.00	4.25
2	300750	宁德时代	103,900	40,833,739.00	3.08
3	300502	新易盛	55,252	33,537,964.00	2.53
4	600519	贵州茅台	24,500	29,044,505.00	2.19
5	603986	兆易创新	26,500	21,597,500.00	1.63
6	601318	中国平安	422,614	20,175,592.36	1.52
7	688256	寒武纪	12,431	19,834,282.05	1.50
8	600036	招商银行	490,700	17,419,850.00	1.32
9	601899	紫金矿业	653,300	16,423,962.00	1.24
10	002371	北方华创	17,165	15,183,472.40	1.15
11	000333	美的集团	192,812	14,563,090.36	1.10
12	002475	立讯精密	202,215	14,235,936.00	1.08
13	688008	澜起科技	45,376	14,062,022.40	1.06
14	688012	中微公司	29,571	13,854,013.50	1.05
15	688041	海光信息	36,771	13,616,301.30	1.03
16	002384	东山精密	50,800	13,327,380.00	1.01
17	600900	长江电力	478,400	12,663,248.00	0.96
18	688981	中芯国际	79,138	12,568,697.16	0.95
19	000725	京东方A	1,440,600	12,504,408.00	0.94
20	603259	药明康德	98,100	12,214,431.00	0.92
21	600030	中信证券	387,000	11,118,510.00	0.84

22	601166	兴业银行	661,600	10,956,096.00	0.83
23	300059	东方财富	501,988	10,230,515.44	0.77
24	600183	生益科技	57,800	10,022,520.00	0.76
25	600276	恒瑞医药	176,920	9,206,916.80	0.70
26	300274	阳光电源	57,500	9,143,650.00	0.69
27	601398	工商银行	1,264,400	8,939,308.00	0.68
28	300408	三环集团	53,100	8,862,390.00	0.67
29	002594	比亚迪	107,700	8,583,690.00	0.65
30	600487	亨通光电	78,200	8,550,388.00	0.65
31	300476	胜宏科技	24,200	8,383,606.00	0.63
32	002463	沪电股份	53,400	8,159,520.00	0.62
33	601211	国泰海通	447,900	8,151,780.00	0.62
34	300394	天孚通信	25,912	7,843,044.16	0.59
35	688498	源杰科技	4,000	7,544,000.00	0.57
36	688525	佰维存储	15,100	7,470,423.00	0.56
37	000988	华工科技	39,900	7,365,939.00	0.56
38	301308	江波龙	10,100	7,108,380.00	0.54
39	600176	中国巨石	95,100	6,930,888.00	0.52
40	601288	农业银行	1,138,700	6,911,909.00	0.52
41	601328	交通银行	1,057,900	6,802,297.00	0.51
42	000651	格力电器	177,700	6,663,750.00	0.50
43	688072	拓荆科技	7,927	6,595,264.00	0.50
44	600522	中天科技	108,100	6,559,508.00	0.50
45	603019	中科曙光	57,900	6,208,617.00	0.47
46	688521	芯原股份	16,700	6,198,038.00	0.47
47	603993	洛阳钼业	345,700	6,067,035.00	0.46
48	600150	中国船舶	179,000	6,048,410.00	0.46
49	300604	长川科技	17,600	6,008,992.00	0.45
50	600887	伊利股份	250,600	6,004,376.00	0.45
51	600584	长电科技	56,700	5,871,285.00	0.44
52	000338	潍柴动力	212,900	5,801,525.00	0.44
53	000858	五粮液	76,900	5,690,600.00	0.43
54	688347	华虹宏力	16,200	5,448,060.00	0.41
55	601816	京沪高铁	1,162,500	5,266,125.00	0.40
56	600309	万华化学	74,500	5,096,545.00	0.38
57	688120	华海清科	15,677	5,050,815.86	0.38
58	300124	汇川技术	75,200	4,988,016.00	0.38
59	002415	海康威视	145,400	4,972,680.00	0.38
60	002916	深南电路	10,840	4,963,636.00	0.37
61	002281	光迅科技	19,200	4,933,248.00	0.37
62	002008	大族激光	32,700	4,908,597.00	0.37
63	600111	北方稀土	100,200	4,814,610.00	0.36
64	000100	TCL 科技	824,300	4,797,426.00	0.36

65	000063	中兴通讯	127,800	4,625,082.00	0.35
66	300857	协创数据	13,480	4,581,852.00	0.35
67	300136	信维通信	38,400	4,579,200.00	0.35
68	600000	浦发银行	528,700	4,552,107.00	0.34
69	600089	特变电工	200,400	4,509,000.00	0.34
70	601857	中国石油	513,100	4,453,708.00	0.34
71	002028	思源电气	24,700	4,273,100.00	0.32
72	601088	中国神华	108,700	4,243,648.00	0.32
73	300433	蓝思科技	79,000	4,239,140.00	0.32
74	600031	三一重工	235,200	4,064,256.00	0.31
75	300014	亿纬锂能	60,400	3,927,812.00	0.30
76	300475	香农芯创	13,000	3,900,000.00	0.29
77	002050	三花智控	88,800	3,892,104.00	0.29
78	601601	中国太保	135,800	3,873,016.00	0.29
79	000001	平安银行	384,500	3,864,225.00	0.29
80	300223	北京君正	15,300	3,808,170.00	0.29
81	000792	盐湖股份	126,000	3,803,940.00	0.29
82	002714	牧原股份	108,300	3,789,417.00	0.29
83	600549	厦门钨业	44,100	3,757,320.00	0.28
84	002353	杰瑞股份	24,300	3,705,750.00	0.28
85	002156	通富微电	48,100	3,649,347.00	0.28
86	600406	国电南瑞	159,300	3,640,005.00	0.27
87	601668	中国建筑	819,100	3,554,894.00	0.27
88	000657	中钨高新	36,200	3,465,064.00	0.26
89	002436	兴森科技	67,500	3,439,125.00	0.26
90	601919	中远海控	249,200	3,304,392.00	0.25
91	002602	世纪华通	233,600	3,293,760.00	0.25
92	300760	迈瑞医疗	24,000	3,259,920.00	0.25
93	601988	中国银行	566,700	3,241,524.00	0.24
94	300054	鼎龙股份	30,200	3,200,294.00	0.24
95	600660	福耀玻璃	63,400	3,197,896.00	0.24
96	601728	中国电信	614,700	3,190,293.00	0.24
97	603501	豪威集团	33,600	3,186,960.00	0.24
98	601012	隆基绿能	240,400	3,154,048.00	0.24
99	601225	陕西煤业	153,400	3,121,690.00	0.24
100	002230	科大讯飞	76,300	3,116,092.00	0.24
101	600941	中国移动	35,800	3,083,454.00	0.23
102	600690	海尔智家	148,600	3,032,926.00	0.23
103	002352	顺丰控股	95,200	2,975,952.00	0.22
104	688777	中控技术	25,208	2,961,940.00	0.22
105	601985	中国核电	325,800	2,941,974.00	0.22
106	002460	赣锋锂业	44,800	2,929,920.00	0.22
107	300757	罗博特科	4,700	2,909,300.00	0.22

108	002938	鹏鼎控股	27,600	2,908,488.00	0.22
109	002709	天赐材料	56,500	2,905,795.00	0.22
110	603799	华友钴业	60,070	2,898,978.20	0.22
111	300033	同花顺	12,000	2,892,000.00	0.22
112	000977	浪潮信息	40,800	2,856,000.00	0.22
113	600160	巨化股份	53,400	2,830,734.00	0.21
114	300442	润泽科技	32,500	2,699,775.00	0.20
115	002851	麦格米特	16,100	2,691,598.00	0.20
116	000425	徐工机械	324,600	2,626,014.00	0.20
117	688126	沪硅产业	65,688	2,620,294.32	0.20
118	002202	金风科技	109,500	2,617,050.00	0.20
119	000938	紫光股份	90,500	2,611,830.00	0.20
120	601600	中国铝业	314,300	2,583,546.00	0.20
121	600028	中国石化	576,400	2,570,744.00	0.19
122	600938	中国海油	94,600	2,568,390.00	0.19
123	300346	南大光电	27,340	2,533,051.00	0.19
124	600460	士兰微	46,200	2,525,292.00	0.19
125	002466	天齐锂业	41,000	2,514,120.00	0.19
126	002600	领益智造	144,400	2,503,896.00	0.19
127	601766	中国中车	481,500	2,503,800.00	0.19
128	300567	精测电子	7,800	2,477,280.00	0.19
129	600050	中国联通	619,200	2,476,800.00	0.19
130	300661	圣邦股份	17,190	2,466,421.20	0.19
131	002837	英维克	30,310	2,411,463.60	0.18
132	002080	中材科技	26,600	2,394,000.00	0.18
133	002049	紫光国微	26,900	2,387,375.00	0.18
134	002407	多氟多	47,170	2,369,349.10	0.18
135	002185	华天科技	105,300	2,349,243.00	0.18
136	002138	顺络电子	32,000	2,339,200.00	0.18
137	601628	中国人寿	66,000	2,333,100.00	0.18
138	002179	中航光电	50,400	2,328,480.00	0.18
139	688002	睿创微纳	14,867	2,299,776.23	0.17
140	601100	恒立液压	21,200	2,280,272.00	0.17
141	000568	泸州老窖	29,100	2,255,832.00	0.17
142	601872	招商轮船	128,100	2,250,717.00	0.17
143	600879	航天电子	104,400	2,222,676.00	0.17
144	300395	菲利华	16,600	2,219,918.00	0.17
145	002241	歌尔股份	98,400	2,216,952.00	0.17
146	603288	海天味业	66,100	2,191,876.00	0.17
147	601006	大秦铁路	471,100	2,171,771.00	0.16
148	300390	天华新能	23,000	2,150,730.00	0.16
149	000408	藏格矿业	31,000	2,148,920.00	0.16
150	601658	邮储银行	435,700	2,148,001.00	0.16

151	605117	德业股份	20,104	2,134,642.72	0.16
152	688017	绿的谐波	5,100	2,131,086.00	0.16
153	688469	芯联集成	198,828	2,109,565.08	0.16
154	600905	三峡能源	565,900	2,099,489.00	0.16
155	600489	中金黄金	115,100	2,077,555.00	0.16
156	601888	中国中免	38,600	2,073,206.00	0.16
157	002625	光启技术	68,200	2,067,824.00	0.16
158	688396	华润微	21,076	2,055,963.80	0.16
159	000630	铜陵有色	319,600	2,032,656.00	0.15
160	600893	航发动力	52,700	2,020,518.00	0.15
161	600010	包钢股份	900,700	2,008,561.00	0.15
162	600673	东阳光	59,700	2,004,726.00	0.15
163	688271	联影医疗	19,666	1,990,789.18	0.15
164	601127	赛力斯	32,400	1,984,500.00	0.15
165	300058	蓝色光标	142,180	1,956,396.80	0.15
166	002273	水晶光电	55,000	1,951,400.00	0.15
167	688111	金山办公	9,136	1,946,424.80	0.15
168	601689	拓普集团	34,400	1,940,848.00	0.15
169	002027	分众传媒	400,800	1,939,872.00	0.15
170	300037	新宙邦	20,800	1,931,280.00	0.15
171	600118	中国卫星	23,500	1,928,175.00	0.15
172	300751	迈为股份	6,700	1,892,482.00	0.14
173	600019	宝钢股份	345,700	1,877,151.00	0.14
174	000426	兴业银锡	56,400	1,858,944.00	0.14
175	600760	中航沈飞	44,900	1,845,390.00	0.14
176	000807	云铝股份	82,637	1,829,583.18	0.14
177	601168	西部矿业	66,000	1,791,240.00	0.14
178	600362	江西铜业	41,100	1,779,630.00	0.13
179	600104	上汽集团	182,100	1,777,296.00	0.13
180	600989	宝丰能源	87,100	1,770,743.00	0.13
181	300450	先导智能	43,400	1,767,248.00	0.13
182	601727	上海电气	250,500	1,753,500.00	0.13
183	600875	东方电气	60,400	1,737,708.00	0.13
184	002001	新 和 成	61,100	1,736,462.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	65,900	1,734,488.00	0.13
186	688099	晶晨股份	16,781	1,726,764.90	0.13
187	605589	圣泉集团	26,900	1,710,033.00	0.13
188	002422	科伦药业	44,300	1,706,436.00	0.13
189	600885	宏发股份	49,180	1,696,218.20	0.13
190	601390	中国中铁	405,700	1,691,769.00	0.13
191	600667	太极实业	57,800	1,686,604.00	0.13
192	000538	云南白药	35,500	1,681,635.00	0.13
193	002738	中矿资源	28,500	1,681,215.00	0.13

194	000960	锡业股份	39,200	1,673,448.00	0.13
195	002126	银轮股份	33,400	1,663,320.00	0.13
196	600392	盛和资源	55,600	1,655,212.00	0.13
197	600547	山东黄金	71,600	1,653,244.00	0.12
198	600795	国电电力	353,300	1,649,911.00	0.12
199	000831	中国稀土	29,500	1,636,955.00	0.12
200	600418	江淮汽车	62,700	1,619,541.00	0.12
201	600585	海螺水泥	95,000	1,610,250.00	0.12
202	601669	中国电建	341,700	1,605,990.00	0.12
203	002648	卫星化学	66,700	1,566,783.00	0.12
204	300316	晶盛机电	25,900	1,564,360.00	0.12
205	600141	兴发集团	33,300	1,564,101.00	0.12
206	002812	恩捷股份	23,300	1,559,003.00	0.12
207	600096	云天化	50,700	1,541,280.00	0.12
208	002129	TCL 中环	128,200	1,540,964.00	0.12
209	300015	爱尔眼科	184,655	1,525,250.30	0.12
210	301358	湖南裕能	20,000	1,517,400.00	0.11
211	601179	中国西电	101,600	1,515,872.00	0.11
212	300782	卓胜微	13,576	1,487,658.08	0.11
213	600346	恒力石化	83,700	1,482,327.00	0.11
214	601868	中国能建	554,100	1,479,447.00	0.11
215	002195	岩山科技	225,400	1,474,116.00	0.11
216	600482	中国动力	44,900	1,472,720.00	0.11
217	000066	中国长城	76,600	1,459,230.00	0.11
218	002558	巨人网络	52,700	1,452,412.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	119,900	1,451,989.00	0.11
220	300418	昆仑万维	35,500	1,432,780.00	0.11
221	600580	卧龙电驱	43,200	1,429,920.00	0.11
222	000625	长安汽车	196,900	1,411,773.00	0.11
223	600066	宇通客车	52,500	1,407,525.00	0.11
224	600426	华鲁恒升	58,500	1,399,320.00	0.11
225	000157	中联重科	197,600	1,377,272.00	0.10
226	002532	天山铝业	128,200	1,375,586.00	0.10
227	600895	张江高科	36,700	1,367,075.00	0.10
228	688036	传音控股	22,862	1,347,714.90	0.10
229	600711	盛屯矿业	122,800	1,347,116.00	0.10
230	002340	格林美	201,400	1,331,254.00	0.10
231	605499	东鹏饮料	10,770	1,329,341.10	0.10
232	600011	华能国际	174,500	1,324,455.00	0.10
233	000933	神火股份	62,300	1,320,760.00	0.10
234	300803	指南针	14,400	1,320,048.00	0.10
235	600048	保利发展	284,600	1,317,698.00	0.10
236	600436	片仔癀	12,000	1,311,360.00	0.10

237	600143	金发科技	84,800	1,310,160.00	0.10
238	600438	通威股份	107,500	1,301,825.00	0.10
239	002493	荣盛石化	119,300	1,282,475.00	0.10
240	600115	中国东航	336,600	1,282,446.00	0.10
241	300017	网宿科技	98,500	1,281,485.00	0.10
242	002821	凯莱英	7,900	1,279,800.00	0.10
243	002236	大华股份	77,400	1,276,326.00	0.10
244	600570	恒生电子	60,100	1,273,519.00	0.10
245	002131	利欧股份	267,600	1,271,100.00	0.10
246	600886	国投电力	95,200	1,267,112.00	0.10
247	002456	欧菲光	132,600	1,254,396.00	0.09
248	600352	浙江龙盛	103,500	1,253,385.00	0.09
249	688047	龙芯中科	8,040	1,243,546.80	0.09
250	603659	璞泰来	42,500	1,229,525.00	0.09
251	601233	桐昆股份	56,400	1,221,060.00	0.09
252	003816	中国广核	311,900	1,219,529.00	0.09
253	300339	润和软件	31,400	1,209,214.00	0.09
254	000301	东方盛虹	105,100	1,203,395.00	0.09
255	601360	三六零	138,400	1,202,696.00	0.09
256	601058	赛轮轮胎	104,100	1,200,273.00	0.09
257	688213	思特威	11,100	1,188,477.00	0.09
258	300759	康龙化成	41,000	1,186,130.00	0.09
259	600026	中远海能	65,900	1,182,246.00	0.09
260	002074	国轩高科	42,852	1,178,858.52	0.09
261	688235	百济神州	4,610	1,173,752.10	0.09
262	688578	艾力斯	10,600	1,157,520.00	0.09
263	002555	三七互娱	61,200	1,154,844.00	0.09
264	300438	鹏辉能源	13,800	1,143,330.00	0.09
265	600009	上海机场	49,200	1,136,520.00	0.09
266	688122	西部超导	18,043	1,133,280.83	0.09
267	000768	中航西飞	55,300	1,132,544.00	0.09
268	600196	复星医药	50,200	1,127,994.00	0.09
269	002472	双环传动	27,100	1,124,921.00	0.08
270	601111	中国国航	185,400	1,121,670.00	0.08
271	000975	山金国际	65,800	1,118,600.00	0.08
272	300207	欣旺达	58,600	1,112,814.00	0.08
273	300001	特锐德	29,300	1,108,419.00	0.08
274	002517	恺英网络	68,100	1,106,625.00	0.08
275	600029	南方航空	212,600	1,101,268.00	0.08
276	600415	小商品城	108,300	1,100,328.00	0.08
277	603129	春风动力	4,300	1,099,940.00	0.08
278	300458	全志科技	27,700	1,093,042.00	0.08
279	600219	南山铝业	273,400	1,090,866.00	0.08

280	600674	川投能源	76,900	1,089,673.00	0.08
281	601186	中国铁建	182,400	1,085,280.00	0.08
282	002601	龙佰集团	65,800	1,084,384.00	0.08
283	002128	电投能源	46,800	1,082,016.00	0.08
284	601877	正泰电器	42,700	1,070,489.00	0.08
285	002595	豪迈科技	22,875	1,065,975.00	0.08
286	601117	中国化学	144,900	1,065,015.00	0.08
287	600233	圆通速递	67,600	1,064,700.00	0.08
288	300115	长盈精密	37,500	1,047,750.00	0.08
289	301236	软通动力	24,400	1,035,780.00	0.08
290	600372	中航机载	95,400	1,035,090.00	0.08
291	002155	湖南黄金	43,170	1,030,467.90	0.08
292	600839	四川长虹	147,100	1,026,758.00	0.08
293	002465	海格通信	78,300	999,891.00	0.08
294	300568	星源材质	53,200	995,904.00	0.08
295	300454	深信服	10,300	990,860.00	0.07
296	300347	泰格医药	20,400	979,200.00	0.07
297	000963	华东医药	34,800	978,576.00	0.07
298	688506	百利天恒	3,300	970,299.00	0.07
299	002920	德赛西威	11,904	970,176.00	0.07
300	600741	华域汽车	62,400	968,448.00	0.07
301	000547	航天发展	50,500	967,075.00	0.07
302	603650	彤程新材	9,800	960,204.00	0.07
303	300024	机器人	49,400	954,902.00	0.07
304	002130	沃尔核材	50,200	951,792.00	0.07
305	688676	金盘科技	11,100	939,504.00	0.07
306	002497	雅化集团	45,700	930,909.00	0.07
307	688331	荣昌生物	7,100	924,846.00	0.07
308	300012	华测检测	66,600	923,076.00	0.07
309	000878	云南铜业	58,000	921,040.00	0.07
310	001979	招商蛇口	143,100	920,133.00	0.07
311	300496	中科创达	14,600	902,134.00	0.07
312	300083	创世纪	66,100	900,282.00	0.07
313	300866	安克创新	8,600	898,700.00	0.07
314	002432	九安医疗	12,700	897,636.00	0.07
315	002271	东方雨虹	75,400	894,998.00	0.07
316	002414	高德红外	67,300	892,398.00	0.07
317	000034	神州数码	32,060	889,665.00	0.07
318	601021	春秋航空	19,400	884,252.00	0.07
319	002444	巨星科技	28,300	880,130.00	0.07
320	300474	景嘉微	14,500	876,960.00	0.07
321	603979	金诚信	14,700	867,741.00	0.07
322	000733	振华科技	15,300	866,592.00	0.07

323	688266	泽璟制药	7,400	863,284.00	0.07
324	300763	锦浪科技	9,500	858,325.00	0.06
325	000661	长春高新	12,800	852,480.00	0.06
326	601319	中国人保	125,900	851,084.00	0.06
327	300748	金力永磁	27,300	842,205.00	0.06
328	600699	均胜电子	38,800	838,468.00	0.06
329	002756	永兴材料	14,800	838,272.00	0.06
330	002078	太阳纸业	66,900	835,581.00	0.06
331	601615	明阳智能	71,400	826,098.00	0.06
332	300142	沃森生物	63,500	824,865.00	0.06
333	002025	航天电器	10,800	823,176.00	0.06
334	300073	当升科技	17,100	821,484.00	0.06
335	300432	富临精工	40,800	819,672.00	0.06
336	300919	中伟新材	18,600	813,750.00	0.06
337	601677	明泰铝业	49,000	813,400.00	0.06
338	603606	东方电缆	19,460	807,784.60	0.06
339	600039	四川路桥	102,900	804,678.00	0.06
340	000423	东阿阿胶	17,700	802,872.00	0.06
341	603087	甘李药业	14,100	800,316.00	0.06
342	601800	中国交建	140,000	799,400.00	0.06
343	688608	恒玄科技	4,760	795,824.40	0.06
344	002252	上海莱士	183,200	795,088.00	0.06
345	000002	万科A	268,000	793,280.00	0.06
346	600226	亨通股份	82,300	789,257.00	0.06
347	688169	石头科技	8,282	786,541.54	0.06
348	688599	天合光能	55,236	779,932.32	0.06
349	300724	捷佳伟创	11,000	776,600.00	0.06
350	688223	晶科能源	162,046	769,718.50	0.06
351	601633	长城汽车	49,500	746,955.00	0.06
352	002064	华峰化学	78,600	745,914.00	0.06
353	600588	用友网络	80,800	741,744.00	0.06
354	001965	招商公路	80,500	737,380.00	0.06
355	000786	北新建材	40,500	732,645.00	0.06
356	002831	裕同科技	20,400	725,424.00	0.05
357	688180	君实生物	21,373	722,834.86	0.05
358	688390	固德威	6,659	722,568.09	0.05
359	300677	英科医疗	18,000	705,060.00	0.05
360	002294	信立泰	22,000	701,580.00	0.05
361	600177	雅戈尔	92,100	693,513.00	0.05
362	603806	福斯特	41,300	693,427.00	0.05
363	000519	中兵红箭	32,900	693,203.00	0.05
364	688188	柏楚电子	6,495	693,016.50	0.05
365	601618	中国中冶	282,400	689,056.00	0.05

366	600516	方大炭素	111,100	685,487.00	0.05
367	688065	凯赛生物	14,300	684,255.00	0.05
368	601607	上海医药	44,100	679,140.00	0.05
369	302132	中航成飞	11,600	676,512.00	0.05
370	300972	万辰集团	3,900	676,299.00	0.05
371	000623	吉林敖东	38,000	673,740.00	0.05
372	002176	江特电机	67,300	673,673.00	0.05
373	603260	合盛硅业	13,900	670,814.00	0.05
374	000617	中油资本	100,900	664,931.00	0.05
375	002085	万丰奥威	59,100	655,419.00	0.05
376	300699	光威复材	22,800	653,220.00	0.05
377	300558	贝达药业	10,000	650,700.00	0.05
378	300832	新产业	15,400	646,800.00	0.05
379	002318	久立特材	27,000	645,300.00	0.05
380	300251	光线传媒	58,000	643,220.00	0.05
381	002459	晶澳科技	78,500	635,850.00	0.05
382	002065	东华软件	88,900	634,746.00	0.05
383	300342	天银机电	13,400	629,800.00	0.05
384	002266	浙富控股	124,400	629,464.00	0.05
385	600499	科达制造	45,600	629,280.00	0.05
386	688472	阿特斯	57,843	625,861.26	0.05
387	600085	同仁堂	27,000	623,970.00	0.05
388	002044	美年健康	123,400	620,702.00	0.05
389	603596	伯特利	24,879	617,994.36	0.05
390	300409	道氏技术	31,000	617,830.00	0.05
391	605090	九丰能源	16,600	617,022.00	0.05
392	600515	海南机场	224,400	614,856.00	0.05
393	688617	惠泰医疗	3,384	614,399.04	0.05
394	000400	许继电气	28,200	611,940.00	0.05
395	002223	鱼跃医疗	23,700	608,142.00	0.05
396	300003	乐普医疗	51,100	605,535.00	0.05
397	688005	容百科技	19,780	605,268.00	0.05
398	301550	斯菱智驱	6,600	603,438.00	0.05
399	002405	四维图新	93,200	603,004.00	0.05
400	000032	深桑达A	24,100	601,295.00	0.05
401	600862	中航高科	33,300	600,399.00	0.05
402	600521	华海药业	41,600	599,040.00	0.05
403	601216	君正集团	134,200	598,532.00	0.05
404	000415	渤海租赁	146,700	597,069.00	0.05
405	000039	中集集团	72,900	591,219.00	0.04
406	000683	博源化工	102,400	589,824.00	0.04
407	000999	华润三九	26,190	589,013.10	0.04
408	600803	新奥股份	37,000	584,600.00	0.04

409	600704	物产中大	122,600	578,672.00	0.04
410	603766	隆鑫通用	48,300	576,219.00	0.04
411	600312	平高电气	32,100	566,886.00	0.04
412	600018	上港集团	120,000	566,400.00	0.04
413	603605	珀莱雅	9,400	563,248.00	0.04
414	000887	中鼎股份	31,200	558,168.00	0.04
415	688116	天奈科技	14,600	557,720.00	0.04
416	000967	盈峰环境	52,800	555,984.00	0.04
417	600332	白云山	27,700	555,108.00	0.04
418	300122	智飞生物	47,200	551,768.00	0.04
419	600765	中航重机	42,700	551,684.00	0.04
420	000830	鲁西化工	45,400	544,800.00	0.04
421	600166	福田汽车	186,500	542,715.00	0.04
422	600153	建发股份	68,400	542,412.00	0.04
423	002007	华兰生物	43,900	535,141.00	0.04
424	002410	广联达	65,500	534,480.00	0.04
425	600323	瀚蓝环境	19,200	527,232.00	0.04
426	601799	星宇股份	5,700	516,534.00	0.04
427	300896	爱美客	5,900	514,480.00	0.04
428	688114	华大智造	10,000	510,800.00	0.04
429	603568	伟明环保	32,300	496,774.00	0.04
430	002603	以岭药业	32,900	493,500.00	0.04
431	600398	海澜之家	94,300	493,189.00	0.04
432	601000	唐山港	117,600	488,040.00	0.04
433	002389	航天彩虹	27,400	486,898.00	0.04
434	600486	扬农化工	9,600	486,720.00	0.04
435	688009	中国通号	101,396	482,644.96	0.04
436	601018	宁波港	152,400	480,060.00	0.04
437	600529	山东药玻	26,000	479,700.00	0.04
438	600208	衢州发展	169,400	479,402.00	0.04
439	600170	上海建工	213,900	474,858.00	0.04
440	600008	首创环保	173,800	472,736.00	0.04
441	600316	洪都航空	16,900	472,186.00	0.04
442	000738	航发控制	25,800	471,882.00	0.04
443	600998	九州通	100,600	471,814.00	0.04
444	000932	华菱钢铁	135,600	470,532.00	0.04
445	603486	科沃斯	9,100	461,825.00	0.03
446	600820	隧道股份	87,800	457,438.00	0.03
447	600161	天坛生物	39,100	452,778.00	0.03
448	300118	东方日升	36,100	449,445.00	0.03
449	601238	广汽集团	87,300	443,484.00	0.03
450	603885	吉祥航空	43,000	442,470.00	0.03
451	688303	大全能源	25,297	440,926.71	0.03

452	603816	顾家家居	19,700	440,492.00	0.03
453	002607	中公教育	241,400	434,520.00	0.03
454	603939	益丰药房	23,900	429,722.00	0.03
455	688166	博瑞医药	12,000	420,120.00	0.03
456	601567	三星电气	27,900	416,826.00	0.03
457	600763	通策医疗	12,300	416,724.00	0.03
458	300676	华大基因	11,600	406,696.00	0.03
459	600038	中直股份	16,000	404,640.00	0.03
460	300049	福瑞医科	10,400	404,352.00	0.03
461	300573	兴齐眼药	9,804	399,611.04	0.03
462	603392	万泰生物	14,800	399,156.00	0.03
463	600535	天士力	29,400	388,962.00	0.03
464	600511	国药股份	14,800	385,392.00	0.03
465	600816	建元信托	156,500	381,860.00	0.03
466	002244	滨江集团	49,000	372,400.00	0.03
467	000833	粤桂股份	15,900	372,378.00	0.03
468	300100	双林股份	13,400	372,252.00	0.03
469	002120	韵达股份	57,800	367,608.00	0.03
470	601155	新城控股	35,800	367,308.00	0.03
471	688063	派能科技	6,843	364,526.61	0.03
472	300144	宋城演艺	62,400	362,544.00	0.03
473	000998	隆平高科	45,800	345,332.00	0.03
474	600064	南京高科	48,300	344,379.00	0.03
475	601866	中远海发	153,400	339,014.00	0.03
476	002544	普天科技	18,500	337,070.00	0.03
477	600754	锦江酒店	18,200	327,418.00	0.02
478	600635	大众公用	75,900	324,852.00	0.02
479	300457	赢合科技	15,200	320,416.00	0.02
480	600655	豫园股份	77,700	319,347.00	0.02
481	000035	中国天楹	65,400	315,882.00	0.02
482	603899	晨光股份	14,500	299,135.00	0.02
483	300601	康泰生物	26,300	298,242.00	0.02
484	600258	首旅酒店	26,700	291,564.00	0.02
485	600663	陆家嘴	46,400	291,392.00	0.02
486	600004	白云机场	40,100	291,126.00	0.02
487	600859	王府井	30,700	281,826.00	0.02
488	002091	江苏国泰	38,400	277,632.00	0.02
489	300070	碧水源	84,800	270,512.00	0.02
490	600864	哈投股份	49,700	257,943.00	0.02
491	000069	华侨城A	156,200	256,168.00	0.02
492	301078	孩子王	35,000	236,600.00	0.02
493	002292	奥飞娱乐	35,000	229,600.00	0.02
494	603833	欧派家居	7,300	219,803.00	0.02

495	600325	华发股份	89,300	206,283.00	0.02
496	002891	中宠股份	7,500	200,400.00	0.02
497	002572	索菲亚	22,400	163,520.00	0.01

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	688795	摩尔线程	5,906	3,998,007.64	0.30
2	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.23
3	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.19
4	001248	华润新能源	62,853	635,443.83	0.05
5	688785	恒运昌	1,155	556,632.57	0.04
6	688820	盛合晶微	1,933	273,500.17	0.02
7	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
8	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
9	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
10	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
11	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
12	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
13	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
14	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
15	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
16	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
17	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	600519	贵州茅台	8,918,915.00	0.48
2	688498	源杰科技	5,846,066.37	0.31
3	688041	海光信息	5,539,518.08	0.30
4	301308	江波龙	5,417,474.00	0.29
5	688525	佰维存储	5,223,791.23	0.28
6	002371	北方华创	4,153,267.00	0.22
7	688347	华虹宏力	3,688,905.46	0.20
8	002602	世纪华通	3,623,146.00	0.19
9	601318	中国平安	3,568,182.00	0.19
10	601899	紫金矿业	3,311,597.00	0.18
11	300857	协创数据	3,199,742.60	0.17
12	000657	中钨高新	3,075,416.00	0.16
13	688008	澜起科技	2,998,521.72	0.16
14	688012	中微公司	2,734,122.07	0.15
15	600036	招商银行	2,723,059.00	0.15

16	600183	生益科技	2,708,924.00	0.15
17	300750	宁德时代	2,612,979.00	0.14
18	300475	香农芯创	2,594,143.00	0.14
19	300394	天孚通信	2,431,430.20	0.13
20	603986	兆易创新	2,275,924.00	0.12

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	600519	贵州茅台	32,204,523.95	1.73
2	601318	中国平安	20,764,617.25	1.11
3	601899	紫金矿业	18,873,699.00	1.01
4	600036	招商银行	14,828,101.84	0.79
5	688041	海光信息	11,740,899.42	0.63
6	600900	长江电力	10,041,263.94	0.54
7	601166	兴业银行	9,799,178.69	0.53
8	600030	中信证券	8,355,781.00	0.45
9	688981	中芯国际	8,182,184.61	0.44
10	600276	恒瑞医药	8,011,728.92	0.43
11	688008	澜起科技	7,606,479.87	0.41
12	603259	药明康德	7,572,072.00	0.41
13	603986	兆易创新	7,471,254.86	0.40
14	601398	工商银行	7,347,299.00	0.39
15	300308	中际旭创	7,130,965.00	0.38
16	601211	国泰海通	6,688,121.00	0.36
17	688256	寒武纪	6,555,801.45	0.35
18	603993	洛阳钼业	6,106,328.00	0.33
19	601288	农业银行	5,990,506.00	0.32
20	601088	中国神华	5,986,463.00	0.32

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	245,480,196.93
卖出股票收入（成交）总额	622,851,061.21

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

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	-	-

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）	65,002.99	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	65,002.99	0.00

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	113704	春风转债	650	65,002.99	0.00

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

本基金本报告期无股指期货投资。

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	-
2	应收清算款	-
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	60,492.63

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	688795	摩尔线程	3,998,007.64	0.30	新股锁定
2	688802	沐曦股份	3,070,946.66	0.23	新股锁定
3	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.19	新股锁定
4	001248	华润新能源	444,819.78	0.03	新股锁定
4	001248	华润新能源	190,624.05	0.01	新股未上市
5	688785	恒运昌	53,725.40	0.00	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 (%)
3, 497	264, 679. 10	847, 323, 519. 00	91. 54	78, 259, 284. 00	8. 46

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（%）
平安中证 A500ETF 联接	168, 047, 900. 00	18. 16

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	2, 500. 00	0. 0003

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（2025 年 3 月 26 日） 基金份额总额	2, 026, 582, 803. 00
本报告期期初基金份额总额	1, 477, 582, 803. 00
本报告期基金总申购份额	90, 000, 000. 00
减：本报告期基金总赎回份额	642, 000, 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	925, 582, 803. 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：无。

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：无。

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

本基金聘用安永华明会计师事务所（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：无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：无。

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 (%)	
平安证券	6	866,232,110.13	100.00	167,865.61	100.00	

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，选择具备证券经纪业务资格的证券公司，并签订证券经纪服务协议。

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 (%)
平安证券	-	-	-	-	-	-

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	平安中证 A500 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 06 日
3	平安基金管理有限公司关于旗下 ETF 基金新增金融街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 06 日
4	平安中证 A500 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 03 月 21 日
5	平安基金管理有限公司关于旗下 ETF 基金新增中国国际金融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 27 日
6	平安中证 A500 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 27 日
7	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
8	平安中证 A500 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 21 日
9	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
10	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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
机构	1	2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日	500,040,666.00	0.00	0.00	500,040,666.00	54.02
	2	2026 年 01 月 01 日-2026 年 02 月 12 日	298,427,666.00	0.00	298,427,666.00	0.00	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
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中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安中证 A500 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 27 日