

平安中证 500 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：平安银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录..... 2

1.1 重要提示..... 2

1.2 目录..... 3

§ 2 基金简介..... 5

2.1 基金基本情况..... 5

2.2 基金产品说明..... 5

2.3 基金管理人和基金托管人..... 5

2.4 信息披露方式..... 6

2.5 其他相关资料..... 6

§ 3 主要财务指标和基金净值表现..... 6

3.1 主要会计数据和财务指标..... 6

3.2 基金净值表现..... 7

3.3 其他指标..... 7

§ 4 管理人报告..... 8

4.1 基金管理人及基金经理情况..... 8

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... 10

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... 10

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明..... 10

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... 11

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... 11

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... 11

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明..... 11

§ 5 托管人报告..... 12

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... 12

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）..... 12

6.1 资产负债表..... 12

6.2 利润表..... 13

6.3 净资产变动表..... 15

6.4 报表附注..... 16

§ 7 投资组合报告..... 39

7.1 期末基金资产组合情况..... 39

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... 39

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细..... 41

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... 53

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... 54

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细..... 55

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细..... 55

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	55
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§ 8 基金份额持有人信息.....	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	57
§ 9 开放式基金份额变动.....	57
§ 10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	60
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	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§ 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	138,786,121.00 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	李海波	潘琦
	联系电话	0755-88622632	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	133,968,202.18
本期利润	261,283,993.05
加权平均基金份额本期利 润	1.7930
本期加权平均净值利润率	20.33%
本期基金份额净值增长率	22.86%
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	333,459,048.90
期末可供分配基金份额利 润	2.4027
期末基金资产净值	1,352,030,130.20
期末基金份额净值	9.7418
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	82.50%

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）；

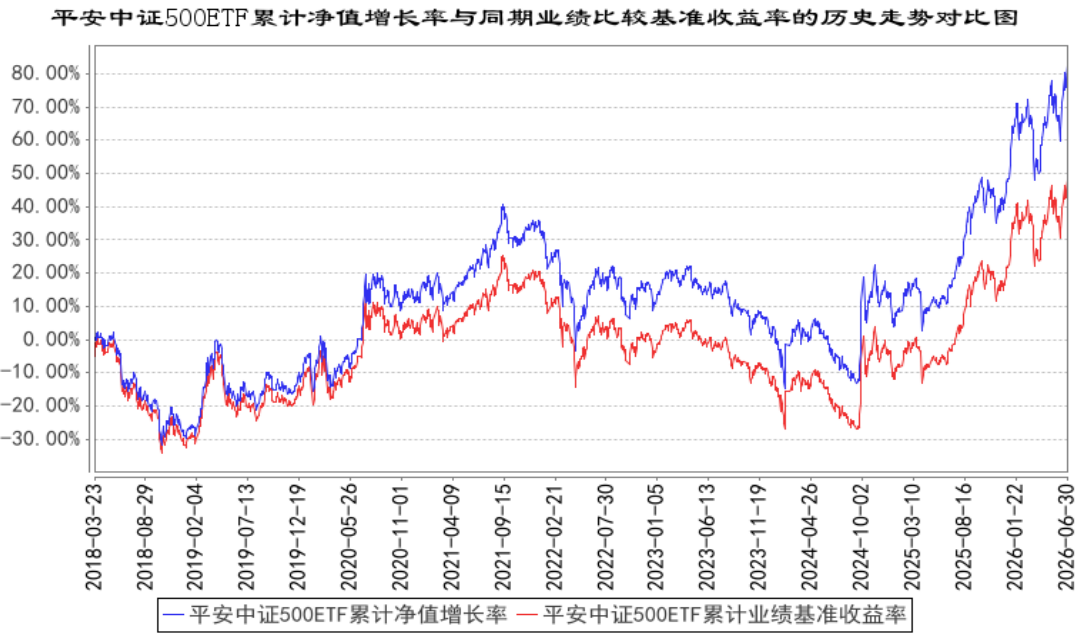
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	20.42%	1.65%	18.56%	1.65%	1.86%	0.00%
过去六个月	22.86%	1.66%	20.97%	1.66%	1.89%	0.00%
过去一年	57.18%	1.43%	52.68%	1.42%	4.50%	0.01%
过去三年	59.19%	1.47%	50.55%	1.49%	8.64%	-0.02%
过去五年	47.20%	1.35%	32.65%	1.36%	14.55%	-0.01%
过去七年	115.80%	1.35%	82.43%	1.36%	33.37%	-0.01%
自基金合同生效起至今	82.50%	1.39%	48.03%	1.41%	34.47%	-0.02%

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



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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李严	平安中证 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	-	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 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 0.69%，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 9.7418 元，本报告期基金份额净值增长率为 22.86%，业绩比较基准收益率为 20.97%。

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，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：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	16,505,210.14	24,380,919.85
结算备付金		5,568,480.71	8,577,053.55
存出保证金		3,035,143.74	3,815,529.11
交易性金融资产	6.4.7.2	1,328,558,794.68	1,071,773,077.39
其中：股票投资		1,328,383,786.63	1,071,773,077.39
基金投资		-	-
债券投资		175,008.05	-
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		-	378,248.72
应收股利		-	-

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	60,492.63	-
资产总计		1,353,728,121.90	1,108,924,828.62
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		834,601.54	1,706,323.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		524,478.14	425,275.07
应付托管费		104,895.64	85,054.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		46,531.27	39,826.22
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	187,485.11	3,030,682.82
负债合计		1,697,991.70	5,287,162.94
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	831,761,795.52	834,159,043.46
未分配利润	6.4.7.12	520,268,334.68	269,478,622.22
净资产合计		1,352,030,130.20	1,103,637,665.68
负债和净资产总计		1,353,728,121.90	1,108,924,828.62

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 9.7418 元，基金份额总额 138,786,121.00 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		265,273,172.89	36,259,925.34
1. 利息收入		138,898.44	87,154.65
其中：存款利息收入	6.4.7.13	138,898.44	87,154.65
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）		137,269,160.11	15,150,491.26
其中：股票投资收益	6.4.7.14	122,651,218.87	9,625,593.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	166,646.74	-
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	6,068,693.31	128,919.26
股利收益	6.4.7.19	8,382,601.19	5,395,978.08
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	127,315,790.87	20,936,015.94
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	549,323.47	86,263.49
减：二、营业总支出		3,989,179.84	2,029,084.52
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,182,956.80	1,516,526.41
其中：暂估管理人报 酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	636,591.33	303,305.26
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		21,856.07	466.53
8. 其他费用	6.4.7.23	147,775.64	208,786.32
三、利润总额（亏损 总额以“-”号填列）		261,283,993.05	34,230,840.82
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		261,283,993.05	34,230,840.82
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		261,283,993.05	34,230,840.82

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：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	834,159,043.46	269,478,622.22	1,103,637,665.68
二、本期期初净资产	834,159,043.46	269,478,622.22	1,103,637,665.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,397,247.94	250,789,712.46	248,392,464.52
（一）、综合收益总额	-	261,283,993.05	261,283,993.05
（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）	-2,397,247.94	-10,494,280.59	-12,891,528.53
其中：1. 基金申购款	184,588,077.75	79,107,202.19	263,695,279.94
2. 基金赎回款	-186,985,325.69	-89,601,482.78	-276,586,808.47
（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	831,761,795.52	520,268,334.68	1,352,030,130.20
项目	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	714,296,655.71	-9,817,170.01	704,479,485.70
二、本期期初净资产	714,296,655.71	-9,817,170.01	704,479,485.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填	-182,190,830.37	27,978,045.23	-154,212,785.14

列)			
(一)、综合收益总额	-	34,230,840.82	34,230,840.82
(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)	-182,190,830.37	-6,252,795.59	-188,443,625.96
其中:1.基金申购款	23,972,477.64	-1,119,813.97	22,852,663.67
2.基金赎回款	-206,163,308.01	-5,132,981.62	-211,296,289.63
(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	532,105,825.34	18,160,875.22	550,266,700.56

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 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》准予注册,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；主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，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当程序后，参与融资和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，本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 500 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%。

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、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	16,505,210.14
等于：本金	16,500,647.74
加：应计利息	4,562.40
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	16,505,210.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,080,487,573.44	-	1,328,383,786.63	247,896,213.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	175,000.00	8.05	175,008.05	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	175,000.00	8.05	175,008.05	0.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,080,662,573.44	8.05	1,328,558,794.68	247,896,213.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
----	------------------------

	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	22,062,880.00	-	-	
其中： 股指期货投资	22,062,880.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	22,062,880.00	-	-	

注：（1）衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始的合约价值。

（2）衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2609	IC2609	13.00	22,779,640.00	716,760.00
合计				716,760.00
减：可抵销期货暂收款				716,760.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	99,216.84
其中：交易所市场	99,216.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	88,268.27
合计	187,485.11

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	139,186,121.00	834,159,043.46
本期申购	30,800,000.00	184,588,077.75
本期赎回（以“-”号填列）	-31,200,000.00	-186,985,325.69
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	138,786,121.00	831,761,795.52

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	203,652,803.77	65,825,818.45	269,478,622.22
本期期初	203,652,803.77	65,825,818.45	269,478,622.22
本期利润	133,968,202.18	127,315,790.87	261,283,993.05
本期基金份额交易产生的变动数	-4,161,957.05	-6,332,323.54	-10,494,280.59
其中：基金申购款	49,125,840.62	29,981,361.57	79,107,202.19
基金赎回款	-53,287,797.67	-36,313,685.11	-89,601,482.78
本期已分配利润	-	-	-
本期末	333,459,048.90	186,809,285.78	520,268,334.68

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	79,301.74
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	58,949.87
其他	646.83
合计	138,898.44

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	102,566,707.82
股票投资收益——赎回差价收入	20,084,511.05
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	122,651,218.87

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	370,790,357.96
减：卖出股票成本总额	267,848,149.02
减：交易费用	375,501.12
买卖股票差价收入	102,566,707.82

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	276,586,808.47
减：现金支付赎回款总额	141,380,422.47
减：赎回股票成本总额	115,121,874.95
减：交易费用	-
赎回差价收入	20,084,511.05

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	24.73
债券投资收益——买卖债券（债转股及债	166,622.01

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	166,646.74

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	311,251.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	144,600.00
减：应计利息总额	17.43
减：交易费用	12.49
买卖债券差价收入	166,622.01

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	6,068,693.31

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	8,382,601.19
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	8,382,601.19

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	128,193,510.87
股票投资	128,193,510.87
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	-877,720.00
权证投资	-
期货投资	-877,720.00
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	127,315,790.87

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	549,323.47
合计	549,323.47

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	-
其他	69,424.36
合计	147,775.64

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
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

汇通”)	
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

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股票交易。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,182,956.80	1,516,526.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	30,205.28	26,247.60
应支付基金管理人的净管理费	3,152,751.52	1,490,278.81

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	636,591.33	303,305.26

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（%）
平 安 500ETF 联接基金	91,021,499.00	65.5840	96,230,199.00	69.1378
平安人寿	22,668,019.00	16.3331	22,668,019.00	16.2861

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	16,505,210.14	79,301.74	9,016,147.56	53,142.46

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	18,671	188,763.81	188,763.81	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	10.11	10.11	43,566	440,452.26	440,452.26	-
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	2026	6 个月	新	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

	科股份	年 6 月 16 日		股锁定						
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁定	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股锁定	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股锁定	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股锁定	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	9 个月	新股锁定	8.62	57.42	23,541	202,923.42	1,351,724.22	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁定	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股锁定	114.28	676.94	3,495	399,408.60	2,365,905.30	-
688818	电	2026	6 个月	新	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-

	科 蓝 天	年 2 月 3 日		股 锁 定						
688820	盛 合 晶 微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新 股 锁 定	19.68	141.49	1,749	34,420.32	247,466.01	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 张）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
113704	春 风 转 债	2026 年 6 月 11 日	1 个月 内 （ 含）	新 债 未 上 市	100.00	100.00	1,750	175,000.00	175,008.05	-

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 项暂停 转让	0.00	-	-	327,600	791,939.16	0.00	

注：截止 2025 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的

证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.02%（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时间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 个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日内可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。
本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合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 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	16,505,210.14	-	-	-	16,505,210.14
结算备付金	5,568,480.71	-	-	-	5,568,480.71
存出保证金	301,586.94	-	-	2,733,556.80	3,035,143.74
交易性金融资产	175,008.05	-	-	1,328,383,786.63	1,328,558,794.68
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	22,550,285.84	-	-	1,331,177,836.06	1,353,728,121.90
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	524,478.14	524,478.14
应付托管费	-	-	-	104,895.64	104,895.64
应付清算款	-	-	-	834,601.54	834,601.54

应交税费	-	-	-	46,531.27	46,531.27
其他负债	-	-	-	187,485.11	187,485.11
负债总计	-	-	-	1,697,991.70	1,697,991.70
利率敏感度缺口	22,550,285.84	-	-	1,329,479,844.36	1,352,030,130.20
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	24,380,919.85	-	-	-	24,380,919.85
结算备付金	8,577,053.55	-	-	-	8,577,053.55
存出保证金	279,561.11	-	-	3,535,968.00	3,815,529.11
交易性金融资产	-	-	-	1,071,773,077.39	1,071,773,077.39
应收清算款	-	-	-	378,248.72	378,248.72
资产总计	33,237,534.51	-	-	1,075,687,294.11	1,108,924,828.62
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	425,275.07	425,275.07
应付托管费	-	-	-	85,054.99	85,054.99
应付清算款	-	-	-	1,706,323.84	1,706,323.84
应交税费	-	-	-	39,826.22	39,826.22
其他负债	-	-	-	3,030,682.82	3,030,682.82
负债总计	-	-	-	5,287,162.94	5,287,162.94
利率敏感度缺口	33,237,534.51	-	-	1,070,400,131.17	1,103,637,665.68

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投资和资产支持证券投资（不包括可转债和可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净 值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	1,328,383,786.63	98.25	1,071,773,077.39	97.11
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	1,328,383,786.63	98.25	1,071,773,077.39	97.11

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%	85,818,966.35	65,848,869.92
	沪深 300 指数下降 5%	-85,818,966.35	-65,848,869.92

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定： 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,323,195,369.78	1,069,395,873.21
第二层次	804,224.12	-
第三层次	4,559,200.78	2,377,204.18
合计	1,328,558,794.68	1,071,773,077.39

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金调整公允价值计量层次转换时点的相关会计政策在前后各会计期间保持一致。 对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。
--

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,328,383,786.63	98.13
	其中：股票	1,328,383,786.63	98.13
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	175,008.05	0.01
	其中：债券	175,008.05	0.01
	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	22,073,690.85	1.63
8	其他各项资产	3,095,636.37	0.23
9	合计	1,353,728,121.90	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	4,319,988.00	0.32
B	采矿业	40,938,414.10	3.03
C	制造业	1,000,607,776.51	74.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,957,337.00	2.07
E	建筑业	7,142,254.00	0.53
F	批发和零售业	25,212,712.53	1.86
G	交通运输、仓储和邮政业	14,767,188.46	1.09
H	住宿和餐饮业	937,279.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,943,443.07	6.36
J	金融业	72,639,409.00	5.37
K	房地产业	5,244,567.00	0.39
L	租赁和商务服务业	13,635,204.52	1.01

M	科学研究和技术服务业	9,556,432.00	0.71
N	水利、环境和公共设施管理业	4,569,708.74	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,078,142.56	0.23
R	文化、体育和娱乐业	6,142,606.12	0.45
S	综合	-	-
	合计	1,322,692,462.61	97.83

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	5,062,107.95	0.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	629,216.07	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	0.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	5,691,324.02	0.42

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	688498	源杰科技	11,700	22,066,200.00	1.63
2	300604	长川科技	52,600	17,958,692.00	1.33
3	001309	德明利	18,800	17,726,520.00	1.31
4	688347	华虹宏力	48,300	16,243,290.00	1.20
5	688120	华海清科	46,780	15,071,580.40	1.11
6	002281	光迅科技	57,100	14,671,274.00	1.09
7	002008	大族激光	97,300	14,605,703.00	1.08
8	300857	协创数据	40,520	13,772,748.00	1.02
9	300136	信维通信	114,500	13,654,125.00	1.01
10	688361	中科飞测	29,000	12,470,000.00	0.92
11	300475	香农芯创	38,900	11,670,000.00	0.86
12	300223	北京君正	45,900	11,424,510.00	0.84
13	002436	兴森科技	200,800	10,230,760.00	0.76
14	300285	国瓷材料	94,196	9,719,143.28	0.72
15	300054	鼎龙股份	89,900	9,526,703.00	0.70
16	600105	永鼎股份	138,200	9,325,736.00	0.69
17	300666	江丰电子	25,000	9,215,000.00	0.68
18	688777	中控技术	74,851	8,794,992.50	0.65
19	688200	华峰测控	16,600	8,716,660.00	0.64
20	300757	罗博特科	13,900	8,604,100.00	0.64
21	688037	芯源微	19,100	8,385,855.00	0.62
22	000021	深科技	130,100	8,361,527.00	0.62
23	002851	麦格米特	48,200	8,058,076.00	0.60
24	601869	长飞光纤	14,400	7,860,960.00	0.58
25	300548	长芯博创	27,800	7,728,400.00	0.57
26	300346	南大光电	81,800	7,578,770.00	0.56
27	002409	雅克科技	33,700	7,565,650.00	0.56
28	300567	精测电子	23,200	7,368,320.00	0.54
29	688019	安集科技	21,530	7,308,573.80	0.54
30	600498	烽火通信	96,180	7,078,848.00	0.52
31	002407	多氟多	140,700	7,067,361.00	0.52
32	002185	华天科技	314,200	7,009,802.00	0.52

33	002138	顺络电子	95,203	6,959,339.30	0.51
34	688313	仕佳光子	37,400	6,905,910.00	0.51
35	688002	睿创微纳	44,506	6,884,633.14	0.51
36	300620	光库科技	17,700	6,694,140.00	0.50
37	300395	菲利华	49,900	6,673,127.00	0.49
38	600879	航天电子	311,900	6,640,351.00	0.49
39	300390	天华新能	68,720	6,426,007.20	0.48
40	688017	绿的谐波	15,200	6,351,472.00	0.47
41	688469	芯联集成	594,461	6,307,231.21	0.47
42	301526	国际复材	133,600	6,235,112.00	0.46
43	300373	扬杰科技	38,600	6,069,078.00	0.45
44	300058	蓝色光标	424,352	5,839,083.52	0.43
45	002273	水晶光电	164,209	5,826,135.32	0.43
46	300037	新宙邦	62,320	5,786,412.00	0.43
47	603256	宏和科技	21,400	5,678,062.00	0.42
48	688702	盛科通信	14,499	5,654,465.01	0.42
49	688172	燕东微	67,428	5,641,026.48	0.42
50	300751	迈为股份	19,800	5,592,708.00	0.41
51	605358	立昂微	70,040	5,435,104.00	0.40
52	301377	鼎泰高科	9,800	5,398,820.00	0.40
53	600988	赤峰黄金	196,500	5,171,880.00	0.38
54	688099	晶晨股份	49,842	5,128,741.80	0.38
55	605589	圣泉集团	80,100	5,091,957.00	0.38
56	002738	中矿资源	85,440	5,040,105.60	0.37
57	600885	宏发股份	144,993	5,000,808.57	0.37
58	000960	锡业股份	116,800	4,986,192.00	0.37
59	002126	银轮股份	100,000	4,980,000.00	0.37
60	600392	盛和资源	165,610	4,930,209.70	0.36
61	600601	方正科技	354,300	4,903,512.00	0.36
62	000831	中国稀土	87,600	4,860,924.00	0.36
63	001389	广合科技	20,000	4,745,000.00	0.35
64	600141	兴发集团	99,360	4,666,939.20	0.35
65	002812	恩捷股份	69,600	4,656,936.00	0.34
66	300570	太辰光	18,800	4,638,148.00	0.34
67	600378	昊华科技	60,900	4,590,642.00	0.34
68	301358	湖南裕能	59,700	4,529,439.00	0.34
69	601179	中国西电	302,755	4,517,104.60	0.33
70	688234	天岳先进	25,400	4,407,154.00	0.33
71	002195	岩山科技	669,808	4,380,544.32	0.32
72	600497	驰宏锌锗	358,000	4,335,380.00	0.32
73	002850	科达利	22,800	4,316,040.00	0.32
74	002261	拓维信息	149,000	4,173,490.00	0.31
75	688629	华丰科技	21,700	4,068,967.00	0.30

76	600711	盛屯矿业	365,000	4,004,050.00	0.30
77	002340	格林美	602,700	3,983,847.00	0.29
78	600909	华安证券	356,370	3,959,270.70	0.29
79	600143	金发科技	252,800	3,905,760.00	0.29
80	688052	纳芯微	13,459	3,880,364.29	0.29
81	300017	网宿科技	294,700	3,834,047.00	0.28
82	000783	长江证券	392,200	3,823,950.00	0.28
83	688411	海博思创	13,100	3,814,720.00	0.28
84	003031	中瓷电子	21,140	3,811,542.00	0.28
85	002821	凯莱英	23,500	3,807,000.00	0.28
86	002131	利欧股份	800,300	3,801,425.00	0.28
87	688027	国盾量子	7,400	3,729,674.00	0.28
88	600352	浙江龙盛	307,500	3,723,825.00	0.28
89	002203	海亮股份	162,907	3,722,424.95	0.28
90	601555	东吴证券	469,540	3,718,756.80	0.28
91	301200	大族数控	10,300	3,714,695.00	0.27
92	301611	珂玛科技	20,600	3,709,442.00	0.27
93	002966	苏州银行	528,380	3,677,524.80	0.27
94	601233	桐昆股份	168,800	3,654,520.00	0.27
95	603659	璞泰来	126,100	3,648,073.00	0.27
96	688220	翱捷科技	29,222	3,632,879.04	0.27
97	300339	润和软件	94,000	3,619,940.00	0.27
98	300759	康龙化成	122,000	3,529,460.00	0.26
99	688213	思特威	32,827	3,514,786.89	0.26
100	688578	艾力斯	32,005	3,494,946.00	0.26
101	688235	百济神州	13,618	3,467,278.98	0.26
102	603308	应流股份	56,000	3,382,400.00	0.25
103	688122	西部超导	53,560	3,364,103.60	0.25
104	002472	双环传动	80,500	3,341,555.00	0.25
105	300001	特锐德	87,075	3,294,047.25	0.24
106	601108	财通证券	379,500	3,282,675.00	0.24
107	002517	恺英网络	201,900	3,280,875.00	0.24
108	300207	欣旺达	172,600	3,277,674.00	0.24
109	603129	春风动力	12,700	3,248,660.00	0.24
110	300458	全志科技	82,320	3,248,347.20	0.24
111	002601	龙佰集团	197,100	3,248,208.00	0.24
112	002797	第一创业	491,100	3,226,527.00	0.24
113	601958	金钼股份	114,500	3,218,595.00	0.24
114	688385	复旦微电	44,390	3,164,563.10	0.23
115	688387	信科移动	159,195	3,158,428.80	0.23
116	688322	奥比中光	24,000	3,133,200.00	0.23
117	601198	东兴证券	229,000	3,112,110.00	0.23
118	601991	大唐发电	439,300	3,110,244.00	0.23

119	300115	长盈精密	111,100	3,104,134.00	0.23
120	002155	湖南黄金	129,180	3,083,526.60	0.23
121	688301	奕瑞科技	24,730	3,066,520.00	0.23
122	000703	恒逸石化	225,600	3,061,392.00	0.23
123	600563	法拉电子	15,990	3,050,892.00	0.23
124	002465	海格通信	231,500	2,956,255.00	0.22
125	300454	深信服	30,600	2,943,720.00	0.22
126	601665	齐鲁银行	508,900	2,936,353.00	0.22
127	603156	养元饮品	59,800	2,934,386.00	0.22
128	002056	横店东磁	96,000	2,926,080.00	0.22
129	603179	新泉股份	58,920	2,925,378.00	0.22
130	600884	杉杉股份	210,400	2,850,920.00	0.21
131	600707	彩虹股份	167,200	2,824,008.00	0.21
132	002402	和而泰	109,200	2,820,636.00	0.21
133	603650	彤程新材	28,700	2,812,026.00	0.21
134	300024	机器人	145,400	2,810,582.00	0.21
135	002130	沃尔核材	147,400	2,794,704.00	0.21
136	000060	中金岭南	368,500	2,789,545.00	0.21
137	002429	兆驰股份	267,400	2,778,286.00	0.21
138	601162	天风证券	824,200	2,777,554.00	0.21
139	688331	荣昌生物	21,300	2,774,538.00	0.21
140	603379	三美股份	36,120	2,741,146.80	0.20
141	000878	云南铜业	171,900	2,729,772.00	0.20
142	002432	九安医疗	38,600	2,728,248.00	0.20
143	688676	金盘科技	32,200	2,725,408.00	0.20
144	300012	华测检测	196,000	2,716,560.00	0.20
145	601099	太平洋	805,600	2,714,872.00	0.20
146	000893	亚钾国际	65,500	2,678,295.00	0.20
147	002271	东方雨虹	225,600	2,677,872.00	0.20
148	300496	中科创达	43,300	2,675,507.00	0.20
149	000034	神州数码	96,000	2,664,000.00	0.20
150	600109	国金证券	302,200	2,653,316.00	0.20
151	300623	捷捷微电	58,900	2,649,911.00	0.20
152	002444	巨星科技	84,900	2,640,390.00	0.20
153	002414	高德红外	199,100	2,640,066.00	0.20
154	002487	大金重工	45,300	2,626,041.00	0.19
155	002335	科华数据	61,715	2,619,801.75	0.19
156	600256	广汇能源	528,900	2,612,766.00	0.19
157	000733	振华科技	46,000	2,605,440.00	0.19
158	603688	石英股份	31,500	2,602,215.00	0.19
159	603979	金诚信	43,900	2,591,417.00	0.19
160	688266	泽璟制药	22,200	2,589,852.00	0.19
161	688728	格科微	122,752	2,582,702.08	0.19

162	600060	海信视像	92,433	2,576,107.71	0.19
163	301536	星辰科技	20,000	2,574,200.00	0.19
164	600298	安琪酵母	71,100	2,573,820.00	0.19
165	000661	长春高新	38,600	2,570,760.00	0.19
166	300474	景嘉微	42,450	2,567,376.00	0.19
167	300763	锦浪科技	28,106	2,539,377.10	0.19
168	002756	永兴材料	44,700	2,531,808.00	0.19
169	600021	上海电力	166,600	2,510,662.00	0.19
170	601128	常熟银行	430,913	2,507,913.66	0.19
171	601696	中银证券	197,100	2,493,315.00	0.18
172	601615	明阳智能	213,900	2,474,823.00	0.18
173	002078	太阳纸业	198,000	2,473,020.00	0.18
174	300748	金力永磁	79,980	2,467,383.00	0.18
175	600699	均胜电子	114,080	2,465,268.80	0.18
176	002025	航天电器	32,300	2,461,906.00	0.18
177	002157	正邦科技	874,400	2,457,064.00	0.18
178	300142	沃森生物	188,900	2,453,811.00	0.18
179	601577	长沙银行	281,200	2,449,252.00	0.18
180	300073	当升科技	50,800	2,440,432.00	0.18
180	603920	世运电路	50,800	2,440,432.00	0.18
181	300432	富临精工	121,000	2,430,890.00	0.18
182	300919	中伟新材	55,300	2,419,375.00	0.18
183	000423	东阿阿胶	53,100	2,408,616.00	0.18
184	603087	甘李药业	42,400	2,406,624.00	0.18
185	688343	云天励飞	29,300	2,392,638.00	0.18
186	603606	东方电缆	57,400	2,382,674.00	0.18
187	688608	恒玄科技	14,180	2,370,754.20	0.18
188	002252	上海莱士	545,200	2,366,168.00	0.18
189	688169	石头科技	24,800	2,355,256.00	0.17
190	688599	天合光能	166,031	2,344,357.72	0.17
191	300724	捷佳伟创	32,900	2,322,740.00	0.17
192	000728	国元证券	309,400	2,317,406.00	0.17
193	300953	震裕科技	17,100	2,286,270.00	0.17
194	688375	国博电子	21,382	2,230,142.60	0.16
195	002064	华峰化学	234,500	2,225,405.00	0.16
196	603119	浙江荣泰	33,500	2,222,390.00	0.16
197	000786	北新建材	120,500	2,179,845.00	0.16
198	001203	大中矿业	72,500	2,171,375.00	0.16
199	688018	乐鑫科技	16,940	2,166,964.80	0.16
200	002831	裕同科技	60,834	2,163,257.04	0.16
201	600171	上海贝岭	67,300	2,149,562.00	0.16
202	688180	君实生物	63,330	2,141,820.60	0.16
203	603290	斯达半导	13,900	2,125,866.00	0.16

204	300677	英科医疗	54,000	2,115,180.00	0.16
205	300383	光环新网	169,900	2,113,556.00	0.16
206	688187	时代电气	30,400	2,087,264.00	0.15
207	000519	中兵红箭	98,700	2,079,609.00	0.15
208	300679	电连技术	34,640	2,078,053.60	0.15
209	688188	柏楚电子	19,471	2,077,555.70	0.15
210	600177	雅戈尔	273,100	2,056,443.00	0.15
211	600516	方大炭素	332,840	2,053,622.80	0.15
212	300972	万辰集团	11,800	2,046,238.00	0.15
213	688065	凯赛生物	42,692	2,042,812.20	0.15
214	002673	西部证券	313,800	2,036,562.00	0.15
215	603160	汇顶科技	33,000	2,036,430.00	0.15
216	603806	福斯特	120,900	2,029,911.00	0.15
217	000559	万向钱潮	156,500	2,023,545.00	0.15
218	601699	潞安环能	141,400	2,019,192.00	0.15
219	600642	申能股份	231,200	2,018,376.00	0.15
220	000623	吉林敖东	113,200	2,007,036.00	0.15
221	002624	完美世界	160,350	1,991,547.00	0.15
222	600637	东方明珠	238,300	1,980,273.00	0.15
223	300699	光威复材	67,976	1,947,512.40	0.14
224	002085	万丰奥威	175,600	1,947,404.00	0.14
225	000983	山西焦煤	335,300	1,944,740.00	0.14
226	000750	国海证券	528,340	1,944,291.20	0.14
227	688568	中科星图	46,692	1,936,317.24	0.14
228	001696	宗申动力	92,800	1,931,168.00	0.14
229	002739	儒意电影	199,500	1,915,200.00	0.14
230	300558	贝达药业	29,400	1,913,058.00	0.14
231	002318	久立特材	80,000	1,912,000.00	0.14
232	603225	新凤鸣	96,820	1,902,513.00	0.14
233	603345	安井食品	23,700	1,900,503.00	0.14
234	600100	同方股份	277,100	1,898,135.00	0.14
235	600369	西南证券	471,000	1,893,420.00	0.14
236	002065	东华软件	265,000	1,892,100.00	0.14
237	600499	科达制造	136,000	1,876,800.00	0.14
238	002266	浙富控股	369,900	1,871,694.00	0.14
239	603444	吉比特	5,200	1,863,784.00	0.14
240	600595	中孚实业	331,400	1,862,468.00	0.14
241	300627	华测导航	65,560	1,861,904.00	0.14
242	600536	中国软件	66,198	1,861,487.76	0.14
243	002044	美年健康	369,900	1,860,597.00	0.14
244	688617	惠泰医疗	10,184	1,849,007.04	0.14
245	603699	纽威股份	36,700	1,846,010.00	0.14
246	688772	珠海冠宇	93,511	1,835,620.93	0.14

247	002223	鱼跃医疗	71,398	1,832,072.68	0.14
248	000155	川能动力	152,900	1,831,742.00	0.14
249	603596	伯特利	73,662	1,829,764.08	0.14
250	300002	神州泰岳	232,300	1,814,263.00	0.13
251	000400	许继电气	83,590	1,813,903.00	0.13
252	000629	钒钛股份	542,000	1,810,280.00	0.13
253	300003	乐普医疗	152,600	1,808,310.00	0.13
254	000032	深桑达 A	72,200	1,801,390.00	0.13
255	601016	节能风电	464,050	1,800,514.00	0.13
256	600985	淮北矿业	127,200	1,787,160.00	0.13
257	002430	杭氧股份	57,700	1,786,392.00	0.13
258	000415	渤海租赁	438,400	1,784,288.00	0.13
259	601212	白银有色	350,100	1,778,508.00	0.13
260	601216	君正集团	398,700	1,778,202.00	0.13
261	601717	中创智领	127,476	1,773,191.16	0.13
262	601997	贵阳银行	345,600	1,772,928.00	0.13
263	000683	博源化工	307,400	1,770,624.00	0.13
264	300487	蓝晓科技	30,050	1,768,442.50	0.13
265	000039	中集集团	217,830	1,766,601.30	0.13
266	600521	华海药业	121,400	1,748,160.00	0.13
267	603766	隆鑫通用	145,700	1,738,201.00	0.13
268	600862	中航高科	96,400	1,738,092.00	0.13
269	600704	物产中大	366,450	1,729,644.00	0.13
270	601001	晋控煤业	98,800	1,718,132.00	0.13
271	601990	南京证券	259,800	1,706,886.00	0.13
272	600863	华能蒙电	362,400	1,703,280.00	0.13
273	600312	平高电气	96,100	1,697,126.00	0.13
274	603077	和邦生物	730,600	1,694,992.00	0.13
275	000729	燕京啤酒	166,500	1,686,645.00	0.12
276	000050	深天马 A	169,600	1,680,736.00	0.12
277	002841	视源股份	48,600	1,678,158.00	0.12
278	600873	梅花生物	228,300	1,678,005.00	0.12
279	000967	盈峰环境	158,600	1,670,058.00	0.12
280	688692	达梦数据	6,800	1,661,172.00	0.12
281	688538	和辉光电	637,864	1,658,446.40	0.12
282	603605	珀莱雅	27,500	1,647,800.00	0.12
283	600765	中航重机	127,360	1,645,491.20	0.12
284	600332	白云山	82,100	1,645,284.00	0.12
285	688297	中无人机	39,575	1,644,341.25	0.12
286	000887	中鼎股份	91,500	1,636,935.00	0.12
287	600348	华阳股份	213,250	1,631,362.50	0.12
288	600153	建发股份	205,600	1,630,408.00	0.12
289	000830	鲁西化工	135,000	1,620,000.00	0.12

290	600166	福田汽车	554,800	1,614,468.00	0.12
291	002939	长城证券	191,700	1,598,778.00	0.12
292	688615	合合信息	14,040	1,587,924.00	0.12
293	000062	深圳华强	49,700	1,581,454.00	0.12
294	600901	江苏金租	273,700	1,573,775.00	0.12
295	002683	广东宏大	53,700	1,572,873.00	0.12
296	601611	中国核建	138,980	1,549,627.00	0.11
297	002410	广联达	189,800	1,548,768.00	0.11
298	002007	华兰生物	126,200	1,538,378.00	0.11
299	600737	中粮糖业	123,757	1,525,923.81	0.11
300	600363	联创光电	42,300	1,513,494.00	0.11
301	688582	芯动联科	23,200	1,508,000.00	0.11
302	002926	华西证券	183,500	1,499,195.00	0.11
303	600578	京能电力	232,400	1,498,980.00	0.11
304	000737	北方铜业	113,200	1,496,504.00	0.11
305	601799	星宇股份	16,500	1,495,230.00	0.11
306	600398	海澜之家	283,900	1,484,797.00	0.11
307	603298	杭叉集团	62,100	1,481,706.00	0.11
308	603728	鸣志电器	24,200	1,474,264.00	0.11
309	688114	华大智造	28,846	1,473,453.68	0.11
310	603568	伟明环保	95,523	1,469,143.74	0.11
311	601000	唐山港	350,220	1,453,413.00	0.11
312	000528	柳 工	192,400	1,452,620.00	0.11
313	600486	扬农化工	28,607	1,450,374.90	0.11
314	000591	太阳能	314,900	1,448,540.00	0.11
315	000921	海信家电	53,000	1,447,960.00	0.11
316	002603	以岭药业	96,000	1,440,000.00	0.11
317	000738	航发控制	77,800	1,422,962.00	0.11
318	603341	龙旗科技	33,300	1,414,917.00	0.10
319	600316	洪都航空	50,300	1,405,382.00	0.10
320	600435	北方导航	124,900	1,398,880.00	0.10
321	600008	首创环保	513,550	1,396,856.00	0.10
322	600998	九州通	297,801	1,396,686.69	0.10
323	600208	衢州发展	490,000	1,386,700.00	0.10
324	002152	广电运通	146,800	1,376,984.00	0.10
325	000932	华菱钢铁	396,120	1,374,536.40	0.10
326	600995	南网储能	111,700	1,373,910.00	0.10
327	600170	上海建工	613,900	1,362,858.00	0.10
328	000987	越秀资本	173,685	1,358,216.70	0.10
329	603486	科沃斯	26,700	1,355,025.00	0.10
330	600161	天坛生物	117,000	1,354,860.00	0.10
331	000997	新 大 陆	82,900	1,351,270.00	0.10
332	688248	南网科技	19,500	1,349,010.00	0.10

333	600820	隧道股份	257,400	1,341,054.00	0.10
334	600483	福能股份	131,300	1,337,947.00	0.10
335	600282	南钢股份	291,400	1,337,526.00	0.10
336	601106	中国一重	405,100	1,336,830.00	0.10
337	000009	中国宝安	213,378	1,329,344.94	0.10
338	603885	吉祥航空	128,920	1,326,586.80	0.10
339	000951	中国重汽	67,900	1,324,729.00	0.10
340	688778	厦钨新能	24,308	1,322,355.20	0.10
341	002262	恩华药业	70,100	1,314,375.00	0.10
342	002500	山西证券	246,870	1,273,849.20	0.09
343	600583	海油工程	253,200	1,273,596.00	0.09
344	603816	顾家家居	56,900	1,272,284.00	0.09
345	600546	山煤国际	115,900	1,266,787.00	0.09
346	688295	中复神鹰	20,700	1,253,178.00	0.09
347	603338	浙江鼎力	29,476	1,252,730.00	0.09
348	601666	平煤股份	175,100	1,251,965.00	0.09
349	603939	益丰药房	69,508	1,249,753.84	0.09
350	688166	博瑞医药	35,633	1,247,511.33	0.09
351	000582	北部湾港	116,100	1,245,753.00	0.09
352	600562	国睿科技	58,600	1,243,492.00	0.09
353	600685	中船防务	48,600	1,236,384.00	0.09
354	003022	联泓新科	47,500	1,230,250.00	0.09
355	600038	中直股份	48,500	1,226,565.00	0.09
356	688318	财富趋势	17,160	1,223,679.60	0.09
357	600329	达仁堂	32,800	1,220,816.00	0.09
358	600763	通策医疗	35,937	1,217,545.56	0.09
359	603565	中谷物流	123,900	1,215,459.00	0.09
360	600390	五矿资本	265,600	1,211,136.00	0.09
361	601567	三星电气	79,900	1,193,706.00	0.09
362	601399	国机重装	340,900	1,193,150.00	0.09
363	000513	丽珠集团	41,286	1,192,752.54	0.09
364	601156	东航物流	73,900	1,191,268.00	0.09
365	000723	美锦能源	355,500	1,190,925.00	0.09
366	002312	川发龙蟒	129,400	1,186,598.00	0.09
367	600380	健康元	125,672	1,183,830.24	0.09
368	600602	云赛智联	73,500	1,181,880.00	0.09
369	300676	华大基因	33,700	1,181,522.00	0.09
370	601865	福莱特	112,400	1,181,324.00	0.09
371	600132	重庆啤酒	28,500	1,177,050.00	0.09
372	600511	国药股份	44,700	1,163,988.00	0.09
373	688281	华秦科技	22,960	1,153,280.80	0.09
374	600906	财达证券	153,600	1,145,856.00	0.08
375	601236	红塔证券	167,100	1,139,622.00	0.08

376	000739	普洛药业	68,081	1,134,229.46	0.08
377	600535	天士力	85,500	1,131,165.00	0.08
378	600816	建元信托	460,300	1,123,132.00	0.08
379	600977	中国电影	86,400	1,116,288.00	0.08
380	000598	兴蓉环境	172,700	1,108,734.00	0.08
381	002299	圣农发展	72,900	1,105,164.00	0.08
382	688336	三生国健	20,590	1,093,329.00	0.08
383	300100	双林股份	39,200	1,088,976.00	0.08
384	600970	中材国际	152,500	1,087,325.00	0.08
385	002244	滨江集团	142,500	1,083,000.00	0.08
386	300735	光弘科技	47,600	1,082,424.00	0.08
387	300144	宋城演艺	186,200	1,081,822.00	0.08
388	601155	新城控股	104,500	1,072,170.00	0.08
389	300718	长盛轴承	17,500	1,066,975.00	0.08
390	600967	内蒙一机	98,100	1,064,385.00	0.08
391	002120	韵达股份	166,900	1,061,484.00	0.08
392	000883	湖北能源	243,900	1,053,648.00	0.08
393	300146	汤臣倍健	116,100	1,049,544.00	0.08
394	000800	一汽解放	174,500	1,038,275.00	0.08
395	600131	国网信通	70,800	1,033,680.00	0.08
396	002568	百润股份	60,580	1,025,013.60	0.08
397	688278	特宝生物	18,800	1,022,720.00	0.08
398	601866	中远海发	461,046	1,018,911.66	0.08
399	601608	中信重工	212,200	1,012,194.00	0.07
400	000027	深圳能源	162,380	1,006,756.00	0.07
401	688363	华熙生物	28,000	1,001,560.00	0.07
402	603737	三棵树	41,290	995,089.00	0.07
403	600095	湘财股份	131,800	992,454.00	0.07
404	600801	华新建材	63,520	990,912.00	0.07
405	601118	海南橡胶	200,400	985,968.00	0.07
406	000088	盐田港	239,100	977,919.00	0.07
407	002583	海能达	126,200	970,478.00	0.07
408	600566	济川药业	43,700	969,703.00	0.07
409	003021	兆威机电	11,100	969,585.00	0.07
410	600126	杭钢股份	156,927	961,962.51	0.07
411	603000	人民网	64,000	946,560.00	0.07
412	600871	石化油服	461,800	937,454.00	0.07
413	600754	锦江酒店	52,100	937,279.00	0.07
414	603589	口子窖	49,500	924,660.00	0.07
415	002984	森麒麟	70,700	924,049.00	0.07
416	600655	豫园股份	224,300	921,873.00	0.07
417	000709	河钢股份	474,600	920,724.00	0.07
418	000825	太钢不锈	268,100	914,221.00	0.07

419	600517	国网英大	194,700	911,196.00	0.07
420	600350	山东高速	80,100	891,513.00	0.07
421	688192	迪哲医药	22,200	886,446.00	0.07
422	603858	步长制药	60,700	886,220.00	0.07
423	301606	绿联科技	14,500	884,790.00	0.07
424	001286	陕西能源	87,200	884,208.00	0.07
425	600598	北大荒	80,900	876,956.00	0.06
426	601598	中国外运	176,200	873,952.00	0.06
427	002423	中粮资本	105,800	870,734.00	0.06
428	603899	晨光股份	41,700	860,271.00	0.06
429	002773	康弘药业	41,900	856,855.00	0.06
430	688349	三一重能	56,367	855,651.06	0.06
431	600663	陆家嘴	136,000	854,080.00	0.06
432	600004	白云机场	117,500	853,050.00	0.06
433	600582	天地科技	191,500	852,175.00	0.06
434	600848	上海临港	113,300	848,617.00	0.06
435	601966	玲珑轮胎	82,700	842,713.00	0.06
436	688709	成都华微	22,100	841,789.00	0.06
437	000429	粤高速 A	60,400	824,460.00	0.06
438	601098	中南传媒	81,693	803,859.12	0.06
439	688563	航材股份	15,600	799,188.00	0.06
440	600062	华润双鹤	49,220	789,488.80	0.06
441	603233	大参林	52,500	789,075.00	0.06
442	300957	贝泰妮	24,900	784,599.00	0.06
443	003035	南网能源	134,000	779,880.00	0.06
444	002508	老板电器	53,300	779,246.00	0.06
445	600968	海油发展	233,900	778,887.00	0.06
446	601928	凤凰传媒	88,300	776,157.00	0.06
447	600688	上海石化	259,600	760,628.00	0.06
448	601808	中海油服	70,000	756,700.00	0.06
449	688561	奇安信	31,521	755,873.58	0.06
450	002670	国盛证券	67,403	741,433.00	0.05
451	600295	鄂尔多斯	69,100	740,752.00	0.05
452	002032	苏泊尔	18,500	732,600.00	0.05
453	300888	稳健医疗	26,160	732,218.40	0.05
454	688708	佳驰科技	14,300	726,440.00	0.05
455	600098	广州发展	121,300	716,883.00	0.05
456	688425	铁建重工	178,306	716,790.12	0.05
457	000537	绿发电力	97,700	714,187.00	0.05
458	000539	粤电力 A	100,900	687,129.00	0.05
459	600808	马钢股份	273,600	684,000.00	0.05
460	600292	电投水电	56,700	682,668.00	0.05
461	002153	石基信息	94,146	680,675.58	0.05

462	600377	宁沪高速	58,500	676,845.00	0.05
463	601298	青岛港	83,000	668,150.00	0.05
464	603833	欧派家居	21,000	632,310.00	0.05
465	002265	建设工业	35,600	619,440.00	0.05
466	600339	中油工程	198,000	607,860.00	0.04
467	002608	江苏国信	87,800	605,820.00	0.04
468	000959	首钢股份	171,600	602,316.00	0.04
469	301301	川宁生物	74,600	592,324.00	0.04
470	603658	安图生物	20,400	592,008.00	0.04
471	603529	爱玛科技	30,000	585,300.00	0.04
472	000785	居然智家	290,000	580,000.00	0.04
473	600032	浙江新能	81,600	575,280.00	0.04
474	601139	深圳燃气	101,350	573,641.00	0.04
475	603786	科博达	13,900	568,649.00	0.04
476	301498	乖宝宠物	14,000	568,260.00	0.04
477	600764	中国海防	32,000	557,760.00	0.04
478	688520	神州细胞	16,000	547,360.00	0.04
479	300140	节能环保	109,900	546,203.00	0.04
480	000937	冀中能源	135,200	538,096.00	0.04
481	688475	萤石网络	19,000	519,650.00	0.04
482	603049	中策橡胶	11,500	515,315.00	0.04
483	603175	超颖电子	5,700	507,813.00	0.04
484	601228	广州港	173,200	488,424.00	0.04
485	000898	鞍钢股份	259,600	485,452.00	0.04
486	601019	山东出版	70,200	449,280.00	0.03
487	002945	华林证券	32,300	433,789.00	0.03
488	600927	永安期货	34,700	432,015.00	0.03
489	601112	振石股份	22,500	410,175.00	0.03
490	688819	天能股份	16,665	369,963.00	0.03
491	600299	安迪苏	46,600	365,810.00	0.03
492	002461	珠江啤酒	47,800	361,846.00	0.03
493	603092	德力佳	4,300	232,071.00	0.02
494	001386	马可波罗	12,500	177,000.00	0.01
495	001221	悍高集团	3,700	148,814.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688795	摩尔线程	3,495	2,365,905.30	0.17
2	688783	西安奕材	23,541	1,351,724.22	0.10
3	001248	华润新能源	62,237	629,216.07	0.05
4	688785	恒运昌	1,155	556,632.57	0.04
5	688820	盛合晶微	1,749	247,466.01	0.02

6	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
7	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
8	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
9	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
10	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
11	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
12	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
13	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
14	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
15	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
16	400174	中天 3	327,600	0.00	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	688498	源杰科技	17,388,805.21	1.58
2	001309	德明利	12,295,299.00	1.11
3	300475	香农芯创	7,488,349.00	0.68
4	300666	江丰电子	7,426,321.00	0.67
5	600105	永鼎股份	7,271,878.00	0.66
6	601869	长飞光纤	6,550,722.00	0.59
7	300548	长芯博创	6,462,333.00	0.59
8	688313	仕佳光子	5,783,913.09	0.52
9	002407	多氟多	5,659,804.22	0.51
10	300620	光库科技	5,274,070.00	0.48
11	688200	华峰测控	5,092,692.62	0.46
12	600711	盛屯矿业	4,794,138.00	0.43
13	002812	恩捷股份	4,716,812.00	0.43
14	603256	宏和科技	4,589,970.00	0.42
15	301377	鼎泰高科	4,482,562.00	0.41
16	688037	芯源微	4,451,643.75	0.40
17	301526	国际复材	3,764,188.00	0.34
18	688411	海博思创	3,513,569.70	0.32
19	600256	广汇能源	3,506,119.00	0.32
20	603308	应流股份	3,474,343.00	0.31

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	600487	亨通光电	23,216,362.00	2.10

2	301308	江波龙	14,003,033.00	1.27
3	688525	佰维存储	13,864,527.42	1.26
4	002353	杰瑞股份	12,744,683.60	1.15
5	002156	通富微电	10,103,656.24	0.92
6	000657	中钨高新	10,042,666.00	0.91
7	600549	厦门钨业	8,974,672.06	0.81
8	000426	兴业银锡	8,270,586.00	0.75
9	002202	金风科技	7,932,770.00	0.72
10	002837	英维克	7,660,652.37	0.69
11	300450	先导智能	7,108,180.00	0.64
12	000933	神火股份	6,471,049.00	0.59
13	601168	西部矿业	6,405,137.00	0.58
14	600673	东阳光	5,886,727.00	0.53
15	002080	中材科技	5,860,236.86	0.53
16	002532	天山铝业	5,800,561.00	0.53
17	600118	中国卫星	5,618,661.00	0.51
18	002558	巨人网络	5,214,084.00	0.47
19	002128	电投能源	4,750,486.00	0.43
20	600096	云天化	4,635,773.00	0.42

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	391,419,576.95
卖出股票收入（成交）总额	370,790,357.96

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）	175,008.05	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	175,008.05	0.01

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	1,750	175,008.05	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

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	3,035,143.74
2	应收清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	—

6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	3,095,636.37

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688795	摩尔线程	2,365,905.30	0.17	新股锁定
2	688783	西安奕材	1,351,724.22	0.10	新股锁定
3	001248	华润新能源	440,452.26	0.03	新股锁定
3	001248	华润新能源	188,763.81	0.01	新股未上市
4	688820	盛合晶微	247,466.01	0.02	新股锁定
5	688785	恒运昌	53,725.40	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
701	197,983.05	136,355,828.00	98.25	2,430,293.00	1.75

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
平安 500ETF 联接基金	91,021,499.00	65.58

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（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	139,186,121.00
本报告期基金总申购份额	30,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	31,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	138,786,121.00

§ 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

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：2026 年 6 月 23 日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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：本报告期内，无涉及本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，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
长江证券	2	481,570,087.40	63.33	89,525.82	63.33	
国泰海通证券	2	278,800,154.30	36.67	51,830.56	36.67	
中信证券	2	4,102.16	0.00	0.76	0.00	
财通证券	2	-	-	-	-	
东北证券	2	-	-	-	-	
东方证券	1	-	-	-	-	
东吴证券	2	-	-	-	-	
光大证券	1	-	-	-	-	
广发证券	1	-	-	-	-	
国联民生证券	1	-	-	-	-	
国盛证券	1	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
华创证券	2	-	-	-	-	
华泰证券	2	-	-	-	-	
华源证券	1	-	-	-	-	
金融街证券	2	-	-	-	-	
开源证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	

天风证券	2	-	-	-	-	
万联证券	2	-	-	-	-	
西部证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	1	-	-	-	-	
英大证券	1	-	-	-	-	
中金公司	1	-	-	-	-	
中银国际 证券	1	-	-	-	-	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- （1）财务状况良好
- （2）经营行为规范
- （3）合规风控能力较高

2、基金管理人根据上述标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

3、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	311,251.93	100.00	-	-	-	-
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

华泰证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
金融街证 券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
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 2025 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 01 月 22 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下 ETF 基金新增华福证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 03 月 16 日
3	平安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
4	平安中证 500 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 31 日
5	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 04 月 22 日
6	平安基金管理有限公司对外行使投票表决权（2025 年度）情况信息披露	中国证监会规定报刊及网站	2026 年 04 月 30 日
7	平安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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	96,230,199.00	66,332,900.00	71,541,600.00	91,021,499.00	65.58
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 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）

2026 年 08 月 31 日