

平安中证 500 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2024 年中期报告

2024 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 08 月 30 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>48</b>
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
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 .....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	64
7.12 投资组合报告附注 .....	64
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>65</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	65
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	66
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>66</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>67</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	67
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 .....	67
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	67
10.4 基金投资策略的改变 .....	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
10.8 其他重大事件 .....	71
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>71</b>
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 .....	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>72</b>
12.1 备查文件目录 .....	72
12.2 存放地点 .....	72
12.3 查阅方式 .....	72

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 平安
基金主代码	510590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 23 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	144,786,121.00 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 5 月 4 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	中证 500 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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	潘琦
	联系电话	0755-22626828	0755-22168257
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	广东省深圳市罗湖区深南东路

	5033 号平安金融中心 34 层	5047 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	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金中期报告备置地点	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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-75,098,658.08
本期利润	-90,094,965.00
加权平均基金份额本期利润	-0.5560
本期加权平均净值利润率	-10.20%
本期基金份额净值增长率	-7.84%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-127,227,591.02
期末可供分配基金份额利润	-0.8787
期末基金资产净值	740,492,921.83
期末基金份额净值	5.1144
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-4.19%

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。

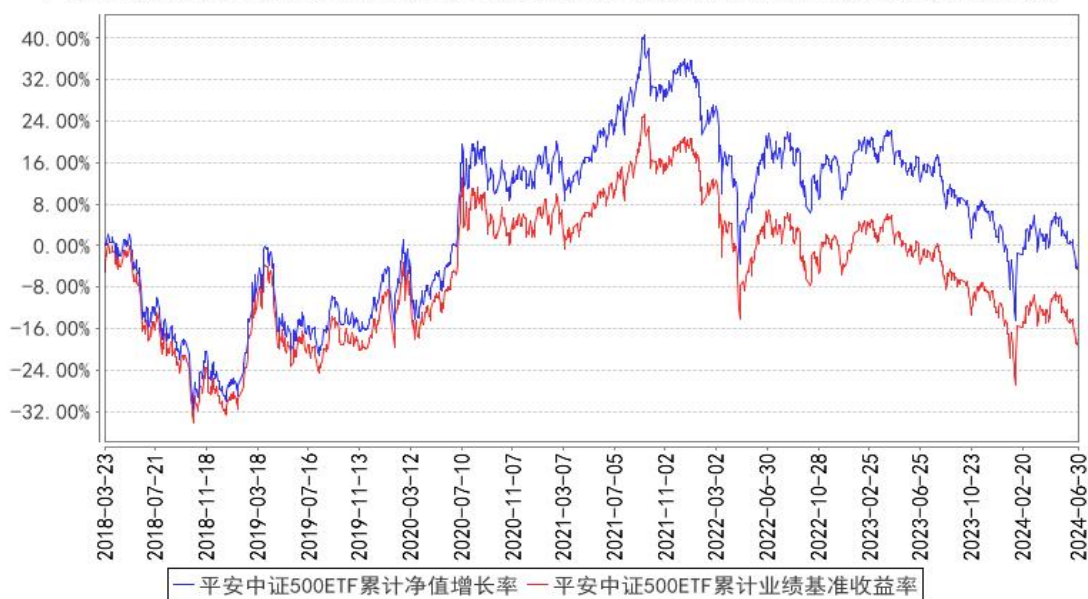
### 3.2 基金净值表现

#### 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
过去一个月	-6.03%	0.95%	-6.89%	0.96%	0.86%	-0.01%
过去三个月	-5.27%	1.12%	-6.50%	1.14%	1.23%	-0.02%
过去六个月	-7.84%	1.59%	-8.96%	1.61%	1.12%	-0.02%
过去一年	-16.43%	1.26%	-17.60%	1.27%	1.17%	-0.01%
过去三年	-22.72%	1.19%	-27.40%	1.20%	4.68%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-4.19%	1.34%	-18.99%	1.35%	14.80%	-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

平安中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2018 年 03 月 23 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，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 亿元人民币。

#### 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		
王仁增	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2021 年 7 月 8 日	-	10 年	王仁增先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任财通基金管理有限公司产品经理、华安基金管理有限公司高级产品经理。2021 年 6 月加入平安基金管理有限公司，任 ETF 指数投资中心高级研究员、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、平安中证消费电子主题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 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、平安中证汽车零部件主题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基金经理。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI



					<p>中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板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 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、平安沪深 300 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联接基金、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、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金基金经理助理。</p>
李严	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 12 月 29 日	-	3 年	<p>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、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</p>

					<p>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基金经理。同时担任平安 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、平安中证医药及医疗器械创新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基金经理助理。</p>
成钧	ETF 指数投资中心投资执行总经理，平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 23 日	2024 年 1 月 3 日	13 年	<p>成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资执行总经理、基金经理。</p>

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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，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及基金合同的规定。

#### 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

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，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未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 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 500 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 0.31%，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 5.1144 元，本报告期基金份额净值增长率为-7.84%，业绩比较基准收益率为-8.96%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，中国经济将继续在“稳中求进”的总基调下运行，经济增速有望保持在合理区间。从外部宏观上看，全球流动性有望宽松，一部分主要经济体央行已进入降息周期，全球经济或将持续复苏，分母端的压力减退有望提振权益资产的投资价值。从国内宏观来看，房地产产业的支持性政策刺激下，商品房销售面积数据出现了较为明显的改善，叠加地产开工增速放缓，地产下行最快的时候已经过去。出口端强劲，外贸持续保持顺差，我国的出口市场更加多元化，展现了更强的跨越周期波动的能力。投资端，在三中全会的定调下，对于财政端发力预期会更加清晰。

对于下半年股票投资上看，可以适当更积极乐观一些。对于市场掣肘的因素正在逐步消退，外部流动性随着降息的落地会有回流的诉求，国内基本面的维稳改善提振了投资预期，资产间性价比中股票市场的价值正在逐步突出，政策端对于股票市场机制的不断完善保障了长期的投资价值。

指数化投资在经历市场的震荡中进一步凸显了该投资范式的普遍性，作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标。

#### 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，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室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

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及本基金合同的规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	7,573,458.44	16,827,613.08
结算备付金		6,121,423.12	4,362,891.75
存出保证金		360,931.73	2,277,142.70
交易性金融资产	6.4.7.2	727,082,925.34	1,226,696,084.28
其中：股票投资		727,082,925.34	1,226,696,084.28
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		14,972.03	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	81,701.02	90,929.07
资产总计		741,235,411.68	1,250,254,660.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
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		1.71	1.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		321,816.14	576,131.00
应付托管费		64,363.23	115,226.23
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,100.75	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	353,208.02	1,046,951.49
负债合计		742,489.85	1,738,310.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	867,720,512.85	1,320,800,341.11
未分配利润	6.4.7.12	-127,227,591.02	-72,283,990.82
净资产合计		740,492,921.83	1,248,516,350.29
负债和净资产总计		741,235,411.68	1,250,254,660.88

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 5.1144 元，基金份额总额 144,786,121.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-87,143,761.70	20,719,174.39
1. 利息收入		107,724.85	752,446.29
其中：存款利息收入	6.4.7.13	107,724.85	74,698.92
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		-	11,686.02
其他利息收入		-	666,061.35
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-73,318,030.38	-4,251,573.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-84,457,741.42	-12,448,939.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	127.50
资产支持证券投资	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	-210,438.15	-93,886.49
股利收益	6.4.7.19	10,243,658.14	8,291,124.93
其他投资收益		1,106,491.05	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-14,996,306.92	23,086,172.97
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	1,062,850.75	1,132,128.69
<b>减：二、营业总支出</b>		2,951,203.30	2,252,732.27
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,196,519.03	1,637,074.00
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	439,303.79	327,414.80
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		332.23	1,385.63
8. 其他费用	6.4.7.23	315,048.25	286,857.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-90,094,965.00	18,466,442.12
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-90,094,965.00	18,466,442.12
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-90,094,965.00	18,466,442.12

### 6.3 净资产变动表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,320,800,341.11	-	-72,283,990.82	1,248,516,350.29
二、本期期初净资产	1,320,800,341.11	-	-72,283,990.82	1,248,516,350.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-453,079,828.26	-	-54,943,600.20	-508,023,428.46
（一）、综合收益总额	-	-	-90,094,965.00	-90,094,965.00
（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）	-453,079,828.26	-	51,077,838.11	-402,001,990.15
其中：1. 基金申购款	79,109,176.33	-	-5,784,352.11	73,324,824.22
2. 基金赎回款	-532,189,004.59	-	56,862,190.22	-475,326,814.37
（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	-	-	-15,926,473.31	-15,926,473.31



填列)				
四、本期期末净资产	867,720,512.85	-	-127,227,591.02	740,492,921.83
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	587,242,524.63	-	4,264,119.82	591,506,644.45
二、本期期初净资产	587,242,524.63	-	4,264,119.82	591,506,644.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	146,232,113.98	-	26,855,753.56	173,087,867.54
(一)、综合收益总额	-	-	18,466,442.12	18,466,442.12
(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)	146,232,113.98	-	8,389,311.44	154,621,425.42
其中：1. 基金申购款	203,766,060.43	-	13,039,610.70	216,805,671.13
2. 基金赎回款	-57,533,946.45	-	-4,650,299.26	-62,184,245.71
(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	733,474,638.61	-	31,119,873.38	764,594,511.99

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

林婉文

张南南

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 500 交易型开放式指数证券投资基金（原名为平安大华中证 500 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[2018]112 号《关于准予平安大华中证 500 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《平安大华中证 500 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 2,648,533,409.00 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（2018）第 0175 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,648,875,604.00 份，其中认购资金利息折合 342,195.00 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，基金托管人为平安银行股份有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2018]41 号审核同意，本基金 441,986,121.00 份基金份额于 2018 年 5 月 4 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》，平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安中证 500 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《平安中证 500 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中证 500 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和备选成份股；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、同业存单、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）。本基金可以在履行适程序后，参与融资和转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：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：中证 500 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、应用指南、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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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

本基金本报告期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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

证券（股票）交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》

的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

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费附加，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费附加。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《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。

#### (4) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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。

### 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	7,573,458.44
等于：本金	7,570,652.85
加：应计利息	2,805.59
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	7,573,458.44

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	836,263,054.42	-	727,082,925.34	-109,180,129.08
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	836,263,054.42	-	727,082,925.34	-109,180,129.08

#### 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：本基金本报告期末无衍生金融资产/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 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	6,290.95
待摊费用	75,410.07
合计	81,701.02

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	184,634.46
其中：交易所市场	184,634.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	168,573.56
合计	353,208.02

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	220,386,121.00	1,320,800,341.11
本期申购	13,200,000.00	79,109,176.33
本期赎回（以“-”号填列）	-88,800,000.00	-532,189,004.59
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	144,786,121.00	867,720,512.85

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	269,660,117.42	-341,944,108.24	-72,283,990.82
本期期初	269,660,117.42	-341,944,108.24	-72,283,990.82
本期利润	-75,098,658.08	-14,996,306.92	-90,094,965.00
本期基金份额交易产生的变动数	-80,401,134.46	131,478,972.57	51,077,838.11
其中：基金申购款	11,899,102.14	-17,683,454.25	-5,784,352.11
基金赎回款	-92,300,236.60	149,162,426.82	56,862,190.22
本期已分配利润	-15,926,473.31	-	-15,926,473.31
本期末	98,233,851.57	-225,461,442.59	-127,227,591.02

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	69,048.60
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	34,281.15
其他	4,395.10
合计	107,724.85

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------



股票投资收益——买卖股票差价收入	-60,521,963.18
股票投资收益——赎回差价收入	-23,935,778.24
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	-84,457,741.42

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	364,643,932.17
减：卖出股票成本总额	424,545,336.43
减：交易费用	620,558.92
买卖股票差价收入	-60,521,963.18

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	475,326,814.37
减：现金支付赎回款总额	248,934,489.37
减：赎回股票成本总额	250,328,103.24
减：交易费用	-
赎回差价收入	-23,935,778.24

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-210,438.15

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,243,658.14
其中：证券出借权益补偿收入	686,183.74
基金投资产生的股利收益	-

合计	10,243,658.14
----	---------------

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-15,095,266.92
股票投资	-15,095,266.92
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	98,960.00
权证投资	-
期货投资	98,960.00
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	-14,996,306.92

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,062,850.75
合计	1,062,850.75

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	38,786.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	131,791.13
其他	84,798.76
合计	315,048.25

#### 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

截至财务报表报出日，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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“平安 500ETF 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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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（%）
方正证券	-	-	4,800,431.71	1.45

#### 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 2024年1月1日至2024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 2023年1月1日至2023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 (%)
方正证券	3,462.51	1.45	3,462.51	1.58

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	2,196,519.03
其中：应支付销售机构的客户维护 费	15,370.34	-
应支付基金管理人的净管理费	2,181,148.69	1,637,074.00

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	439,303.79	327,414.80

注：支付基金托管行平安银行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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	1,319,600.00	1,275.41	-	-

## 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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	254,492.00	1.00	1.00	98.97	-	-
平安证券	52,752.00	2.30	2.30	47.18	-	-
平安证券	61,800.00	3.00	3.00	72.10	-	-
平安证券	12,100.00	2.30	2.30	10.82	-	-
平安证券	50,554.00	2.80	2.80	55.05	-	-
平安证券	6,000.00	2.70	2.70	6.30	-	-

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	482,525.00	0.3333	1,082,868.00	0.4914
平安 500ETF 联接基金	116,350,799.00	80.3605	191,187,899.00	86.7513
平安人寿	22,668,019.00	15.6562	22,668,019.00	10.2856

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

平安银行-活期	7,573,458.44	69,048.60	1,620,219.85	49,780.72
---------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2024年06月21日	2024年6月24日	-	1.1000	15,926,473.31	-	15,926,473.31	-
合计	-	-	-	1.1000	15,926,473.31	-	15,926,473.31	-

#### 6.4.12 期末（2024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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科	2024年	6个月	新股锁	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-



	技	4月3日		定							
301565	中仑新材	2024年 6月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78		-
301587	中瑞股份	2024年 3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56		-
301588	美新科技	2024年 3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25		-
301591	肯特股份	2024年 2月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62		-
603082	北自科技	2024年 1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43		-
603285	键邦股份	2024年 6月28日	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55		-
603312	西典新能	2024年 1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80		-
603325	博隆技术	2024年 1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96		-
603344	星德胜	2024年 3月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12		-
603350	安乃达	2024年 6月26日	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20		-
603350	安乃达	2024年 6月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36		-
603375	盛景微	2024年 1月17日	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80		-
603381	永臻股份	2024年 6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14		-
688530	欧莱新材	2024年 4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40		-
688584	上海合晶	2024年 2月1日	6个月	新股锁定	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74		-
688691	灿芯股份	2024年 4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97		-

688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

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。

#### 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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年8月30日	重大事项停牌	0.11	-	-	327,600	791,939.16	36,036.00	-

注：截止2023年12月31日，本基金合计持有中天3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为\*ST中天，证券代码为000540）327,600股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于2023年6月29日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自2023年6月30日上午9时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。根据公司于2023年8月28日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份。开始转让日为2023年8月30日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向全国股转公司申请，公司股票自2023年8月30日起暂停转让。为维护基金持有人利益，根据中

中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息，平安基金管理有限公司与基金托管人协商一致，将本基金所持有\*ST 中天(000540.SZ)按每股 0.11 元人民币估值。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位:股)	期末估值总额
1	000021	深科技	2024年7月9日-2024年7月10日	15.12	9,100	137,592.00
2	000031	大悦城	2024年7月9日	2.34	16,700	39,078.00
3	000401	冀东水泥	2024年7月5日-2024年7月10日	4.06	9,700	39,382.00
4	000519	中兵红箭	2024年7月9日-2024年7月9日	14.67	15,500	227,385.00
5	000559	万向钱潮	2024年7月9日	4.46	1,000	4,460.00
6	000623	吉林敖东	2024年7月9日	13.40	10,100	135,340.00
7	000629	钒钛股份	2024年7月5日-2024年7月9日	2.50	71,900	179,750.00
8	000630	铜陵有色	2024年7月3日-2024年7月10日	3.61	135,800	490,238.00
9	000703	恒逸石化	2024年7月9日-2024年7月10日	7.09	30,800	218,372.00
10	000723	美锦能源	2024年7月5日-2024年7月9日	4.76	41,600	198,016.00
11	000729	燕京啤酒	2024年7月3日	8.83	26,200	231,346.00
12	000738	航发控制	2024年7月9日	20.07	3,000	60,210.00
13	000739	普洛药业	2024年7月9日	13.57	2,600	35,282.00

14	000750	国海证 券	2024 年 7 月 9 日	2.91	70,500	205,155.0 0
15	000825	太钢不 锈	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	3.38	17,200	58,136.00
16	000878	云南铜 业	2024 年 7 月 9 日	12.46	6,300	78,498.00
17	000893	亚钾国 际	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	16.16	13,200	213,312.0 0
18	000898	鞍钢股 份	2024 年 7 月 9 日	2.12	44,800	94,976.00
19	000958	电投产 融	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	3.66	28,800	105,408.0 0
20	000959	首钢股 份	2024 年 7 月 9 日	2.72	3,500	9,520.00
21	000967	盈峰环 境	2024 年 7 月 5 日-2024 年 7 月 9 日	4.23	22,600	95,598.00
22	000987	越秀资 本	2024 年 7 月 9 日	4.96	19,600	97,216.00
23	002028	思源电 气	2024 年 7 月 9 日	66.90	4,300	287,670.0 0
24	002044	美年健 康	2024 年 7 月 9 日	3.78	4,600	17,388.00
25	002056	横店东 磁	2024 年 7 月 9 日	12.47	3,100	38,657.00
26	002078	太阳纸 业	2024 年 7 月 9 日	13.95	31,100	433,845.0 0
27	002155	湖南黄 金	2024 年 7 月 9 日	18.10	15,700	284,170.0 0
28	002156	通富微 电	2024 年 7 月 5 日-2024 年 7 月 5 日	22.39	14,600	326,894.0 0
29	002195	岩山科 技	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 9 日	2.51	45,600	114,456.0 0
30	002202	金风科 技	2024 年 7 月 9 日	6.72	41,200	276,864.0 0
31	002203	海亮股 份	2024 年 7 月 9 日	7.98	7,500	59,850.00
32	002240	盛新锂 能	2024 年 7 月 5 日	13.42	3,200	42,944.00
33	002266	浙富控 股	2024 年 7 月 9 日-2024 年 7 月 10 日	2.79	36,000	100,440.0 0
34	002268	电科网 安	2024 年 7 月 9 日	14.23	2,800	39,844.00
35	002294	信立泰	2024 年 7 月 9 日	26.63	10,000	266,300.0 0

36	002299	圣农发展	2024年7月5日-2024年7月9日	13.64	13,000	177,320.00
37	002407	多氟多	2024年7月9日	12.23	4,900	59,927.00
38	002408	齐翔腾达	2024年7月5日-2024年7月10日	5.60	26,900	150,640.00
39	002414	高德红外	2024年7月9日	5.89	23,600	139,004.00
40	002465	海格通信	2024年7月9日	10.36	19,400	200,984.00
41	002500	山西证券	2024年7月5日	4.70	9,600	45,120.00
42	002506	协鑫集成	2024年7月9日	1.94	40,300	78,182.00
43	002507	涪陵榨菜	2024年7月9日	12.25	8,800	107,800.00
44	002531	天顺风能	2024年7月3日-2024年7月9日	8.94	8,700	77,778.00
45	002572	索菲亚	2024年7月9日	15.33	2,800	42,924.00
46	002624	完美世界	2024年7月9日-2024年7月9日	7.60	15,600	118,560.00
47	002625	光启技术	2024年7月9日	17.35	19,800	343,530.00
48	002670	国盛金控	2024年7月9日	8.47	3,000	25,410.00
49	003031	中瓷电子	2024年7月9日	46.24	1,240	57,337.60
50	300009	安科生物	2024年7月10日	8.54	2,200	18,788.00
51	300012	华测检测	2024年7月9日	10.06	5,600	56,336.00
52	300017	网宿科技	2024年7月9日	7.90	39,600	312,840.00
53	300058	蓝色光标	2024年7月5日-2024年7月9日	5.44	45,800	249,152.00
54	300070	碧水源	2024年7月10日	4.19	47,100	197,349.00
55	300088	长信科技	2024年7月9日-2024年7月9日	4.70	44,700	210,090.00
56	300118	东方日升	2024年7月9日-2024年7月9日	12.10	13,800	166,980.00
57	300207	欣旺达	2024年7月9日-2024年7月10日	15.17	13,800	209,346.00
58	300285	国瓷材料	2024年7月9日	17.85	13,300	237,405.00

59	300296	利亚德	2024年7月5日-2024年7月9日	4.50	25,900	116,550.00
60	300568	星源材质	2024年7月9日	8.20	13,900	113,980.00
61	300748	金力永磁	2024年7月9日-2024年7月9日	12.96	6,100	79,056.00
62	301236	软通动力	2024年7月11日	35.21	1,000	35,210.00
63	600004	白云机场	2024年7月5日	9.48	1,700	16,116.00
64	600021	上海电力	2024年7月5日-2024年7月9日	9.89	22,600	223,514.00
65	600056	中国医药	2024年7月9日	10.12	7,000	70,840.00
66	600060	海信视像	2024年7月9日-2024年7月9日	24.74	15,000	371,100.00
67	600066	宇通客车	2024年7月9日	25.80	20,000	516,000.00
68	600095	湘财股份	2024年7月9日	5.96	16,600	98,936.00
69	600109	国金证券	2024年7月5日	7.55	8,200	61,910.00
70	600118	中国卫星	2024年7月9日	22.23	6,400	142,272.00
71	600131	国网信通	2024年7月9日	16.87	4,800	80,976.00
72	600141	兴发集团	2024年7月9日	19.08	3,100	59,148.00
73	600153	建发股份	2024年7月9日-2024年7月9日	8.93	22,000	196,460.00
74	600155	华创云信	2024年7月5日-2024年7月9日	5.91	43,300	255,903.00
75	600166	福田汽车	2024年7月3日-2024年7月9日	2.25	57,900	130,275.00
76	600170	上海建工	2024年7月5日-2024年7月9日	2.15	119,600	257,140.00
77	600208	新湖中宝	2024年7月9日-2024年7月10日	1.58	55,200	87,216.00
78	600258	首旅酒店	2024年7月9日	12.35	2,700	33,345.00
79	600271	航天信息	2024年7月9日	7.36	20,900	153,824.00
80	600282	南钢股份	2024年7月5日-2024年7月9日	4.98	41,500	206,670.00

81	600298	安琪酵母	2024年7月10日	27.93	11,600	323,988.00
82	600299	安迪苏	2024年7月9日	9.70	2,900	28,130.00
83	600315	上海家化	2024年7月9日	17.78	3,700	65,786.00
84	600339	中油工程	2024年7月5日-2024年7月10日	3.12	25,400	79,248.00
85	600348	华阳股份	2024年7月9日-2024年7月9日	9.96	34,500	343,620.00
86	600373	中文传媒	2024年7月2日-2024年7月9日	14.84	8,900	132,076.00
87	600377	宁沪高速	2024年7月9日	12.60	3,400	42,840.00
88	600392	盛和资源	2024年7月3日	8.62	19,900	171,538.00
89	600398	海澜之家	2024年7月5日-2024年7月10日	9.24	26,900	248,556.00
90	600399	抚顺特钢	2024年7月5日	5.63	27,700	155,951.00
91	600416	湘电股份	2024年7月9日-2024年7月9日	9.94	13,800	137,172.00
92	600418	江淮汽车	2024年7月5日	15.84	3,300	52,272.00
93	600435	北方导航	2024年7月5日-2024年7月10日	8.62	11,500	99,130.00
94	600481	双良节能	2024年7月9日-2024年7月9日	4.67	21,400	99,938.00
95	600483	福能股份	2024年7月10日	11.66	11,400	132,924.00
96	600499	科达制造	2024年7月9日-2024年7月9日	8.43	14,700	123,921.00
97	600500	中化国际	2024年7月9日-2024年7月11日	3.49	14,700	51,303.00
98	600516	方大炭素	2024年7月9日-2024年7月11日	4.31	48,000	206,880.00
99	600521	华海药业	2024年7月9日	17.05	2,200	37,510.00
100	600528	中铁工业	2024年7月11日	7.32	8,000	58,560.00
101	600536	中国软件	2024年7月9日	29.92	10,100	302,192.00
102	600546	山煤国际	2024年7月9日	14.62	18,400	269,008.00
103	600580	卧龙电	2024年7月9日	12.15	17,500	212,625.00

		驱				0
104	600582	天地科技	2024年7月9日-2024年7月9日	6.89	7,600	52,364.00
105	600583	海油工程	2024年7月9日	5.91	41,700	246,447.00
106	600655	豫园股份	2024年7月9日	5.15	6,000	30,900.00
107	600673	东阳光	2024年7月9日-2024年7月9日	7.04	30,000	211,200.00
108	600707	彩虹股份	2024年7月9日-2024年7月10日	6.81	18,600	126,666.00
109	600737	中粮糖业	2024年7月9日	9.59	10,200	97,818.00
110	600739	辽宁成大	2024年7月5日-2024年7月11日	8.37	20,100	168,237.00
111	600765	中航重机	2024年7月9日-2024年7月9日	20.40	11,400	232,560.00
112	600801	华新水泥	2024年7月9日-2024年7月9日	13.75	3,900	53,625.00
113	600839	四川长虹	2024年7月5日-2024年7月10日	4.49	63,800	286,462.00
114	600848	上海临港	2024年7月9日	9.11	10,400	94,744.00
115	600859	王府井	2024年7月5日-2024年7月10日	11.74	6,300	73,962.00
116	600862	中航高科	2024年7月9日	18.78	16,000	300,480.00
117	600863	内蒙华电	2024年7月9日-2024年7月9日	4.64	24,000	111,360.00
118	600867	通化东宝	2024年7月9日-2024年7月9日	8.37	8,100	67,797.00
119	600879	航天电子	2024年7月9日	7.77	8,700	67,599.00
120	600885	宏发股份	2024年7月9日	27.68	3,400	94,112.00
121	600895	张江高科	2024年7月9日-2024年7月9日	18.48	14,600	269,808.00
122	600901	江苏金租	2024年7月11日	5.05	10,400	52,520.00
123	600959	江苏有线	2024年7月5日-2024年7月10日	2.64	41,000	108,240.00
124	600985	淮北矿业	2024年7月9日	16.74	9,900	165,726.00
125	600988	赤峰黄	2024年7月9日	16.34	18,100	295,754.00



		金				0
126	600998	九州通	2024年7月9日-2024年7月10日	4.88	15,929	77,733.52
127	601058	赛轮轮胎	2024年7月3日	14.00	46,300	648,200.00
128	601098	中南传媒	2024年7月3日	12.42	13,500	167,670.00
129	601106	中国一重	2024年7月3日-2024年7月9日	2.31	44,700	103,257.00
130	601118	海南橡胶	2024年7月9日-2024年7月9日	4.55	32,800	149,240.00
131	601168	西部矿业	2024年7月9日	17.95	2,600	46,670.00
132	601179	中国西电	2024年7月9日-2024年7月11日	8.04	39,100	314,364.00
133	601231	环旭电子	2024年7月9日	16.05	2,600	41,730.00
134	601298	青岛港	2024年7月9日	9.56	13,100	125,236.00
135	601456	国联证券	2024年7月3日-2024年7月5日	9.64	18,500	178,340.00
136	601568	北元集团	2024年7月5日	3.71	22,900	84,959.00
137	601608	中信重工	2024年7月9日-2024年7月9日	3.81	25,600	97,536.00
138	601611	中国核建	2024年7月9日-2024年7月9日	8.09	18,700	151,283.00
139	601666	平煤股份	2024年7月9日	11.20	22,300	249,760.00
140	601828	美凯龙	2024年7月9日	2.55	12,200	31,110.00
141	601866	中远海发	2024年7月3日-2024年7月9日	2.58	57,600	148,608.00
142	601928	凤凰传媒	2024年7月11日	10.96	1,300	14,248.00
143	601991	大唐发电	2024年7月9日-2024年7月9日	3.01	70,000	210,700.00
144	603589	口子窖	2024年7月9日	39.19	3,900	152,841.00
145	603596	伯特利	2024年7月9日	38.90	560	21,784.00
146	603858	步长制药	2024年7月9日	15.15	2,500	37,875.00
147	603885	吉祥航空	2024年7月9日-2024年7月9日	10.99	7,700	84,623.00
148	603927	中科软	2024年7月9日-2024年	18.09	5,460	98,771.40

			7月9日			
149	688188	柏楚电子	2024年7月9日	184.55	1,120	206,696.00
150	688220	翱捷科技	2024年7月9日	37.46	2,300	86,158.00
151	688281	华秦科技	2024年7月9日	83.32	800	66,656.00
152	688390	固德威	2024年7月2日	56.12	1,760	98,771.20
153	688425	铁建重工	2024年7月5日-2024年7月9日	3.68	6,400	23,552.00
154	688516	奥特维	2024年7月9日	41.81	2,120	88,637.20
155	688538	和辉光电	2024年7月5日	1.98	74,500	147,510.00
156	688567	孚能科技	2024年7月9日-2024年7月9日	9.60	4,400	42,240.00
157	688779	五矿新能	2024年7月9日	4.63	10,500	48,615.00
合计	-	-	-	-	3,086,989	22,461,758.92

#### 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、风险控制委员会、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。本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小。

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，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，并按照合约规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 2024 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	7,573,458.44	-	-	-	7,573,458.44
结算备付金	6,121,423.12	-	-	-	6,121,423.12
存出保证金	360,931.73	-	-	-	360,931.73
交易性金融资产	-	-	-	-727,082,925.34	727,082,925.34
应收股利	-	-	-	14,972.03	14,972.03
其他资产	-	-	-	81,701.02	81,701.02
资产总计	14,055,813.29	-	-	-727,179,598.39	741,235,411.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	321,816.14	321,816.14
应付托管费	-	-	-	64,363.23	64,363.23
应付清算款	-	-	-	1.71	1.71
应交税费	-	-	-	3,100.75	3,100.75
其他负债	-	-	-	353,208.02	353,208.02
负债总计	-	-	-	742,489.85	742,489.85
利率敏感度缺口	14,055,813.29	-	-	-726,437,108.54	740,492,921.83
上年度末 2023 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	16,827,613.08	-	-	-	16,827,613.08
结算备付金	4,362,891.75	-	-	-	4,362,891.75
存出保证金	327,886.70	-	-	1,949,256.00	2,277,142.70
交易性金融资产	-	-	-	1,226,696,084.28	1,226,696,084.28
其他资产	-	-	-	90,929.07	90,929.07
资产总计	21,518,391.53	-	-	1,228,736,269.35	1,250,254,660.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	576,131.00	576,131.00
应付托管费	-	-	-	115,226.23	115,226.23
应付清算款	-	-	-	1.87	1.87
其他负债	-	-	-	1,046,951.49	1,046,951.49
负债总计	-	-	-	1,738,310.59	1,738,310.59
利率敏感度缺口	21,518,391.53	-	-	1,226,997,958.76	1,248,516,350.29

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，本基金未持有债券和资产支持证券资产（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 2024年6月30日		上年度末 2023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	727,082,925.34	98.19	1,226,696,084.28	98.25
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	727,082,925.34	98.19	1,226,696,084.28	98.25

#### 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		
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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）	

分析	沪深 300 指数上升 5%	53,634,724.33	51,795,483.09
	沪深 300 指数下降 5%	-53,634,724.33	-51,795,483.09

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	726,810,223.98	1,226,451,602.53
第二层次	45,611.11	-
第三层次	227,090.25	244,481.75
合计	727,082,925.34	1,226,696,084.28

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

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	727,082,925.34	98.09
	其中：股票	727,082,925.34	98.09
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	13,694,881.56	1.85
8	其他各项资产	457,604.78	0.06
9	合计	741,235,411.68	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 22,461,758.92 元，占净值比例 3.03%。

### 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	4,642,785.00	0.63
B	采矿业	33,461,948.48	4.52
C	制造业	462,723,462.12	62.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,378,727.33	3.56
E	建筑业	7,511,961.20	1.01
F	批发和零售业	15,554,758.40	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	13,725,438.48	1.85
H	住宿和餐饮业	2,331,351.40	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	52,263,080.46	7.06
J	金融业	67,197,649.51	9.07



K	房地产业	8,311,771.00	1.12
L	租赁和商务服务业	5,588,973.54	0.75
M	科学研究和技术服务业	5,898,319.76	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	3,363,722.02	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,580,938.00	0.62
R	文化、体育和娱乐业	11,058,209.06	1.49
S	综合	1,321,408.00	0.18
	合计	725,914,503.76	98.03

### 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	1,067,499.20	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
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	46,981.02	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	36,036.00	0.00
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00
M	科学研究和技术服务业	15,486.24	0.00
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	1,168,421.58	0.16
--	----	--------------	------

### 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	300502	新易盛	87,600	9,246,180.00	1.25
2	002028	思源电气	76,000	5,084,400.00	0.69
3	601058	赛轮轮胎	324,500	4,543,000.00	0.61
4	688169	石头科技	11,347	4,454,832.20	0.60
5	600066	宇通客车	163,800	4,226,040.00	0.57
6	002340	格林美	633,500	4,035,395.00	0.54
7	000933	神火股份	194,200	3,928,666.00	0.53
8	601077	渝农商行	763,300	3,831,766.00	0.52
9	000988	华工科技	124,025	3,712,068.25	0.50
10	601168	西部矿业	205,700	3,692,315.00	0.50
11	300394	天孚通信	41,000	3,625,220.00	0.49
12	002384	东山精密	170,200	3,523,140.00	0.48
13	000423	东阿阿胶	56,000	3,505,600.00	0.47
14	000630	铜陵有色	956,200	3,451,882.00	0.47
15	600418	江淮汽车	215,600	3,415,104.00	0.46
16	600988	赤峰黄金	205,500	3,357,870.00	0.45
17	601233	桐昆股份	208,400	3,326,064.00	0.45
18	002625	光启技术	185,900	3,225,365.00	0.44
19	600096	云天化	158,500	3,078,070.00	0.42
20	601567	三星医疗	87,900	3,076,500.00	0.42
21	000400	许继电气	88,790	3,055,263.90	0.41
22	688777	中控技术	78,672	2,965,934.40	0.40
23	002156	通富微电	131,904	2,953,330.56	0.40
24	002128	电投能源	139,600	2,945,560.00	0.40
25	002273	水晶光电	173,109	2,939,390.82	0.40
26	601555	东吴证券	494,040	2,914,836.00	0.39
27	002078	太阳纸业	206,600	2,882,070.00	0.39
28	600885	宏发股份	102,952	2,849,711.36	0.38
29	002532	天山铝业	347,300	2,816,603.00	0.38
30	002223	鱼跃医疗	74,898	2,816,164.80	0.38
31	300207	欣旺达	185,600	2,815,552.00	0.38
32	601128	常熟银行	371,780	2,814,374.60	0.38
33	600352	浙江龙盛	321,300	2,759,967.00	0.37
34	002138	顺络电子	100,303	2,754,320.38	0.37

35	002966	苏州银行	365,280	2,739,600.00	0.37
36	600398	海澜之家	295,900	2,734,116.00	0.37
37	002353	杰瑞股份	76,584	2,686,566.72	0.36
38	601108	财通证券	400,900	2,649,949.00	0.36
39	600765	中航重机	127,960	2,610,384.00	0.35
40	002185	华天科技	320,000	2,608,000.00	0.35
41	688617	惠泰医疗	5,700	2,599,770.00	0.35
42	002517	恺英网络	267,800	2,557,490.00	0.35
43	600879	航天电子	328,200	2,550,114.00	0.34
44	600873	梅花生物	248,200	2,486,964.00	0.34
45	603606	东方电缆	50,900	2,484,429.00	0.34
46	301236	软通动力	70,500	2,482,305.00	0.34
47	688099	晶晨股份	41,236	2,446,119.52	0.33
48	600177	雅戈尔	342,200	2,436,464.00	0.33
49	601577	长沙银行	297,500	2,433,550.00	0.33
50	002738	中矿资源	90,740	2,431,832.00	0.33
51	300003	乐普医疗	163,800	2,430,792.00	0.33
52	600079	人福医药	141,200	2,424,404.00	0.33
53	600109	国金证券	320,900	2,422,795.00	0.33
54	300017	网宿科技	304,000	2,401,600.00	0.32
55	600060	海信视像	96,700	2,392,358.00	0.32
56	300136	信维通信	120,500	2,359,390.00	0.32
57	600497	驰宏锌锗	439,500	2,346,930.00	0.32
58	603979	金诚信	46,200	2,334,486.00	0.32
59	603160	汇顶科技	33,900	2,330,625.00	0.31
60	002202	金风科技	343,500	2,308,320.00	0.31
61	689009	九号公司	62,245	2,291,238.45	0.31
62	000932	华菱钢铁	515,620	2,284,196.60	0.31
63	002739	万达电影	188,400	2,277,756.00	0.31
64	688120	华海清科	11,800	2,237,044.00	0.30
65	000683	远兴能源	322,700	2,229,857.00	0.30
66	600985	淮北矿业	133,052	2,227,290.48	0.30
67	600536	中国软件	74,298	2,222,996.16	0.30
68	002465	海格通信	214,200	2,219,112.00	0.30
69	002281	光迅科技	59,300	2,216,041.00	0.30
70	002444	巨星科技	89,700	2,215,590.00	0.30
71	002409	雅克科技	35,200	2,214,432.00	0.30
72	600348	华阳股份	222,250	2,213,610.00	0.30
73	000009	中国宝安	256,778	2,208,290.80	0.30
74	000878	云南铜业	174,600	2,175,516.00	0.29
75	002436	兴森科技	210,200	2,169,264.00	0.29
76	002008	大族激光	103,600	2,154,880.00	0.29
77	688122	西部超导	56,092	2,149,445.44	0.29

78	600642	申能股份	243,401	2,149,230.83	0.29
79	300474	景嘉微	33,850	2,140,335.50	0.29
80	601615	明阳智能	226,000	2,133,440.00	0.29
81	000039	中集集团	229,330	2,123,595.80	0.29
82	300054	鼎龙股份	93,400	2,118,312.00	0.29
83	000066	中国长城	240,900	2,107,875.00	0.28
84	002797	第一创业	412,600	2,100,134.00	0.28
85	601990	南京证券	273,300	2,098,944.00	0.28
86	600298	安琪酵母	75,100	2,097,543.00	0.28
87	300012	华测检测	207,500	2,087,450.00	0.28
88	600529	山东药玻	81,900	2,075,346.00	0.28
89	002673	西部证券	333,800	2,066,222.00	0.28
90	601666	平煤股份	183,600	2,056,320.00	0.28
91	600839	四川长虹	456,300	2,048,787.00	0.28
92	688525	佰维存储	31,909	2,046,962.35	0.28
93	601179	中国西电	253,355	2,036,974.20	0.28
94	603596	伯特利	52,320	2,035,248.00	0.27
95	000831	中国稀土	79,300	2,010,255.00	0.27
96	000783	长江证券	412,800	1,993,824.00	0.27
97	300395	菲利华	64,700	1,989,525.00	0.27
98	002432	九安医疗	48,900	1,982,406.00	0.27
99	300002	神州泰岳	244,000	1,981,280.00	0.27
100	000738	航发控制	98,200	1,970,874.00	0.27
101	601717	郑煤机	133,076	1,969,524.80	0.27
102	603816	顾家家居	60,800	1,963,232.00	0.27
103	000728	国元证券	323,400	1,959,804.00	0.26
104	000703	恒逸石化	273,900	1,941,951.00	0.26
105	600862	中航高科	103,300	1,939,974.00	0.26
106	688180	君实生物	66,747	1,939,000.35	0.26
107	000960	锡业股份	123,000	1,905,270.00	0.26
108	002595	豪迈科技	49,900	1,904,683.00	0.26
109	601198	东兴证券	239,200	1,904,032.00	0.26
110	601997	贵阳银行	361,100	1,902,997.00	0.26
111	603345	安井食品	25,500	1,894,905.00	0.26
112	603338	浙江鼎力	31,276	1,889,695.92	0.26
113	300037	新宙邦	65,620	1,874,107.20	0.25
114	600863	内蒙华电	403,500	1,872,240.00	0.25
115	002155	湖南黄金	103,400	1,871,540.00	0.25
116	600521	华海药业	109,500	1,866,975.00	0.25
117	688188	柏楚电子	10,116	1,866,907.80	0.25
118	603939	益丰药房	76,008	1,865,996.40	0.25
119	601162	天风证券	855,500	1,864,990.00	0.25
120	601696	中银证券	205,300	1,864,124.00	0.25

121	000921	海信家电	57,700	1,860,248.00	0.25
122	002472	双环传动	84,300	1,856,286.00	0.25
123	600038	中直股份	45,100	1,854,061.00	0.25
124	002984	森麒麟	76,900	1,852,521.00	0.25
125	002294	信立泰	69,500	1,850,785.00	0.25
126	300866	安克创新	25,960	1,848,611.60	0.25
127	300001	特锐德	91,875	1,848,525.00	0.25
128	300724	捷佳伟创	34,200	1,847,142.00	0.25
129	600141	兴发集团	95,460	1,821,376.80	0.25
130	002407	多氟多	148,540	1,816,644.20	0.25
131	600549	厦门钨业	105,000	1,811,250.00	0.24
132	002850	科达利	23,700	1,810,206.00	0.24
133	600699	均胜电子	121,880	1,806,261.60	0.24
134	002262	恩华药业	75,300	1,787,622.00	0.24
135	600546	山煤国际	122,100	1,785,102.00	0.24
136	300699	光威复材	71,676	1,779,715.08	0.24
137	600895	张江高科	96,300	1,779,624.00	0.24
138	301358	湖南裕能	56,500	1,777,490.00	0.24
139	600872	中炬高新	78,200	1,774,358.00	0.24
140	300285	国瓷材料	99,396	1,774,218.60	0.24
141	002064	华峰化学	247,300	1,773,141.00	0.24
142	600820	隧道股份	271,400	1,772,242.00	0.24
143	000021	深科技	116,700	1,764,504.00	0.24
144	600369	西南证券	491,600	1,759,928.00	0.24
145	002195	岩山科技	701,008	1,759,530.08	0.24
146	603589	口子窖	44,400	1,740,036.00	0.23
147	603087	甘李药业	37,500	1,737,000.00	0.23
148	300073	当升科技	50,600	1,736,086.00	0.23
149	601000	唐山港	368,020	1,729,694.00	0.23
150	600021	上海电力	174,000	1,720,860.00	0.23
151	300146	汤臣倍健	126,900	1,719,495.00	0.23
152	600486	扬农化工	30,307	1,710,830.15	0.23
153	000513	丽珠集团	45,886	1,707,418.06	0.23
154	002756	永兴材料	47,000	1,681,660.00	0.23
155	000830	鲁西化工	144,500	1,674,755.00	0.23
156	601966	玲珑轮胎	90,900	1,669,833.00	0.23
157	603179	新泉股份	42,500	1,667,700.00	0.23
158	600704	物产中大	384,250	1,667,645.00	0.23
159	300058	蓝色光标	304,866	1,658,471.04	0.22
160	600153	建发股份	185,100	1,652,943.00	0.22
161	300114	中航电测	36,500	1,651,625.00	0.22
162	600155	华创云信	279,400	1,651,254.00	0.22
163	300529	健帆生物	60,300	1,640,763.00	0.22

164	688065	凯赛生物	36,069	1,637,171.91	0.22
165	600118	中国卫星	72,800	1,618,344.00	0.22
166	002152	广电运通	154,600	1,617,116.00	0.22
167	600583	海油工程	273,100	1,614,021.00	0.22
168	601156	东航物流	79,100	1,609,685.00	0.22
169	000591	太阳能	340,400	1,603,284.00	0.22
170	002558	巨人网络	169,200	1,597,248.00	0.22
171	600970	中材国际	131,300	1,583,478.00	0.21
172	000623	吉林敖东	117,900	1,579,860.00	0.21
173	300144	宋城演艺	195,600	1,570,668.00	0.21
174	002439	启明星辰	90,900	1,568,934.00	0.21
175	300373	扬杰科技	40,100	1,559,890.00	0.21
176	605358	立昂微	67,200	1,555,008.00	0.21
177	600380	健康元	139,172	1,554,551.24	0.21
178	002025	航天电器	33,500	1,553,730.00	0.21
179	002385	大北农	403,300	1,552,705.00	0.21
180	000723	美锦能源	323,400	1,539,384.00	0.21
181	601216	君正集团	416,600	1,537,254.00	0.21
182	600143	金发科技	231,900	1,532,859.00	0.21
183	000729	燕京啤酒	173,500	1,532,005.00	0.21
184	600998	九州通	313,201	1,528,420.88	0.21
185	600282	南钢股份	306,900	1,528,362.00	0.21
186	600637	东方明珠	250,800	1,524,864.00	0.21
187	300251	光线传媒	180,800	1,520,528.00	0.21
188	300677	英科医疗	56,400	1,512,084.00	0.20
189	000519	中兵红箭	102,600	1,505,142.00	0.20
190	000636	风华高科	115,214	1,504,694.84	0.20
191	300024	机器人	154,400	1,503,856.00	0.20
192	600763	通策医疗	27,800	1,502,590.00	0.20
193	600392	盛和资源	174,310	1,502,552.20	0.20
194	300383	光环新网	177,200	1,497,340.00	0.20
195	600516	方大炭素	347,340	1,497,035.40	0.20
196	000818	航锦科技	67,600	1,492,608.00	0.20
197	002044	美年健康	390,500	1,476,090.00	0.20
198	002958	青农商行	548,900	1,471,052.00	0.20
199	600909	华安证券	347,970	1,464,953.70	0.20
200	600008	首创环保	546,050	1,463,414.00	0.20
201	601665	齐鲁银行	298,000	1,463,180.00	0.20
202	600867	通化东宝	173,100	1,448,847.00	0.20
203	600566	济川药业	45,600	1,445,976.00	0.20
204	000883	湖北能源	239,900	1,441,799.00	0.19
205	688213	思特威	29,627	1,436,909.50	0.19
206	601016	节能风电	480,150	1,435,648.50	0.19

207	600511	国药股份	46,600	1,434,814.00	0.19
208	000629	钒钛股份	572,200	1,430,500.00	0.19
209	000997	新大陆	102,700	1,428,557.00	0.19
210	600170	上海建工	663,800	1,427,170.00	0.19
211	601456	国联证券	147,400	1,420,936.00	0.19
212	600535	天士力	112,900	1,420,282.00	0.19
213	600582	天地科技	205,500	1,415,895.00	0.19
214	002120	韵达股份	182,700	1,414,098.00	0.19
215	600499	科达制造	167,000	1,407,810.00	0.19
216	600498	烽火通信	88,480	1,406,832.00	0.19
217	300088	长信科技	298,600	1,403,420.00	0.19
218	000598	兴蓉环境	185,800	1,397,216.00	0.19
219	600129	太极集团	48,200	1,393,944.00	0.19
220	601991	大唐发电	461,500	1,389,115.00	0.19
221	600004	白云机场	146,300	1,386,924.00	0.19
222	002261	拓维信息	124,700	1,380,429.00	0.19
223	300118	东方日升	113,700	1,375,770.00	0.19
224	600580	卧龙电驱	113,000	1,372,950.00	0.19
225	300568	星源材质	167,400	1,372,680.00	0.19
226	603000	人民网	68,600	1,371,314.00	0.19
227	300567	精测电子	24,200	1,367,542.00	0.18
228	000060	中金岭南	322,000	1,365,280.00	0.18
229	002430	杭氧股份	61,200	1,361,700.00	0.18
230	000750	国海证券	467,540	1,360,541.40	0.18
231	603486	科沃斯	28,700	1,354,066.00	0.18
232	002429	兆驰股份	281,400	1,353,534.00	0.18
233	002939	长城证券	200,700	1,344,690.00	0.18
234	603156	养元饮品	62,800	1,335,756.00	0.18
235	603658	安图生物	28,900	1,331,423.00	0.18
236	600325	华发股份	204,800	1,331,200.00	0.18
237	600166	福田汽车	590,900	1,329,525.00	0.18
238	603228	景旺电子	41,743	1,327,427.40	0.18
239	300765	新诺威	52,600	1,327,098.00	0.18
240	600816	建元信托	489,500	1,326,545.00	0.18
241	601231	环旭电子	82,400	1,322,520.00	0.18
242	600673	东阳光	187,700	1,321,408.00	0.18
243	603927	中科软	72,478	1,311,127.02	0.18
244	601933	永辉超市	526,900	1,306,712.00	0.18
245	600754	锦江酒店	56,800	1,305,264.00	0.18
246	603568	伟明环保	63,419	1,305,163.02	0.18
247	002508	老板电器	59,000	1,303,900.00	0.18
248	300601	康泰生物	83,500	1,303,435.00	0.18
249	000893	亚钾国际	80,200	1,296,032.00	0.18

250	600563	法拉电子	16,990	1,294,298.20	0.17
251	000027	深圳能源	176,980	1,291,954.00	0.17
252	601866	中远海发	500,546	1,291,408.68	0.17
253	002926	华西证券	195,900	1,290,981.00	0.17
254	002497	雅化集团	144,500	1,288,940.00	0.17
255	000998	隆平高科	131,100	1,288,713.00	0.17
256	300487	蓝晓科技	30,850	1,288,296.00	0.17
257	601636	旗滨集团	199,200	1,284,840.00	0.17
258	002624	完美世界	169,050	1,284,780.00	0.17
259	002653	海思科	41,700	1,280,190.00	0.17
260	603298	杭叉集团	65,100	1,278,564.00	0.17
261	603290	斯达半导	14,800	1,274,428.00	0.17
262	300253	卫宁健康	215,800	1,273,220.00	0.17
263	600737	中粮糖业	132,757	1,273,139.63	0.17
264	002299	圣农发展	92,900	1,267,156.00	0.17
265	688052	纳芯微	12,300	1,264,194.00	0.17
266	002056	横店东磁	101,300	1,263,211.00	0.17
267	002500	山西证券	268,070	1,259,929.00	0.17
268	688002	睿创微纳	45,006	1,258,817.82	0.17
269	688385	复旦微电	40,112	1,258,714.56	0.17
270	600131	国网信通	74,600	1,258,502.00	0.17
271	002414	高德红外	212,900	1,253,981.00	0.17
272	300604	长川科技	46,100	1,252,537.00	0.17
273	002065	东华软件	276,900	1,251,588.00	0.17
274	601958	金钼股份	120,200	1,251,282.00	0.17
275	600373	中文传媒	84,300	1,251,012.00	0.17
276	300763	锦浪科技	30,000	1,249,200.00	0.17
277	688772	珠海冠宇	83,687	1,246,936.30	0.17
278	600655	豫园股份	241,500	1,243,725.00	0.17
279	300390	天华新能	72,220	1,240,739.60	0.17
280	603893	瑞芯微	20,900	1,236,653.00	0.17
281	300009	安科生物	144,628	1,235,123.12	0.17
282	002507	涪陵榨菜	100,590	1,232,227.50	0.17
283	688114	华大智造	25,962	1,230,858.42	0.17
284	002368	太极股份	54,296	1,224,374.80	0.17
285	002372	伟星新材	79,340	1,223,422.80	0.17
286	601611	中国核建	150,080	1,214,147.20	0.16
287	600707	彩虹股份	177,400	1,208,094.00	0.16
288	603885	吉祥航空	109,920	1,208,020.80	0.16
289	000887	中鼎股份	98,300	1,203,192.00	0.16
290	688390	固德威	21,342	1,197,713.04	0.16
291	002203	海亮股份	149,407	1,192,267.86	0.16
292	603379	三美股份	30,420	1,190,638.80	0.16



293	002831	裕同科技	46,380	1,186,864.20	0.16
294	603225	新风鸣	75,920	1,183,592.80	0.16
295	600755	厦门国贸	163,900	1,175,163.00	0.16
296	600329	达仁堂	36,000	1,166,040.00	0.16
297	688521	芯原股份	43,400	1,160,950.00	0.16
298	600859	王府井	98,600	1,157,564.00	0.16
299	300296	利亚德	255,600	1,150,200.00	0.16
300	600801	华新水泥	83,380	1,146,475.00	0.15
301	600390	五矿资本	282,900	1,145,745.00	0.15
302	600995	南网储能	118,600	1,145,676.00	0.15
303	600416	湘电股份	114,900	1,142,106.00	0.15
304	600884	杉杉股份	140,400	1,140,048.00	0.15
305	002683	广东宏大	56,600	1,139,358.00	0.15
306	300070	碧水源	270,500	1,133,395.00	0.15
307	002019	亿帆医药	91,500	1,130,940.00	0.15
308	002244	滨江集团	154,900	1,124,574.00	0.15
309	600435	北方导航	130,300	1,123,186.00	0.15
310	002572	索菲亚	72,700	1,114,491.00	0.15
311	000050	深天马 A	153,000	1,113,840.00	0.15
312	600483	福能股份	95,500	1,113,530.00	0.15
313	300803	指南针	30,500	1,110,505.00	0.15
314	600739	辽宁成大	132,600	1,109,862.00	0.15
315	300748	金力永磁	85,580	1,109,116.80	0.15
316	601098	中南传媒	89,093	1,106,535.06	0.15
317	002506	协鑫集成	569,900	1,105,606.00	0.15
318	600598	北大荒	88,400	1,104,116.00	0.15
319	600399	抚顺特钢	195,700	1,101,791.00	0.15
319	601598	中国外运	195,700	1,101,791.00	0.15
320	002487	大金重工	47,700	1,091,376.00	0.15
321	000155	川能动力	101,300	1,091,001.00	0.15
322	300676	华大基因	31,100	1,088,811.00	0.15
323	600848	上海临港	119,000	1,084,090.00	0.15
324	002240	盛新锂能	80,300	1,077,626.00	0.15
325	001286	陕西能源	93,300	1,075,749.00	0.15
326	002568	百润股份	63,780	1,073,417.40	0.14
327	002373	千方科技	118,137	1,071,502.59	0.14
328	600901	江苏金租	212,100	1,071,105.00	0.14
329	002557	洽洽食品	37,900	1,068,401.00	0.14
330	002080	中材科技	82,700	1,066,830.00	0.14
331	603712	七一二	58,455	1,063,296.45	0.14
332	688017	绿的谐波	12,800	1,050,880.00	0.14
333	300595	欧普康视	67,000	1,050,560.00	0.14
334	600968	海油发展	254,600	1,048,952.00	0.14

335	603883	老百姓	56,787	1,042,609.32	0.14
336	603858	步长制药	68,600	1,039,290.00	0.14
337	000563	陕国投 A	377,340	1,037,685.00	0.14
338	601928	凤凰传媒	94,600	1,036,816.00	0.14
339	002268	电科网安	72,800	1,035,944.00	0.14
340	600258	首旅酒店	83,084	1,026,087.40	0.14
341	000778	新兴铸管	294,500	1,024,860.00	0.14
342	688538	和辉光电	516,993	1,023,646.14	0.14
343	601212	白银有色	368,200	1,023,596.00	0.14
344	300558	贝达药业	31,300	1,018,815.00	0.14
345	688234	天岳先进	21,700	1,018,164.00	0.14
346	600271	航天信息	138,100	1,016,416.00	0.14
347	688301	奕瑞科技	8,783	1,012,065.09	0.14
348	600528	中铁工业	138,033	1,010,401.56	0.14
349	603688	石英股份	34,100	1,009,701.00	0.14
350	600062	华润双鹤	51,420	1,006,803.60	0.14
351	601155	新城控股	112,500	997,875.00	0.13
352	600977	中国电影	92,700	997,452.00	0.13
353	002408	齐翔腾达	177,140	991,984.00	0.13
354	002531	天顺风能	110,800	990,552.00	0.13
355	000739	普洛药业	72,781	987,638.17	0.13
356	688005	容百科技	42,409	987,281.52	0.13
357	600959	江苏有线	373,501	986,042.64	0.13
358	601118	海南橡胶	216,000	982,800.00	0.13
359	688220	翱捷科技	26,226	982,425.96	0.13
360	600378	昊华科技	33,900	979,710.00	0.13
361	688536	思瑞浦	10,000	978,100.00	0.13
362	000709	河钢股份	503,300	976,402.00	0.13
363	000825	太钢不锈	286,900	969,722.00	0.13
364	603444	吉比特	5,447	969,620.47	0.13
365	688331	荣昌生物	22,161	957,355.20	0.13
366	603882	金域医学	35,000	951,650.00	0.13
367	603737	三棵树	26,220	950,999.40	0.13
368	688200	华峰测控	10,300	945,025.00	0.13
369	600056	中国医药	92,740	938,528.80	0.13
370	600517	国网英大	216,600	937,878.00	0.13
371	601399	国机重装	358,700	925,446.00	0.12
372	002266	浙富控股	331,600	925,164.00	0.12
373	600906	财达证券	161,000	922,530.00	0.12
374	000987	越秀资本	185,985	922,485.60	0.12
375	603456	九洲药业	67,200	921,984.00	0.12
376	601019	山东出版	77,900	920,778.00	0.12
377	600612	老凤祥	15,700	913,583.00	0.12

378	300212	易华录	54,012	909,021.96	0.12
379	600316	洪都航空	53,600	891,368.00	0.12
380	000937	冀中能源	131,900	883,730.00	0.12
381	603650	彤程新材	29,900	883,545.00	0.12
382	603529	爱玛科技	32,000	874,560.00	0.12
383	688567	孚能科技	90,943	873,052.80	0.12
384	600925	苏能股份	171,200	864,560.00	0.12
385	688063	派能科技	21,700	861,707.00	0.12
386	002423	中粮资本	114,800	859,852.00	0.12
387	000032	深桑达 A	56,600	847,868.00	0.11
388	601965	中国汽研	50,000	844,500.00	0.11
389	001227	兰州银行	352,900	839,902.00	0.11
390	601608	中信重工	219,700	837,057.00	0.11
391	603728	鸣志电器	20,800	836,784.00	0.11
392	600098	广州发展	130,700	836,480.00	0.11
393	601298	青岛港	86,700	828,852.00	0.11
394	688516	奥特维	19,823	828,799.63	0.11
395	688297	中无人机	25,062	827,797.86	0.11
396	600208	新湖中宝	522,700	825,866.00	0.11
397	002670	国盛金控	96,403	816,533.41	0.11
398	603233	大参林	57,000	815,100.00	0.11
399	600663	陆家嘴	92,400	814,968.00	0.11
400	600578	京能电力	249,700	809,028.00	0.11
401	300438	鹏辉能源	43,900	805,126.00	0.11
402	688561	奇安信	33,887	800,410.94	0.11
403	600500	中化国际	227,020	792,299.80	0.11
404	601106	中国一重	341,100	787,941.00	0.11
405	300776	帝尔激光	17,120	786,835.20	0.11
406	300357	我武生物	38,815	784,839.30	0.11
407	600377	宁沪高速	61,600	776,160.00	0.10
408	002865	钧达股份	20,100	771,438.00	0.10
409	003031	中瓷电子	16,640	769,433.60	0.10
410	600967	内蒙一机	104,700	753,840.00	0.10
411	000785	居然之家	310,200	753,786.00	0.10
412	600315	上海家化	42,126	749,000.28	0.10
413	688349	三一重能	30,121	748,205.64	0.10
414	600350	山东高速	83,700	740,745.00	0.10
415	300888	稳健医疗	29,260	740,278.00	0.10
416	000537	中绿电	77,300	736,669.00	0.10
417	601568	北元集团	197,720	733,541.20	0.10
418	600827	百联股份	99,100	731,358.00	0.10
419	688029	南微医学	11,860	730,101.60	0.10
420	688425	铁建重工	198,203	729,387.04	0.10

421	002608	江苏国信	94,000	728,500.00	0.10
422	002690	美亚光电	44,090	727,485.00	0.10
423	000156	华数传媒	115,400	724,712.00	0.10
424	603517	绝味食品	47,000	723,800.00	0.10
425	688032	禾迈股份	6,258	718,293.24	0.10
426	603826	坤彩科技	24,640	713,820.80	0.10
427	603707	健友股份	60,031	713,168.28	0.10
428	002867	周大生	54,550	712,423.00	0.10
429	000958	电投产融	193,800	709,308.00	0.10
430	000559	万向钱潮	157,900	704,234.00	0.10
431	300682	朗新集团	81,200	691,012.00	0.09
432	600126	杭钢股份	167,027	686,480.97	0.09
433	003022	联泓新科	50,000	685,500.00	0.09
434	688475	萤石网络	19,900	678,789.00	0.09
435	600339	中油工程	213,800	667,056.00	0.09
436	688520	神州细胞	16,900	665,015.00	0.09
437	688778	厦钨新能	21,240	663,537.60	0.09
438	600481	双良节能	141,300	659,871.00	0.09
439	603218	日月股份	63,900	656,253.00	0.09
440	600095	湘财股份	109,500	652,620.00	0.09
441	600032	浙江新能	89,600	652,288.00	0.09
442	600361	创新新材	161,600	651,248.00	0.09
443	301267	华夏眼科	31,400	650,608.00	0.09
444	603786	科博达	10,100	647,915.00	0.09
445	000967	盈峰环境	152,400	644,652.00	0.09
446	688248	南网科技	21,400	634,082.00	0.09
447	000898	鞍钢股份	296,300	628,156.00	0.08
448	003035	南网能源	141,500	622,600.00	0.08
449	603127	昭衍新药	46,788	620,876.76	0.08
450	688281	华秦科技	7,385	615,318.20	0.08
451	600808	马钢股份	299,666	605,325.32	0.08
452	002563	森马服饰	102,400	594,944.00	0.08
453	000539	粤电力 A	114,400	581,152.00	0.08
454	603185	弘元绿能	34,000	581,060.00	0.08
455	601228	广州港	186,300	568,215.00	0.08
456	002153	石基信息	98,046	561,803.58	0.08
457	001872	招商港口	28,900	556,325.00	0.08
458	688779	五矿新能	119,848	554,896.24	0.07
459	600928	西安银行	165,700	541,839.00	0.07
460	001203	大中矿业	56,200	540,082.00	0.07
461	688006	杭可科技	30,221	527,356.45	0.07
462	600764	中国海防	26,500	520,195.00	0.07
463	002518	科士达	29,200	516,840.00	0.07

464	000401	冀东水泥	127,300	516,838.00	0.07
465	603056	德邦股份	39,200	513,520.00	0.07
466	000959	首钢股份	183,200	498,304.00	0.07
467	603305	旭升集团	46,300	488,928.00	0.07
468	600299	安迪苏	50,200	486,940.00	0.07
469	688172	燕东微	29,628	479,381.04	0.06
470	601139	深圳燃气	70,550	471,274.00	0.06
471	300861	美畅股份	23,800	460,530.00	0.06
472	603317	天味食品	39,391	449,451.31	0.06
473	688276	百克生物	15,700	445,409.00	0.06
474	688375	国博电子	6,095	430,550.80	0.06
475	688387	信科移动	84,815	427,467.60	0.06
476	301029	怡合达	21,580	424,262.80	0.06
477	002791	坚朗五金	16,100	416,507.00	0.06
478	600927	永安期货	36,900	411,435.00	0.06
479	688819	天能股份	17,165	409,556.90	0.06
480	688153	唯捷创芯	10,600	392,200.00	0.05
481	688107	安路科技	15,200	386,384.00	0.05
482	601858	中国科传	19,700	376,664.00	0.05
483	000031	大悦城	151,100	353,574.00	0.05
484	601158	重庆水务	73,000	350,400.00	0.05
485	601828	美凯龙	136,710	348,610.50	0.05
486	002945	华林证券	34,400	343,312.00	0.05
487	688348	昱能科技	5,700	336,300.00	0.05
488	600956	新天绿能	38,300	312,911.00	0.04
489	301165	锐捷网络	8,600	256,624.00	0.03
490	688295	中复神鹰	12,500	253,750.00	0.03
491	603868	飞科电器	6,000	230,400.00	0.03

### 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	301526	国际复材	97,225	323,759.25	0.04
2	688709	成都华微	10,448	201,301.51	0.03
3	601096	宏盛华源	39,171	160,209.39	0.02
4	301539	宏鑫科技	3,607	92,654.66	0.01
5	603381	永臻股份	1,778	49,273.14	0.01
6	603325	博隆技术	660	45,347.28	0.01
7	400174	中天3	327,600	36,036.00	0.00
8	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
9	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
10	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
11	301536	星辰科技	481	15,521.87	0.00
12	301508	中机认检	419	15,486.24	0.00

13	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
14	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
15	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
16	301516	中远通	604	11,252.52	0.00
17	301591	肯特股份	284	10,745.42	0.00
18	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
19	688653	康希通信	648	8,346.24	0.00
20	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
21	688720	艾森股份	165	6,689.10	0.00
22	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
23	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
24	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
25	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
26	603107	上海汽配	292	4,639.88	0.00
27	603062	麦加芯彩	126	4,184.46	0.00
28	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
29	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
30	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
31	603273	天元智能	178	3,266.30	0.00
32	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
33	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
34	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
35	603373	安邦护卫	88	2,419.12	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	688777	中控技术	3,435,369.52	0.28
2	601567	三星医疗	3,002,153.00	0.24
3	688617	惠泰医疗	2,640,942.78	0.21
4	002202	金风科技	2,615,027.00	0.21
5	002436	兴森科技	2,451,672.00	0.20
6	603979	金诚信	2,406,951.00	0.19
7	601615	明阳智能	2,370,222.00	0.19
8	600157	永泰能源	2,303,010.00	0.18
9	301358	湖南裕能	2,294,895.00	0.18
10	000921	海信家电	2,258,396.00	0.18
11	300002	神州泰岳	2,218,157.00	0.18
12	300054	鼎龙股份	2,201,038.00	0.18
13	603345	安井食品	2,129,306.00	0.17
14	600872	中炬高新	2,094,082.00	0.17
15	002984	森麒麟	1,961,035.00	0.16

16	688525	佰维存储	1,859,358.67	0.15
17	603179	新泉股份	1,831,277.00	0.15
18	002850	科达利	1,800,569.00	0.14
19	603087	甘李药业	1,796,257.00	0.14
20	000818	航锦科技	1,731,494.00	0.14

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	002463	沪电股份	8,238,546.50	0.66
2	002422	科伦药业	7,231,607.00	0.58
3	000975	山金国际	6,470,976.17	0.52
4	300418	昆仑万维	6,001,389.90	0.48
5	300502	新易盛	4,022,896.00	0.32
6	600160	巨化股份	3,980,719.40	0.32
7	688072	拓荆科技	3,823,529.84	0.31
8	600157	永泰能源	3,670,120.00	0.29
9	600161	天坛生物	3,357,902.00	0.27
10	300394	天孚通信	3,172,316.40	0.25
11	002936	郑州银行	2,971,034.33	0.24
12	600415	小商品城	2,969,454.00	0.24
13	002600	领益智造	2,941,277.00	0.24
14	002028	思源电气	2,822,699.00	0.23
15	002966	苏州银行	2,762,954.00	0.22
16	600482	中国动力	2,674,134.00	0.21
17	000988	华工科技	2,648,313.00	0.21
18	000423	东阿阿胶	2,564,608.00	0.21
19	000933	神火股份	2,490,912.00	0.20
20	002131	利欧股份	2,436,885.00	0.20

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	184,511,337.65
卖出股票收入（成交）总额	364,643,932.17

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投资。

**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投资。

**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**

本基金投资于标的指数为基础的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

**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**

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

**7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库**

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	360,931.73
2	应收清算款	-
3	应收股利	14,972.03
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	6,290.95
7	待摊费用	75,410.07
8	其他	-



9	合计	457,604.78
---	----	------------

#### 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

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	601058	赛轮轮胎	648,200.00	0.09	转融通流通受限
2	600066	宇通客车	516,000.00	0.07	转融通流通受限
3	002028	思源电气	287,670.00	0.04	转融通流通受限
4	601168	西部矿业	46,670.00	0.01	转融通流通受限

##### 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	688709	成都华微	19,635.55	0.00	新股锁定
2	301539	宏鑫科技	7,155.02	0.00	新股锁定
3	603381	永臻股份	4,473.14	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 (%)
852	169,936.76	141,820,324.00	97.95	2,965,797.00	2.05

#### 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 500ETF 联接基金	116,350,799.00	80.36

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	22,430,219.00	15.49
2	国泰君安证券股份有限公司	605,776.00	0.42
3	广发证券股份有限公司	537,195.00	0.37
4	大杨集团有限责任公司	500,572.00	0.35
5	方正证券股份有限公司	482,525.00	0.33
6	谷元明	389,500.00	0.27
7	中国银河证券股份有限公司	316,100.00	0.22
8	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—银保账户	237,800.00	0.16
9	黎旭晖	236,286.00	0.16
10	国亨信益（北京）资产管理有限公司	150,800.00	0.10
11	平安银行股份有限公司—平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	116,350,799.00	80.36

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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（2018年3月23日） 基金份额总额	2,648,875,604.00
本报告期期初基金份额总额	220,386,121.00
本报告期基金总申购份额	13,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	88,800,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	144,786,121.00

## § 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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 (%)	
中信证券	3	274,040,780.82	50.03	201,667.90	50.03	退租 1 个
东吴证券	2	110,041,896.08	20.09	80,979.22	20.09	-
东北证券	3	100,354,863.00	18.32	73,850.78	18.32	-

申万宏源 证券	2	53,682,032.4 4	9.80	39,510.56	9.80	-
国泰君安 证券	2	3,574,904.92	0.65	2,630.93	0.65	新增 1 个
开源证券	2	3,435,437.32	0.63	2,527.92	0.63	-
国信证券	2	2,516,306.00	0.46	1,851.85	0.46	-
长江证券	1	69,953.73	0.01	51.47	0.01	-
西部证券	1	49,440.42	0.01	36.39	0.01	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	退租 1 个
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	退租 2 个
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	退租 2 个
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2 本基金管理人负责根据上述选择标准,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。

### 10.7.2 基金租用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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证	-	-	-	-	-	-

券						
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
国投证 券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
世纪证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证	-	-	-	-	-	-

券						
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

## 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 500 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	2024 年 01 月 03 日
2	平安中证 500 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	2024 年 01 月 03 日
3	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 04 日
4	平安中证 500 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	2024 年 01 月 06 日
5	平安中证 500 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	2024 年 01 月 06 日
6	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 15 日
7	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 22 日
8	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 30 日
9	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
10	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 19 日
11	平安中证 500 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	2024 年 06 月 28 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	2024 年 01 月 01 日-2024 年	191,187,899.00	101,932,900.00	176,770,000.00	116,350,799.00	80.36

		06 月 30 日					
产品特有风险							
<p>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。</p>							

## 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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安中证 500 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

2024 年 8 月 31 日