

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
2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	12
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
§ 5 托管人报告	13
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真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
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	17
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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	46
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	46
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	46
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	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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	48
§ 9 开放式基金份额变动	48
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	49
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	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	平安中证全指自由现金流 ETF
场内简称	自由现金流 ETF 平安
基金主代码	159233
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 5 月 21 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	487,623,418.00 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 6 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。
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	中证全指自由现金流指数收益率
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	中国工商银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李海波	郭明
	联系电话	0755-88622632	(010)66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		罗春风	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	23,761,711.27
本期利润	-53,946,860.96
加权平均基金份额本期利润	-0.1160
本期加权平均净值利润率	-9.05%
本期基金份额净值增长率	-9.50%
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	52,202,551.35
期末可供分配基金份额利润	0.1071
期末基金资产净值	539,825,969.35
期末基金份额净值	1.1071
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.71%

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	-15.46%	0.89%	-17.11%	0.88%	1.65%	0.01%
过去六个月	-9.50%	1.10%	-12.45%	1.10%	2.95%	0.00%
过去一年	10.46%	0.99%	5.31%	1.00%	5.15%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.71%	0.95%	4.09%	0.96%	6.62%	-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

平安中证全指自由现金流ETF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 2025 年 05 月 21 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		
钱晶	ETF 指数投资部投资副总监，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基金经理	2025 年 5 月 21 日	-	15 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数投资部投资副总监，同时平安中证 A50 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 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、平安恒生港股通中国央企红利交易型开放式指数证券投资基金、平安恒生港股通科技主题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发起式联接基金基金经理。
白圭尧	平安中证全指自由现金流交	2025 年 6 月 25 日	-	6 年	白圭尧先生，对外经济贸易大学硕士，曾任中国五矿集团公司交易员、中国邮政储蓄银行资产管理部投资经理、中邮理财有

	易型开放式指数证券投资基金基金经理				限责任公司组合策略部高级副总裁。2025年5月加入平安基金管理有限公司，现担任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、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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 股低波动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 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、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、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安国证石油天然气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、平安中证人工智能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、平安中证工业有色金属主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
李严	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基金经理助理	2025 年 11 月 17 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全指自由现金流的被动型产品，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 0.04%，年化跟踪误差 1.59%，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 1.1071 元，本报告期基金份额净值增长率为-9.50%，业绩比较基准收益率为-12.45%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

作为指数化产品管理者，积极做好组合管理，为投资者提供优质投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证全指自由现金流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	5,944,663.42	8,523,235.42
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	536,003,998.57	696,749,684.06

其中：股票投资		535,825,990.38	696,749,684.06
基金投资		-	-
债券投资		178,008.19	-
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		165,162.20	-
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		542,174,316.82	705,272,919.48
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		229,579.63	327,289.54
应付托管费		45,915.93	65,457.90
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.23	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	2,072,851.68	3,148,177.15
负债合计		2,348,347.47	3,540,924.59
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	487,623,418.00	573,623,418.00
未分配利润	6.4.7.12	52,202,551.35	128,108,576.89
净资产合计		539,825,969.35	701,731,994.89
负债和净资产总计		542,174,316.82	705,272,919.48

注：（1）报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.1071 元，基金份额总额 487,623,418.00 份。

（2） 本基金财务报表上年度实际可比期间为 2025 年 5 月 21 日（基金合同生效日）至 2025 年 06 月 30 日。

6.2 利润表

会计主体：平安中证全指自由现金流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 5 月 21 日(基金合 同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-52,012,860.74	257,304.07
1. 利息收入		3,037.41	27,037.70
其中：存款利息收入	6.4.7.13	3,037.41	27,037.70
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）		24,817,780.71	1,577,384.80
其中：股票投资收益	6.4.7.14	17,547,853.49	-6,755,870.67
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7.98	-
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	7,269,919.24	8,333,255.47
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	-77,708,572.23	-1,582,496.48
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	874,893.37	235,378.05
减：二、营业总支出		1,934,000.22	427,481.81
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,488,204.65	321,866.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	297,640.91	64,373.34
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		0. 02	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	148, 154. 64	41, 241. 82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-53, 946, 860. 96	-170, 177. 74
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-53, 946, 860. 96	-170, 177. 74
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-53, 946, 860. 96	-170, 177. 74

6.3 净资产变动表

会计主体：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

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	573, 623, 418. 00	128, 108, 576. 89	701, 731, 994. 89
二、本期期初净资产	573, 623, 418. 00	128, 108, 576. 89	701, 731, 994. 89
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-86, 000, 000. 00	-75, 906, 025. 54	-161, 906, 025. 54
（一）、综合收益总额	-	-53, 946, 860. 96	-53, 946, 860. 96
（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）	-86, 000, 000. 00	-21, 959, 164. 58	-107, 959, 164. 58
其中：1. 基金申购款	365, 000, 000. 00	103, 830, 017. 51	468, 830, 017. 51
2. 基金赎回款	-451, 000, 000. 00	-125, 789, 182. 09	-576, 789, 182. 09
（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	487, 623, 418. 00	52, 202, 551. 35	539, 825, 969. 35

项目	上年度可比期间 2025 年 5 月 21 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	717,623,418.00	-	717,623,418.00
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-241,000,000.00	1,094,925.54	-239,905,074.46
（一）、综合收益总额	-	-170,177.74	-170,177.74
（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）	-241,000,000.00	1,265,103.28	-239,734,896.72
其中：1. 基金申购款	73,000,000.00	-192,592.30	72,807,407.70
2. 基金赎回款	-314,000,000.00	1,457,695.58	-312,542,304.42
（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	476,623,418.00	1,094,925.54	477,718,343.54

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

平安中证全指自由现金流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]653 号文《关于准予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《平安中证全指自由现金流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，《平安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 5 月 21 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 4 月 14 日至 2025 年 5 月 16 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 717,592,000.00 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 36,325.15 元，其中人民币 31,418.00 元折合 31,418.00 份基金份额，剩余人民币 4,907.15 元归入基金财产，以上实收基金（本息）合计为人民币 717,623,418.00 元，折合 717,623,418.00 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_H11 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司，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]523 号文审核同意，本基金 717,623,418.00 份基金份额于 2025 年 6 月 4 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《平安中证全指自由现金流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：本基金投资于中证全指自由现金流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，即中证全指自由现金流指数收益率。

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	500,031.77
等于：本金	499,988.00
加：应计利息	43.77
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	5,444,631.65
等于：本金	5,444,490.26
加：应计利息	141.39
合计	5,944,663.42

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	587,620,882.86	—	535,825,990.38	-51,794,892.48
贵金属投资—金交所黄金合约	—	—	—	—
债券 交易所市场	178,000.00	8.19	178,008.19	0.00

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	178,000.00	8.19	178,008.19	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		587,798,882.86	8.19	536,003,998.57	-51,794,892.48

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	88,268.27
应退退补款	1,733,865.41
其他	250,718.00
合计	2,072,851.68

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	573,623,418.00	573,623,418.00
本期申购	365,000,000.00	365,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-451,000,000.00	-451,000,000.00
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	487,623,418.00	487,623,418.00

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	100,730,207.84	27,378,369.05	128,108,576.89
本期期初	100,730,207.84	27,378,369.05	128,108,576.89
本期利润	23,761,711.27	-77,708,572.23	-53,946,860.96
本期基金份额交易产生的变动数	-9,173,040.26	-12,786,124.32	-21,959,164.58
其中：基金申购款	102,634,968.02	1,195,049.49	103,830,017.51
基金赎回款	-111,808,008.28	-13,981,173.81	-125,789,182.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	115,318,878.85	-63,116,327.50	52,202,551.35

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	901.12
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,136.29
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	3,037.41

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	12,251,083.61
股票投资收益——赎回差价收入	5,296,769.88
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	17,547,853.49

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	860,937,885.80
减：卖出股票成本总额	847,841,251.80
减：交易费用	845,550.39
买卖股票差价收入	12,251,083.61

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	576,789,182.09
减：现金支付赎回款总额	376,356,934.09
减：赎回股票成本总额	195,135,478.12
减：交易费用	-
赎回差价收入	5,296,769.88

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	7.98
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	7.98

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	7,269,919.24
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	7,269,919.24

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	-77,708,572.23
股票投资	-77,708,572.23
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	-77,708,572.23

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	874,893.37
合计	874,893.37

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	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	379.00
其他	69,424.36

合计	148,154.64
----	------------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司
平安中证全指自由现金流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 ETF 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 5 月 21 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 (%)
方正证券	1,660,194,530.67	100.00	1,425,784,584.80	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 (%)
方正证券	308,639.89	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年5月21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 (%)
方正证券	265,065.71	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	上年度可比期间 2025 年 5 月 21 日（基金合
----	--------------------------------	--------------------------------

	月 30 日	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	1,488,204.65	321,866.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	146,313.53	130,842.60
应支付基金管理人的净管理费	1,341,891.12	191,024.05

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 5 月 21 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	297,640.91	64,373.34

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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	8,372,600.00	1.7170	10,111,503.00	1.7627
平安中证全指 自由现金流 ETF联接	235,339,707.00	48.2626	383,240,207.00	66.8104

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5月21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
工商银行-活期	500,031.77	901.12	617,611.13	7,198.80

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	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	8,393	84,853.23	84,853.23	-
001248	华	2026	6 个月	新股	10.11	10.11	19,585	198,004.35	198,004.35	-

	润 新 能 源	年 6 月 24 日		锁定						
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	3,088	31,250.56	85,630.24	-
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	558	38,870.28	89,313.48	-
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	-

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	2026 年 6 月 11	1 个月 内（含）	新债 未上 市	100.00	100.00	1,780	178,000.00	178,008.19	-

	债	日								
--	---	---	--	--	--	--	--	--	--	--

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间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 0.03%（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	5,944,663.42	-	-	-	5,944,663.42
交易性金融资产	178,008.19	-	-	-535,825,990.38	536,003,998.57
应收清算款	-	-	-	165,162.20	165,162.20
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	6,122,671.61	-	-	-536,051,645.21	542,174,316.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	229,579.63	229,579.63
应付托管费	-	-	-	45,915.93	45,915.93

应交税费	-	-	-	0.23	0.23
其他负债	-	-	-	2,072,851.68	2,072,851.68
负债总计	-	-	-	2,348,347.47	2,348,347.47
利率敏感度缺口	6,122,671.61	-	-	-533,703,297.74	539,825,969.35
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	8,523,235.42	-	-	-	8,523,235.42
交易性金融资产	-	-	-	-696,749,684.06	696,749,684.06
资产总计	8,523,235.42	-	-	-696,749,684.06	705,272,919.48
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	327,289.54	327,289.54
应付托管费	-	-	-	65,457.90	65,457.90
其他负债	-	-	-	3,148,177.15	3,148,177.15
负债总计	-	-	-	3,540,924.59	3,540,924.59
利率敏感度缺口	8,523,235.42	-	-	-693,208,759.47	701,731,994.89

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	535,825,990.38	99.26	696,749,684.06	99.29
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	535,825,990.38	99.26	696,749,684.06	99.29

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%	16,133,911.75	23,058,263.51
	沪深 300 指数下降 5%	-16,133,911.75	-23,058,263.51

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	535,281,883.01	696,599,909.22
第二层次	460,865.77	-
第三层次	261,249.79	149,774.84
合计	536,003,998.57	696,749,684.06

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	535,825,990.38	98.83
	其中：股票	535,825,990.38	98.83
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	178,008.19	0.03
	其中：债券	178,008.19	0.03

	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,944,663.42	1.10
8	其他各项资产	225,654.83	0.04
9	合计	542,174,316.82	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	965,212.00	0.18
B	采矿业	26,024,252.00	4.82
C	制造业	390,582,178.03	72.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,613,885.00	1.23
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	23,488,279.18	4.35
G	交通运输、仓储和邮政业	37,243,327.00	6.90
H	住宿和餐饮业	3,909,001.20	0.72
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,665,271.00	2.72
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,937,952.00	4.25
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	2,889,708.00	0.54
R	文化、体育和娱乐业	3,500,724.00	0.65
S	综合	-	-
	合计	532,819,789.41	98.70

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	85,414.00	0.02
B	采矿业	215,550.00	0.04
C	制造业	1,017,975.59	0.19
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	282,857.58	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	8,117.00	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	1,122,397.80	0.21
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,170.00	0.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	43,251.00	0.01
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	2,538.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,930.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,006,200.97	0.56

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	000651	格力电器	1,482,900	55,608,750.00	10.30
2	601633	长城汽车	3,445,000	51,985,050.00	9.63
3	000100	TCL 科技	8,329,500	48,477,690.00	8.98
4	601600	中国铝业	4,275,200	35,142,144.00	6.51
5	601877	正泰电器	1,278,600	32,054,502.00	5.94
6	000708	中信特钢	1,588,200	20,043,084.00	3.71

7	600057	厦门象屿	2,454,600	13,303,932.00	2.46
8	688599	天合光能	884,387	12,487,544.44	2.31
9	600482	中国动力	375,800	12,326,240.00	2.28
10	601699	潞安环能	841,300	12,013,764.00	2.23
11	000933	神火股份	539,900	11,445,880.00	2.12
12	002027	分众传媒	1,990,500	9,634,020.00	1.78
13	600096	云天化	309,700	9,414,880.00	1.74
14	002532	天山铝业	854,100	9,164,493.00	1.70
15	603885	吉祥航空	865,000	8,900,850.00	1.65
16	600428	中远海特	906,800	7,082,108.00	1.31
17	601156	东航物流	434,800	7,008,976.00	1.30
18	002558	巨人网络	225,700	6,220,292.00	1.15
19	688819	天能股份	262,364	5,824,480.80	1.08
20	600256	广汇能源	1,156,300	5,712,122.00	1.06
21	603233	大参林	359,300	5,400,279.00	1.00
22	601216	君正集团	1,179,600	5,261,016.00	0.97
23	600961	株冶集团	160,000	5,182,400.00	0.96
24	600398	海澜之家	983,300	5,142,659.00	0.95
25	600623	华谊集团	627,400	5,063,118.00	0.94
26	600546	山煤国际	455,500	4,978,615.00	0.92
27	603444	吉比特	13,500	4,838,670.00	0.90
28	600295	鄂尔多斯	425,000	4,556,000.00	0.84
29	600380	健康元	473,100	4,456,602.00	0.83
30	603883	老百姓	355,900	3,900,664.00	0.72
31	603565	中谷物流	383,800	3,765,078.00	0.70
32	603939	益丰药房	207,000	3,721,860.00	0.69
33	000513	丽珠集团	127,900	3,695,031.00	0.68
34	600258	首旅酒店	324,060	3,538,735.20	0.66
35	601001	晋控煤业	190,900	3,319,751.00	0.61
36	002668	TCL 智家	292,870	3,244,999.60	0.60
37	000423	东阿阿胶	71,500	3,243,240.00	0.60
38	601083	锦江航运	290,900	2,891,546.00	0.54
39	300244	迪安诊断	154,200	2,889,708.00	0.54
40	603766	隆鑫通用	228,200	2,722,426.00	0.50
41	600131	国网信通	186,400	2,721,440.00	0.50
42	600033	福建高速	843,300	2,715,426.00	0.50
43	600535	天士力	198,900	2,631,447.00	0.49
44	600267	海正药业	259,400	2,622,534.00	0.49
45	002039	黔源电力	139,200	2,619,744.00	0.49
46	600729	重百集团	136,200	2,557,836.00	0.47
47	600004	白云机场	334,700	2,429,922.00	0.45
48	000957	中通客车	237,100	2,219,256.00	0.41
49	000719	中原传媒	192,300	2,197,989.00	0.41

50	001386	马可波罗	152,200	2,155,152.00	0.40
51	002004	华邦健康	547,200	2,150,496.00	0.40
52	000550	江铃汽车	132,400	2,147,528.00	0.40
53	600163	中闽能源	406,400	2,092,960.00	0.39
54	002727	一心堂	201,302	1,930,486.18	0.36
55	002563	森马服饰	347,900	1,753,416.00	0.32
56	000915	华特达因	61,900	1,752,389.00	0.32
57	603456	九洲药业	120,600	1,647,396.00	0.31
58	002773	康弘药业	80,000	1,636,000.00	0.30
59	600216	浙江医药	142,400	1,623,360.00	0.30
60	600167	联美控股	275,900	1,542,281.00	0.29
61	600211	西藏药业	41,200	1,540,468.00	0.29
62	601568	北元化工	438,000	1,489,200.00	0.28
63	000597	东北制药	341,400	1,447,536.00	0.27
64	600858	银座股份	325,900	1,437,219.00	0.27
65	002697	红旗连锁	344,200	1,431,872.00	0.27
66	000404	长虹华意	167,800	1,318,908.00	0.24
67	600551	时代出版	195,900	1,302,735.00	0.24
68	002043	兔宝宝	116,300	1,288,604.00	0.24
69	601008	连云港	317,100	1,274,742.00	0.24
70	000848	承德露露	161,300	1,193,620.00	0.22
71	600300	维维股份	420,000	1,184,400.00	0.22
72	000650	仁和药业	214,700	1,092,823.00	0.20
73	603508	思维列控	50,200	1,072,272.00	0.20
74	000019	深粮控股	177,600	1,006,992.00	0.19
75	688330	宏力达	28,893	977,450.19	0.18
76	001338	永顺泰	116,300	975,757.00	0.18
77	600449	宁夏建材	86,500	967,070.00	0.18
78	600897	厦门空港	63,200	922,720.00	0.17
79	300770	新媒股份	28,100	884,869.00	0.16
80	002390	信邦制药	326,100	851,121.00	0.16
81	300389	艾比森	62,500	801,250.00	0.15
82	600814	杭州解百	126,300	770,430.00	0.14
83	600351	亚宝药业	132,900	764,175.00	0.14
84	300228	富瑞特装	102,800	760,720.00	0.14
85	000788	北大医药	153,000	746,640.00	0.14
86	603367	辰欣药业	57,300	735,159.00	0.14
87	002918	蒙娜丽莎	72,400	727,620.00	0.13
88	300407	凯发电气	64,100	692,280.00	0.13
89	600218	全柴动力	88,200	636,804.00	0.12
90	603948	建业股份	24,000	578,400.00	0.11
91	600354	敦煌种业	115,600	550,256.00	0.10
92	600738	丽尚国潮	133,200	479,520.00	0.09

93	300970	华绿生物	22,700	414,956.00	0.08
94	300509	新美星	46,700	391,346.00	0.07
95	601007	金陵饭店	60,600	370,266.00	0.07
96	603080	新疆火炬	19,400	358,900.00	0.07
97	603192	汇得科技	18,800	318,472.00	0.06
98	001220	世盟股份	8,900	251,959.00	0.05

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	600717	天津港	232,300	903,647.00	0.17
2	001248	华润新能源	27,978	282,857.58	0.05
3	601728	中国电信	43,000	223,170.00	0.04
4	600938	中国海油	7,800	211,770.00	0.04
5	600104	上汽集团	19,200	187,392.00	0.03
6	601919	中远海控	8,630	114,433.80	0.02
7	002415	海康威视	2,800	95,760.00	0.02
8	301682	宏明电子	558	89,313.48	0.02
9	001399	惠科股份	3,088	85,630.24	0.02
10	002714	牧原股份	2,400	83,976.00	0.02
11	600019	宝钢股份	14,400	78,192.00	0.01
12	002352	顺丰控股	2,400	75,024.00	0.01
13	000568	泸州老窖	600	46,512.00	0.01
14	600415	小商品城	3,900	39,624.00	0.01
15	600352	浙江龙盛	3,000	36,330.00	0.01
16	000039	中集集团	4,400	35,684.00	0.01
17	002648	卫星化学	1,500	35,235.00	0.01
18	000959	首钢股份	9,200	32,292.00	0.01
19	600585	海螺水泥	1,800	30,510.00	0.01
20	603459	红板科技	330	27,825.60	0.01
21	603129	春风动力	100	25,580.00	0.00
22	002056	横店东磁	800	24,384.00	0.00
23	000807	云铝股份	1,000	22,140.00	0.00
24	601212	白银有色	4,200	21,336.00	0.00
25	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
26	601298	青岛港	2,200	17,710.00	0.00
27	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
28	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
29	603833	欧派家居	400	12,044.00	0.00
30	600219	南山铝业	2,800	11,172.00	0.00
31	000429	粤高速A	700	9,555.00	0.00
32	600873	梅花生物	1,200	8,820.00	0.00
33	600132	重庆啤酒	200	8,260.00	0.00
34	000521	长虹美菱	1,500	8,145.00	0.00

35	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
36	603816	顾家家居	300	6,708.00	0.00
37	600966	博汇纸业	1,300	6,214.00	0.00
38	601801	皖新传媒	1,000	4,930.00	0.00
39	601952	苏垦农发	600	4,494.00	0.00
40	301039	中集车辆	600	4,230.00	0.00
41	600758	辽宁能源	1,200	3,780.00	0.00
42	600662	外服控股	900	3,627.00	0.00
43	603173	福斯达	100	3,390.00	0.00
44	002462	嘉事堂	300	3,219.00	0.00
45	600420	国药现代	400	3,180.00	0.00
46	600785	新华百货	280	2,744.00	0.00
47	002206	海利得	500	2,585.00	0.00
48	000526	学大教育	100	2,538.00	0.00
49	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
50	000026	飞亚达	100	2,154.00	0.00
51	600125	铁龙物流	400	2,028.00	0.00
52	001206	依依股份	100	1,876.00	0.00
53	002950	奥美医疗	200	1,778.00	0.00
54	300967	晓鸣股份	100	1,438.00	0.00
55	603518	锦泓集团	200	1,430.00	0.00
56	603811	诚意药业	140	1,052.80	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	601728	中国电信	70,147,540.93	10.00
2	601633	长城汽车	63,392,933.51	9.03
3	601600	中国铝业	46,697,476.22	6.65
4	600938	中国海油	45,853,667.70	6.53
5	600104	上汽集团	41,399,262.00	5.90
6	601877	正泰电器	36,925,448.13	5.26
7	601919	中远海控	18,878,437.70	2.69
8	000100	TCL 科技	18,708,739.00	2.67
9	002415	海康威视	16,615,054.00	2.37
10	002352	顺丰控股	16,395,416.00	2.34
11	600057	厦门象屿	16,170,584.00	2.30
12	601699	潞安环能	15,968,326.00	2.28
13	600019	宝钢股份	13,962,143.00	1.99
14	688599	天合光能	13,661,186.28	1.95
15	000708	中信特钢	13,150,393.00	1.87
16	600482	中国动力	12,701,351.00	1.81
17	002027	分众传媒	11,535,619.00	1.64

18	002532	天山铝业	11,365,307.00	1.62
19	000651	格力电器	10,967,122.00	1.56
20	000933	神火股份	10,216,885.80	1.46

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	600938	中国海油	129,658,571.00	18.48
2	600104	上汽集团	87,062,891.00	12.41
3	601728	中国电信	72,467,798.24	10.33
4	601919	中远海控	49,133,646.16	7.00
5	600019	宝钢股份	33,966,921.00	4.84
6	601600	中国铝业	27,700,061.84	3.95
7	601877	正泰电器	25,357,675.00	3.61
8	601633	长城汽车	22,144,064.38	3.16
9	601212	白银有色	21,202,661.00	3.02
10	600352	浙江龙盛	19,518,634.44	2.78
11	600482	中国动力	18,682,289.00	2.66
12	002714	牧原股份	17,959,468.00	2.56
13	600415	小商品城	17,909,544.15	2.55
14	002415	海康威视	17,373,664.00	2.48
15	002352	顺丰控股	16,640,947.00	2.37
16	600585	海螺水泥	14,752,634.00	2.10
17	002648	卫星化学	12,712,437.00	1.81
18	000792	盐湖股份	12,295,521.00	1.75
19	000039	中集集团	12,273,156.00	1.75
20	000568	泸州老窖	11,387,982.04	1.62

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	799,958,603.47
卖出股票收入（成交）总额	860,937,885.80

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）	178,008.19	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	178,008.19	0.03

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	1,780	178,008.19	0.03

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

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	165,162.20
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	225,654.83

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	001248	华润新能源	198,004.35	0.04	新股锁定
1	001248	华润新能源	84,853.23	0.02	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
1,028	474,341.85	459,365,630.00	94.20	28,257,788.00	5.80

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（%）
	235,339,707.00	48.26

平安中证全指自由现金流 ETF 联接		
-----------------------	--	--

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 5 月 21 日） 基金份额总额	717,623,418.00
本报告期期初基金份额总额	573,623,418.00
本报告期基金总申购份额	365,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	451,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	487,623,418.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

托管人：本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

管理人：本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务的诉讼或仲裁。

托管人：本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用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：本报告期内托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
方正证券	5	1,660,194,530.67	100.00	308,639.89	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 (%)

方正证券	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

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	平安中证全指自由现金流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	关于新增山西证券股份有限公司为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流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 13 日
5	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
6	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 25 日
7	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
8	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 2025 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 30 日
9	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
10	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 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 04 月 22 日
11	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
12	关于新增广发证券股份有限公司为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流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 05 月 11 日
13	关于新增东吴证券股份有限公司为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流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 05 月 20 日

14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 09 日
15	关于新增招商证券股份有限公司为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流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 23 日
16	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 06 月 26 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日	383,240,207.00	129,711,900.00	277,612,400.00	235,339,707.00	48.26
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全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安中证全指自由现金流交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 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托管协议
- (4) 法律意见书

(5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

平安基金管理有限公司

2026 年 08 月 31 日