

平安中证 500 指数增强型发起式证券投资
基金
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2026 年 03 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 03 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	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	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
§ 5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§ 8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 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	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
8.6 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	68
8.7 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	68
8.8 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	69
8.9 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	69
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
8.12 投资组合报告附注	69
§ 9 基金份额持有人信息	70
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.3 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	71
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	71
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	71
§ 10 开放式基金份额变动	71
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 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	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	77
12.1 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	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§ 13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	平安中证 500 指数增强	
基金主代码	009336	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 27 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	17,838,749.82 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	009336	009337
报告期末下属分级基金的份额总额	8,344,446.59 份	9,494,303.23 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在参考标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波	许俊
	联系电话	0755-88622632	010-66596688
	电子邮箱	funds@pingan.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025 年		2024 年		2023 年	
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
本期已实现收益	2,054,658.02	2,448,879.25	686,241.28	629,751.58	2,367,116.52	2,296,209.91
本期利润	2,426,049.87	3,029,057.89	751,186.97	952,827.69	2,163,525.01	2,229,311.42
加权平均基金份额本期利润	0.2279	0.2262	0.0487	0.0617	-0.1365	-0.1431
本期加权平均净值利润率	20.20%	20.64%	4.99%	6.45%	-12.22%	-13.01%
本期基金份额净值增长率	23.75%	23.13%	4.36%	3.84%	-13.13%	-13.57%

3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	期末可供分配利润	2,410,856.11	2,403,187.65	689,237.52	317,536.89	-28,331.16
期末可供分配基金份额利润	0.2889	0.2531	0.0415	0.0177	-0.0020	-0.0199
期末基金资产净值	10,755,302.70	11,897,490.88	17,279,759.68	18,265,250.69	14,436,530.75	14,049,429.03
期末基金份额净值	1.2889	1.2531	1.0415	1.0177	0.9980	0.9801
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
	基金份额累计净值增长率	28.89%	25.31%	4.15%	1.77%	-0.20%

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

平安中证 500 指数增强 A

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	2.51%	0.68%	0.71%	1.18%	1.80%	-0.50%
过去六个月	16.35%	0.72%	24.81%	1.11%	-8.46%	-0.39%
过去一年	23.75%	0.88%	28.81%	1.20%	-5.06%	-0.32%
过去三年	12.19%	1.10%	26.25%	1.30%	-14.06%	-0.20%
过去五年	5.28%	1.13%	16.99%	1.23%	-11.71%	-0.10%

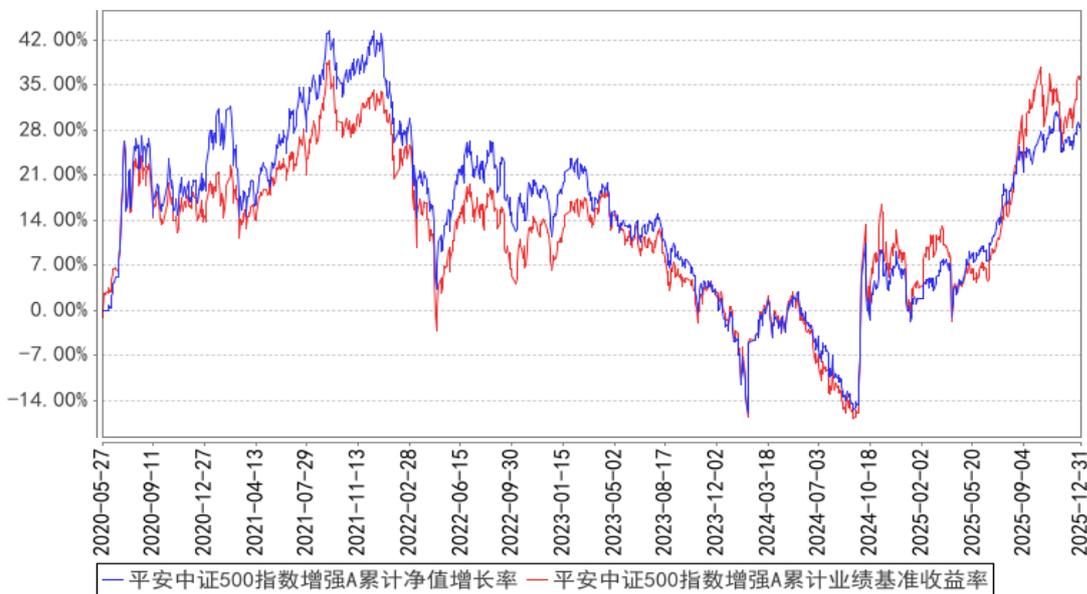
自基金合同生效起至今	28.89%	1.16%	36.44%	1.24%	-7.55%	-0.08%
------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

平安中证 500 指数增强 C

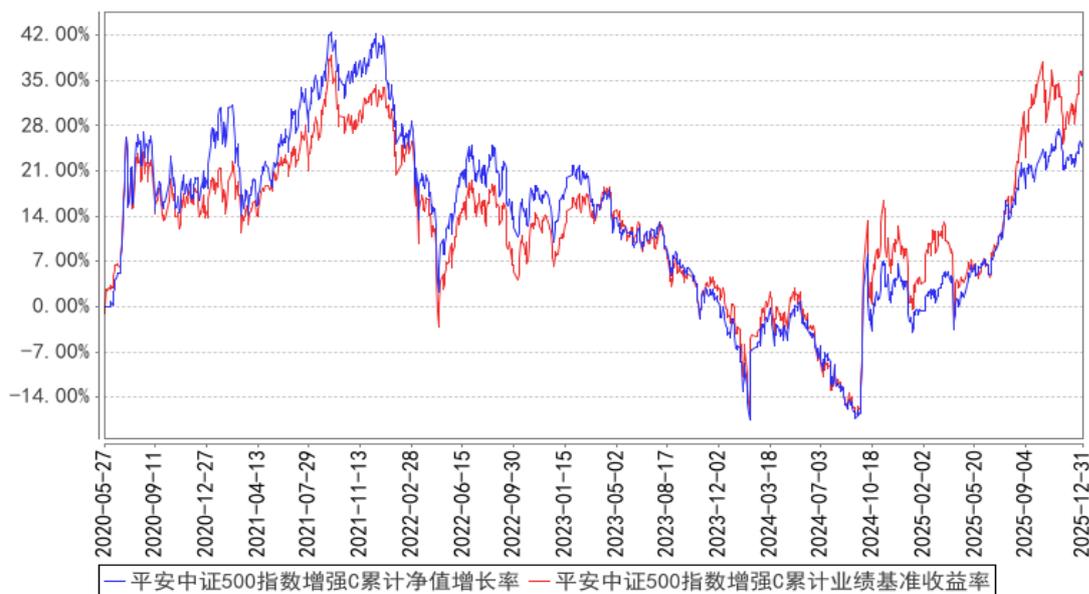
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.39%	0.68%	0.71%	1.18%	1.68%	-0.50%
过去六个月	16.05%	0.72%	24.81%	1.11%	-8.76%	-0.39%
过去一年	23.13%	0.88%	28.81%	1.20%	-5.68%	-0.32%
过去三年	10.50%	1.10%	26.25%	1.30%	-15.75%	-0.20%
过去五年	2.65%	1.13%	16.99%	1.23%	-14.34%	-0.10%
自基金合同生效起至今	25.31%	1.16%	36.44%	1.24%	-11.13%	-0.08%

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500指数增强A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



平安中证500指数增强C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

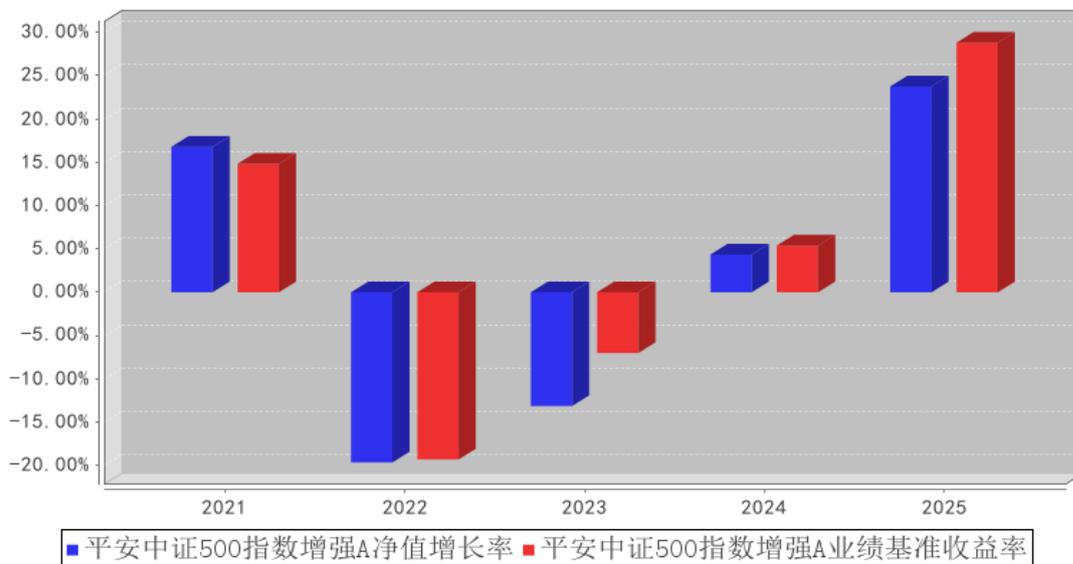


注：1、本基金合同于 2020 年 05 月 27 日生效；

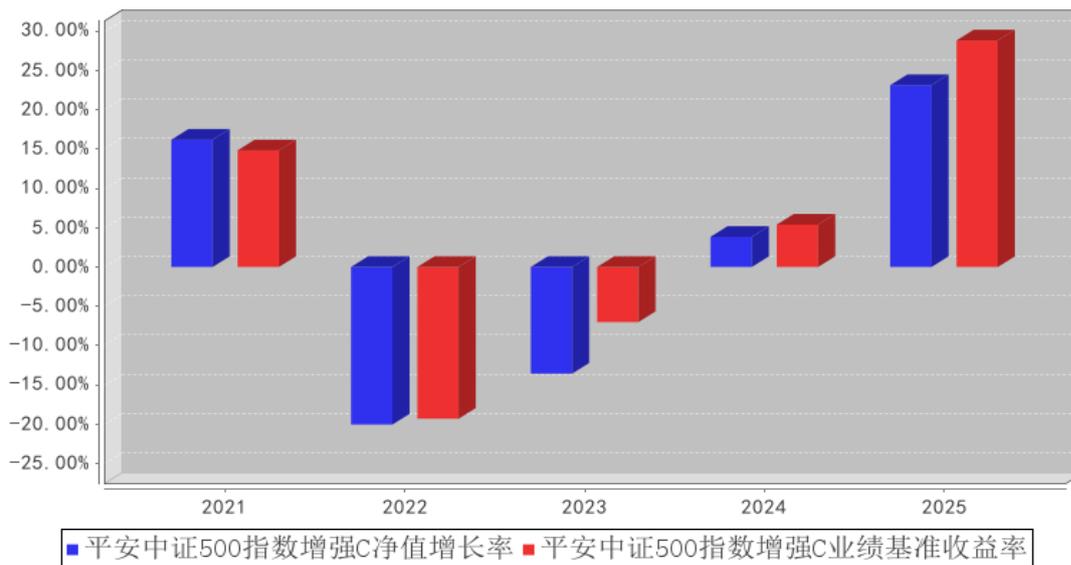
2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安中证500指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安中证500指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金基金合同于 2020 年 05 月 27 日正式生效。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过往三年无利润分配情况。

§ 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 2025 年末，公司综合管理规模近 9000 亿元，公募管理规模 7176 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、长期业绩优异的超 160 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		
俞瑶	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理	2021 年 11 月 4 日	-	14 年	俞瑶女士，香港科技大学投资管理专业硕士，曾先后担任南京证券股份有限公司投资顾问、深圳市万博汇投资控股有限公司运营风险管理经理、天风证券股份有限公司项目经理。2015 年 9 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资经理，现任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、平安港股通科技精选混合型证券投资基金、平安资源精选混合型发起式证券投资基金、平安高端装备混合型发起式证券投资基金、平安恒生指数增强型证券投资基金、平安新能源精选混合型发起式证券投资基金、平安科技精选混合型发起式证券投资基金、平安数字经济精选混合型发起式证券投资基金基金经理。
丁琳	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理	2024 年 7 月 26 日	2025 年 8 月 4 日	14 年	丁琳女士，厦门大学国际金融专业硕士，曾担任摩根士丹利华鑫基金管理有限公司投资经理，2020 年 4 月加入平安基金管理有限公司，现担任平安消费精选混合型证券投资基金、平安港股通红利精选混合型发起式证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安港股通红利优选混合型证券投资基金、平安鑫盛混合型发起式证券投资基金、平安港股通成长精选混合型证券投资基金基金经理。
王瑞炮	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理	2023 年 8 月 9 日	2025 年 1 月 13 日	5 年	王瑞炮先生，上海交通大学应用统计专业硕士研究生。曾担任平安科技有限责任公司智能投研部算法研究员。2020 年 6 月加入平安基金管理有限公司，担任 MOM 研究员，现担任平安添悦债券型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、自 2026 年 2 月 2 日起，俞瑶不再担任本基金基金经理。

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《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、风控负责人、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，A 股市场整体上呈现出稳步上行的趋势，全年中证 500 指数涨幅为 30.39%。一季度前两个月呈震荡上行走势，三月份受到市场风格切换和风险偏好下降影响，呈现弱势震荡下行走势。四月市场先因外围关税政策扰动大幅下跌，之后便开启了稳步上行走势。下半年市场风险偏好抬升明显，交易量也稳步抬升维持高位。从板块来看，AI 算力方向呈现趋势性行情，AI 应用、机器人、创新药、固态电池、可控核聚变、商业航天等主题行情也反复活跃。

本基金采用量化多因子投资策略，从盈利成长、盈利质量、价格动量、分析师预期等维度，构建有效的选股阿尔法因子，控制相对基准指数的风险敞口与跟踪误差，最大化预期收益求解得到目标组合，并通过组合交易模型降低交易成本。由于是从公司基本面角度进行选股，相对基准指数的行业和风格偏离较小，所以本基金的股票交易换手率较低，通过长期持有优质个股，有效地降低了交易成本，在控制跟踪误差较小的同时，争取实现较高的超额收益与信息比率，给投资者带来相对基准指数更好的回报。

本基金跟踪的中证 500 指数，整体偏向有色、煤炭、建材、电力设备新能源、基础化工、医药、军工等行业，以沪深两市中盘市值股票为主。报告期内，产品风格整体偏向于稳健低估值，超配电力及公用事业、非银、交运等板块，整体低配 TMT 相关行业。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安中证 500 指数增强 A 的基金份额净值 1.2889 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.75%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%；截至本报告期末平安中证 500 指数增强 C 的基金份额净值 1.2531 元，本报告期基金份额净值增长率为 23.13%，同期业绩比较基准收益率为 28.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年的证券市场是典型的结构性情行，上涨的一极是黄金等各类贵金属，上涨的另一极是 2025 年初 deepseek 引发的科技叙事和海外 ai 浪潮带来的相关公司实际业绩相叠加、共同造就的科技行情。

这上涨的两极可能是投资人在这个不确定的时代里的情绪和梦想的最真实写照。

展望 2026 年，美国特朗普政府的执政举措仍然会是世界不确定性的最大来源。美国正试图解决其国内面临的两极化的深刻矛盾。

作为世界第一强国，美国解决这个矛盾的过程，也是其重塑自己过去制定的全球秩序的过程。这个重塑期必然也是一个政策来回摇摆的周期。

由此引发的各种宏观事件会层出不穷，甚至完全无法被合理定价。人们的预期也失去了锚点，变得十分混乱，甚至可以说唯一能达成的共识就是对混乱的预期。

在这种外部环境存在高度不确定性的情况下，国内内需消费不足、收入分配不平衡、老龄化少子化等问题亟待解决。

最高决策层对这些问题及时给与了回应，强调“坚持内需主导，建设强大国内市场。深入实施提振消费专项行动，制定实施城乡居民增收计划。优化“两新”政策实施。清理消费领域不合理限制措施，释放服务消费潜力”。

预期 2026 年，科技的自立自强仍然会是主要议题，外需仍然是拉动经济最可得的抓手。但投资人可能也会变得更加冷静现实。

作为量化方式运作的指增产品，我们会考虑更多的增加防守性因子的配置敞口。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责的履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等财务数据真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70039114_H34 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	<p>平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p>

	<p>在编制财务报表时，管理层负责评估平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）</p>
<p>注册会计师的姓名</p>	<p>吴翠蓉 黄拥璇</p>
<p>会计师事务所的地址</p>	<p>北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室</p>
<p>审计报告日期</p>	<p>2026 年 3 月 24 日</p>

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,100,928.91	1,150,426.42
结算备付金		117,796.90	229,974.72
存出保证金		8,733.66	16,406.43
交易性金融资产	7.4.7.2	20,554,137.48	34,277,120.04
其中：股票投资		20,554,137.48	33,158,936.31
基金投资		-	-
债券投资		-	1,118,183.73
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	47,411.11
应收股利		-	-
应收申购款		8,278.50	272,162.96
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		22,789,875.45	35,993,501.68
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	90,886.01
应付赎回款		86,368.42	252,256.91
应付管理人报酬		19,218.66	30,578.12
应付托管费		2,882.80	4,586.74
应付销售服务费		5,089.22	7,775.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-

递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	23,522.77	62,408.18
负债合计		137,081.87	448,491.31
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	17,838,749.82	34,538,235.96
未分配利润	7.4.7.12	4,814,043.76	1,006,774.41
净资产合计		22,652,793.58	35,545,010.37
负债和净资产总计		22,789,875.45	35,993,501.68

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 17,838,749.82 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.2889 元，基金份额总额 8,344,446.59 份；下属 C 类基金份额净值 1.2531 元，基金份额总额 9,494,303.23 份。

7.2 利润表

会计主体：平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		5,840,944.12	2,250,973.03
1. 利息收入		6,354.58	7,638.57
其中：存款利息收入	7.4.7.13	6,354.58	7,638.57
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）		4,880,370.97	1,845,247.14
其中：股票投资收益	7.4.7.14	4,309,713.68	1,248,729.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	1,058.27	8,817.75
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	569,599.02	587,700.03
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)	7.4.7.20	951,570.49	388,021.80
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7.4.7.21	2,648.08	10,065.52
减：二、营业总支出		385,836.36	546,958.37
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	268,357.95	298,157.63
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	40,253.64	44,723.72
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	73,621.00	73,861.15
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.23	3,603.77	130,215.87
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		5,455,107.76	1,704,014.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		5,455,107.76	1,704,014.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,455,107.76	1,704,014.66

7.3 净资产变动表

会计主体：平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	34,538,235.96	1,006,774.41	35,545,010.37
二、本期期初净资产	34,538,235.96	1,006,774.41	35,545,010.37
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-16,699,486.14	3,807,269.35	-12,892,216.79
(一)、综合收益总额	-	5,455,107.76	5,455,107.76

(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)	-16,699,486.14	-1,647,838.41	-18,347,324.55
其中:1.基金申购款	23,312,307.43	1,795,505.21	25,107,812.64
2.基金赎回款	-40,011,793.57	-3,443,343.62	-43,455,137.19
(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	17,838,749.82	4,814,043.76	22,652,793.58
项目	上年度可比期间		
	2024年1月1日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	28,800,002.08	-314,042.30	28,485,959.78
二、本期期初净资产	28,800,002.08	-314,042.30	28,485,959.78
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,738,233.88	1,320,816.71	7,059,050.59
(一)、综合收益总额	-	1,704,014.66	1,704,014.66
(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)	5,738,233.88	-383,197.95	5,355,035.93
其中:1.基金申购款	33,275,046.69	-961,738.19	32,313,308.50
2.基金赎回款	-27,536,812.81	578,540.24	-26,958,272.57
(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	34,538,235.96	1,006,774.41	35,545,010.37

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

基金管理人负责人

林婉文

主管会计工作负责人

张南南

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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[2019]2064 号《关于准予平安中证 500 指数增强型发起式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 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》作为发起人负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 35,985,005.35 元，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（2020）第 0333 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 35,994,872.07 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,866.72 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金为发起式基金，发起资金认购方认购本基金的总额不少于人民币 1,000 万元，且发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别，称为 A 类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数的成份股、备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票）、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权等）、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

券等中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、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相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。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:本基金的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股和备选成份股的比例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,保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或监管机构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:中证 500 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外,均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以

单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息。

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认。

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回

基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

（1）对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额确认利息收入，计入当期损益。处置时，其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

（2）对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期间将按票面或合同利率计算的利息收入扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，扣除该部分利息后的公允价值变动额计入公允价值变动损益；除上述之外的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债的公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失扣除在适用情况下预估的增值税费后的净额计入公允价值变动损益。处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益。

本基金在同时符合下列条件时确认股利收入并计入当期损益：1）本基金收取股利的权利已经确立；2）与股利相关的经济利益很可能流入本基金；3）股利的金额能够可靠计量。

（3）其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期

末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要说明的重要会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

(1) 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。

(2) 增值税及附加

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开

开放式证券投资基金) 管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税; 国债、地方政府债券利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税; 存款利息收入不征收增值税。

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定, 证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为, 暂适用简易计税方法, 按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为, 未缴纳增值税的, 不再缴纳; 已缴纳增值税的, 已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》, 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。

(3) 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定, 对证券投资基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 债券的利息收入及其他收入, 暂不征收企业所得税。

(4) 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	2,100,928.91	1,150,426.42
等于：本金	2,100,771.55	1,150,308.18
加：应计利息	157.36	118.24
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	2,100,928.91	1,150,426.42

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		20,333,482.71	-	20,554,137.48	220,654.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		20,333,482.71	-	20,554,137.48	220,654.77
项目		上年度末			
		2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		33,889,384.03	-	33,158,936.31	-730,447.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,102,198.00	16,453.73	1,118,183.73	-468.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,102,198.00	16,453.73	1,118,183.73	-468.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		34,991,582.03	16,453.73	34,277,120.04	-730,915.72

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 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。

7.4.7.3.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

7.4.7.5 债权投资**7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31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	23,522.77	34,908.18
其中：交易所市场	23,522.77	34,908.18
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	27,500.00
合计	23,522.77	62,408.18

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安中证 500 指数增强 A

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,590,522.16	16,590,522.16
本期申购	2,451,827.24	2,451,827.24
本期赎回（以“-”号填列）	-10,697,902.81	-10,697,902.81
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	8,344,446.59	8,344,446.59

平安中证 500 指数增强 C

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,947,713.80	17,947,713.80
本期申购	20,860,480.19	20,860,480.19
本期赎回（以“-”号填列）	-29,313,890.76	-29,313,890.76
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	9,494,303.23	9,494,303.23

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

平安中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,651,966.23	-2,962,728.71	689,237.52
本期期初	3,651,966.23	-2,962,728.71	689,237.52
本期利润	2,054,658.02	371,391.85	2,426,049.87
本期基金份额交易产生的变动数	-2,032,956.30	1,328,525.02	-704,431.28
其中：基金申购款	790,110.67	-374,578.83	415,531.84
基金赎回款	-2,823,066.97	1,703,103.85	-1,119,963.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,673,667.95	-1,262,811.84	2,410,856.11

平安中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,479,481.79	-3,161,944.90	317,536.89
本期期初	3,479,481.79	-3,161,944.90	317,536.89
本期利润	2,448,879.25	580,178.64	3,029,057.89
本期基金份额交易产生的变动数	-2,104,930.15	1,161,523.02	-943,407.13
其中：基金申购款	4,727,100.81	-3,347,127.44	1,379,973.37
基金赎回款	-6,832,030.96	4,508,650.46	-2,323,380.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,823,430.89	-1,420,243.24	2,403,187.65

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	5,690.34	5,240.47
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	619.54	2,303.97
其他	44.70	94.13
合计	6,354.58	7,638.57

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,309,713.68	1,248,729.36
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
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	4,309,713.68	1,248,729.36

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

卖出股票成交总额	280,255,839.01	238,544,699.69
减：卖出股票成本总额	275,670,392.87	236,970,118.57
减：交易费用	275,732.46	325,851.76
买卖股票差价收入	4,309,713.68	1,248,729.36

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
债券投资收益——利息收入	3,256.27	8,759.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,198.00	58.00
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	1,058.27	8,817.75

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,119,710.00	201,598.64
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,102,198.00	200,370.00
减：应计利息总额	19,710.00	1,170.64
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	-2,198.00	58.00

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益**7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

7.4.7.17 贵金属投资收益**7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.18 衍生工具收益**7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12 月31日
股票投资产生的股利 收益	569,599.02	587,700.03

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	569,599.02	587,700.03

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	951,570.49	388,021.80
股票投资	951,102.49	388,489.80
债券投资	468.00	-468.00
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	951,570.49	388,021.80

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	2,648.08	2,079.38
基金转换费收入	-	7,986.14
合计	2,648.08	10,065.52

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金财产的比例依据《平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》确定。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未计提信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	-	2,500.00
信息披露费	-	25,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,603.77	2,715.87
指数使用费	-	100,000.00
合计	3,603.77	130,215.87

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	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
上海陆金所基金销售有限公司（“陆基金”）	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
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	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
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	132,601,353.46	24.45	0.00	0.00

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	24,651.81	24.45	7,215.47	30.67
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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 (%)
-	-	-	-	-

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、于 2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。自 2024 年 7 月 1 日起，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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	268,357.95	298,157.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	89,361.95	85,920.23
应支付基金管理人的净管理费	178,996.00	212,237.40

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 1.00%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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	40,253.64	44,723.72

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安中证 500 指数增 强 A	平安中证 500 指数增 强 C	合计
陆基金	-	18,962.80	18,962.80
平安基金	-	59.86	59.86
平安人寿	-	21,356.21	21,356.21
平安银行	-	17,816.25	17,816.25

平安证券	-	329.79	329.79
中国银行	-	2,753.78	2,753.78
合计	-	61,278.69	61,278.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C	合计
陆基金	-	12,603.30	12,603.30
平安基金	-	105.50	105.50
平安人寿	-	24,999.23	24,999.23
平安银行	-	16,085.00	16,085.00
平安证券	-	713.39	713.39
中国银行	-	4,380.31	4,380.31
合计	-	58,886.73	58,886.73

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 5 月 27 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,250.23	-
报告期间申购/ 买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分 变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/ 卖出总份额	5,000,000.00	-
报告期末持有的 基金份额	5,002,250.23	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	59.9471%	-
项目	上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 5 月 27 日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,250.23	-
报告期间申购/ 买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分 变动份额	0.00	-
减: 报告期间赎回/ 卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的 基金份额	10,002,250.23	-
报告期末持有的 基金份额 占基金总份额比 例	60.2889%	-

注: 1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

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

7.4.10.5.2 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

注：无。

7.4.10.6 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 2025年1月1日至2025年12月 31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	2,100,928.91	5,690.34	1,150,426.42	5,240.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业存款利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、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。

7.4.13.2 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，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券）。

7.4.13.3 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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行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 7.4.12。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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	2,100,928.91	-	-	-	2,100,928.91
结算备付金	117,796.90	-	-	-	117,796.90
存出保证金	8,733.66	-	-	-	8,733.66
交易性金融资产	-	-	-	20,554,137.48	20,554,137.48
应收申购款	-	-	-	8,278.50	8,278.50
资产总计	2,227,459.47	-	-	20,562,415.98	22,789,875.45
负债					
应付赎回款	-	-	-	86,368.42	86,368.42
应付管理人报酬	-	-	-	19,218.66	19,218.66
应付托管费	-	-	-	2,882.80	2,882.80
应付销售服务费	-	-	-	5,089.22	5,089.22
其他负债	-	-	-	23,522.77	23,522.77
负债总计	-	-	-	137,081.87	137,081.87
利率敏感度缺口	2,227,459.47	-	-	20,425,334.11	22,652,793.58
上年度末 2024 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	1,150,426.42	-	-	-	1,150,426.42
结算备付金	229,974.72	-	-	-	229,974.72
存出保证金	16,406.43	-	-	-	16,406.43
交易性金融资产	1,118,183.73	-	-	33,158,936.31	34,277,120.04
应收申购款	-	-	-	272,162.96	272,162.96
应收清算款	-	-	-	47,411.11	47,411.11
资产总计	2,514,991.30	-	-	33,478,510.38	35,993,501.68
负债					
应付赎回款	-	-	-	252,256.91	252,256.91

应付管理人报酬	-	-	-	30,578.12	30,578.12
应付托管费	-	-	-	4,586.74	4,586.74
应付清算款	-	-	-	90,886.01	90,886.01
应付销售服务费	-	-	-	7,775.35	7,775.35
其他负债	-	-	-	62,408.18	62,408.18
负债总计	-	-	-	448,491.31	448,491.31
利率敏感度缺口	2,514,991.30	-	-	33,030,019.07	35,545,010.37

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-	-498.68
市场利率下降 25 个基点	-	499.46	

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

7.4.13.4.3 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：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	20,554,137.48	90.74	33,158,936.31	93.29
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	20,554,137.48	90.74	33,158,936.31	93.29

7.4.13.4.3.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%		867,172.52
沪深 300 指数下降 5%		-867,172.52	-1,812,588.50

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	20,554,137.48	33,158,936.31
第二层次	-	1,118,183.73
第三层次	-	-
合计	20,554,137.48	34,277,120.04

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金无属于第三层次的金融资产。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：于本报告期末及上年度报告期末，本基金未使用不可观察输入值。

7.4.14.3 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。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本报告期内本基金管理人主动承担了本基金部分基金费用，如审计费等。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	20,554,137.48	90.19
	其中：股票	20,554,137.48	90.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,218,725.81	9.74
8	其他各项资产	17,012.16	0.07
9	合计	22,789,875.45	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	107,522.00	0.47
B	采矿业	871,849.00	3.85
C	制造业	14,165,930.48	62.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	554,328.00	2.45
E	建筑业	159,233.00	0.70
F	批发和零售业	309,658.00	1.37
G	交通运输、仓储和邮政业	299,960.00	1.32
H	住宿和餐饮业	27,797.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,701,692.00	7.51
J	金融业	1,482,285.00	6.54
K	房地产业	123,691.00	0.55
L	租赁和商务服务业	217,732.00	0.96

M	科学研究和技术服务业	147,343.00	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	95,715.00	0.42
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	31,510.00	0.14
Q	卫生和社会工作	66,691.00	0.29
R	文化、体育和娱乐业	114,939.00	0.51
S	综合	76,262.00	0.34
	合计	20,554,137.48	90.74

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

8.2.3 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。

8.3 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

8.3.1 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	002837	英维克	1,300	138,957.00	0.61
2	002558	巨人网络	3,200	138,528.00	0.61
3	300136	信维通信	2,200	136,400.00	0.60
4	002738	中矿资源	1,700	133,535.00	0.59
5	600879	航天电子	6,000	127,920.00	0.56
6	300450	先导智能	2,500	124,950.00	0.55
7	600580	卧龙电驱	2,500	122,750.00	0.54
8	600988	赤峰黄金	3,800	118,712.00	0.52
9	600118	中国卫星	1,200	113,940.00	0.50
10	600487	亨通光电	4,600	113,758.00	0.50
11	601168	西部矿业	3,900	107,796.00	0.48
12	000426	兴业银锡	3,000	106,800.00	0.47
13	600549	厦门钨业	2,500	102,650.00	0.45
14	002532	天山铝业	6,300	101,934.00	0.45
15	002156	通富微电	2,700	101,790.00	0.45
16	300604	长川科技	1,000	101,310.00	0.45
17	300207	欣旺达	3,800	99,370.00	0.44
18	002353	杰瑞股份	1,400	99,162.00	0.44
19	000933	神火股份	3,600	98,892.00	0.44

20	301308	江波龙	400	97,936.00	0.43
21	002340	格林美	11,700	97,812.00	0.43
22	300115	长盈精密	2,100	97,650.00	0.43
23	688347	华虹公司	900	97,083.00	0.43
24	600096	云天化	2,900	96,889.00	0.43
25	688002	睿创微纳	935	94,248.00	0.42
26	300058	蓝色光标	8,100	93,312.00	0.41
27	600143	金发科技	4,700	91,838.00	0.41
28	002195	岩山科技	12,800	90,752.00	0.40
29	300395	菲利华	900	90,270.00	0.40
30	002851	麦格米特	1,000	90,070.00	0.40
31	688120	华海清科	600	90,048.00	0.40
32	300339	润和软件	1,800	89,100.00	0.39
33	002517	恺英网络	4,000	87,480.00	0.39
34	002131	利欧股份	15,500	87,420.00	0.39
35	002966	苏州银行	10,400	86,216.00	0.38
36	600885	宏发股份	2,800	85,120.00	0.38
37	300223	北京君正	800	84,832.00	0.37
38	300857	协创数据	500	84,340.00	0.37
39	601555	东吴证券	9,100	82,446.00	0.36
40	002402	和而泰	2,100	82,152.00	0.36
41	688235	百济神州	300	80,580.00	0.36
42	002436	兴森科技	3,800	80,446.00	0.36
43	603228	景旺电子	1,100	80,399.00	0.35
44	002273	水晶光电	3,200	80,384.00	0.35
45	688525	佰维存储	700	80,353.00	0.35
46	000831	中国稀土	1,700	78,948.00	0.35
47	002008	大族激光	1,900	78,261.00	0.35
48	002281	光迅科技	1,100	76,945.00	0.34
49	688361	中科飞测	500	76,495.00	0.34
50	300390	天华新能	1,400	76,454.00	0.34
51	002130	沃尔核材	2,900	76,328.00	0.34
52	600673	东阳光	3,400	76,262.00	0.34
53	002595	豪迈科技	900	76,059.00	0.34
54	688122	西部超导	1,000	74,580.00	0.33
55	688469	芯联集成	11,100	74,259.00	0.33
56	688777	中控技术	1,500	74,010.00	0.33
57	002128	电投能源	2,600	72,566.00	0.32
58	600699	均胜电子	2,300	72,128.00	0.32
59	002126	银轮股份	1,900	71,820.00	0.32
60	301358	湖南裕能	1,100	71,126.00	0.31
61	002472	双环传动	1,500	71,115.00	0.31
62	688099	晶晨股份	800	69,784.00	0.31

63	002294	信立泰	1,400	69,370.00	0.31
64	300454	深信服	600	69,096.00	0.31
65	600392	盛和资源	3,200	68,896.00	0.30
66	300346	南大光电	1,600	68,640.00	0.30
67	603979	金诚信	900	68,535.00	0.30
68	603659	璞泰来	2,500	68,350.00	0.30
69	688608	恒玄科技	300	68,082.00	0.30
70	600021	上海电力	3,400	68,068.00	0.30
71	300054	鼎龙股份	1,800	67,680.00	0.30
72	601162	天风证券	16,200	67,392.00	0.30
73	002797	第一创业	9,700	66,639.00	0.29
74	000878	云南铜业	3,200	65,632.00	0.29
75	688019	安集科技	300	65,376.00	0.29
76	600352	浙江龙盛	6,100	65,026.00	0.29
77	601099	太平洋	15,800	64,938.00	0.29
78	002185	华天科技	5,900	64,723.00	0.29
79	601108	财通证券	7,400	64,528.00	0.28
80	002138	顺络电子	1,800	63,954.00	0.28
81	300073	当升科技	1,100	63,580.00	0.28
82	688676	金盘科技	700	63,238.00	0.28
83	000021	深科技	2,500	63,200.00	0.28
84	002850	科达利	400	63,144.00	0.28
85	300037	新宙邦	1,200	62,880.00	0.28
86	688578	艾力斯	600	62,490.00	0.28
87	601198	东兴证券	4,500	62,460.00	0.28
88	000893	亚钾国际	1,300	62,361.00	0.28
89	000783	长江证券	7,600	61,940.00	0.27
90	300751	迈为股份	300	61,797.00	0.27
91	601717	中创智领	2,500	61,375.00	0.27
92	000960	锡业股份	2,200	61,336.00	0.27
93	600298	安琪酵母	1,400	61,236.00	0.27
94	300496	中科创达	900	60,750.00	0.27
95	600536	中国软件	1,300	60,190.00	0.27
96	002078	太阳纸业	3,800	59,850.00	0.26
97	002271	东方雨虹	4,400	59,796.00	0.26
98	002157	正邦科技	18,300	59,292.00	0.26
99	603179	新泉股份	800	59,104.00	0.26
100	688385	复旦微电	800	58,960.00	0.26
101	600141	兴发集团	1,700	58,786.00	0.26
102	002414	高德红外	4,000	58,680.00	0.26
103	300017	网宿科技	5,700	58,425.00	0.26
104	000657	中钨高新	2,100	58,191.00	0.26
105	601615	明阳智能	4,000	57,920.00	0.26

106	002444	巨星科技	1,700	57,834.00	0.26
107	600498	烽火通信	1,800	57,744.00	0.25
108	688017	绿的谐波	300	57,630.00	0.25
109	300474	景嘉微	800	57,496.00	0.25
110	688183	生益电子	600	57,414.00	0.25
111	601665	齐鲁银行	10,000	57,400.00	0.25
112	300724	捷佳伟创	600	57,360.00	0.25
113	688213	思特威	600	57,054.00	0.25
114	601233	桐昆股份	3,300	56,793.00	0.25
115	600109	国金证券	6,000	55,800.00	0.25
116	603129	春风动力	200	55,736.00	0.25
117	300458	全志科技	1,300	54,639.00	0.24
118	601179	中国西电	6,000	54,600.00	0.24
119	300748	金力永磁	1,600	54,576.00	0.24
120	002080	中材科技	1,500	54,510.00	0.24
121	603087	甘李药业	800	54,456.00	0.24
122	002085	万丰奥威	3,400	54,434.00	0.24
123	601128	常熟银行	7,700	54,208.00	0.24
124	000423	东阿阿胶	1,100	53,988.00	0.24
125	603606	东方电缆	900	53,775.00	0.24
126	002223	鱼跃医疗	1,400	53,494.00	0.24
127	601577	长沙银行	5,500	53,350.00	0.24
128	688568	中科星图	900	53,100.00	0.23
129	300002	神州泰岳	4,600	52,992.00	0.23
130	300012	华测检测	3,900	52,845.00	0.23
131	002155	湖南黄金	2,500	52,725.00	0.23
132	002409	雅克科技	700	51,870.00	0.23
133	603596	伯特利	1,000	51,270.00	0.23
134	300919	中伟新材	1,100	50,963.00	0.22
135	000728	国元证券	6,100	50,935.00	0.22
136	300024	机器人	2,800	50,932.00	0.22
137	002624	完美世界	3,100	50,809.00	0.22
138	002064	华峰化学	4,600	50,600.00	0.22
139	000034	神州数码	1,300	50,583.00	0.22
140	600363	联创光电	800	50,448.00	0.22
141	600497	驰宏锌锗	6,900	50,439.00	0.22
142	000559	万向钱潮	2,900	49,880.00	0.22
143	688599	天合光能	3,000	49,650.00	0.22
144	688220	翱捷科技	600	49,566.00	0.22
145	300285	国瓷材料	1,800	49,338.00	0.22
146	002673	西部证券	6,200	48,918.00	0.22
147	002756	永兴材料	900	48,825.00	0.22
148	688617	惠泰医疗	200	48,654.00	0.21

149	603920	世运电路	1,000	48,410.00	0.21
150	600765	中航重机	2,500	47,900.00	0.21
151	002410	广联达	3,800	47,804.00	0.21
152	002683	广东宏大	1,000	47,800.00	0.21
153	300373	扬杰科技	700	47,600.00	0.21
154	002065	东华软件	5,200	47,580.00	0.21
155	688052	纳芯微	300	47,454.00	0.21
156	300003	乐普医疗	3,000	47,430.00	0.21
157	603160	汇顶科技	600	47,400.00	0.21
158	300699	光威复材	1,200	47,352.00	0.21
159	000733	振华科技	900	47,169.00	0.21
160	603766	隆鑫通用	2,900	46,719.00	0.21
161	300757	罗博特科	200	46,660.00	0.21
162	002821	凯莱英	500	46,465.00	0.21
163	002318	久立特材	1,600	46,320.00	0.20
164	000528	柳 工	3,900	46,293.00	0.20
165	300570	太辰光	400	46,220.00	0.20
166	688065	凯赛生物	917	45,666.60	0.20
167	300567	精测电子	500	45,600.00	0.20
168	600873	梅花生物	4,500	45,585.00	0.20
169	688615	合合信息	200	45,516.00	0.20
170	300627	华测导航	1,300	45,383.00	0.20
171	000997	新 大 陆	1,600	45,312.00	0.20
172	605589	圣泉集团	1,600	45,280.00	0.20
173	605358	立昂微	1,300	45,266.00	0.20
174	601231	环旭电子	1,500	45,000.00	0.20
175	600862	中航高科	1,900	44,897.00	0.20
176	688322	奥比中光	500	44,835.00	0.20
177	000830	鲁西化工	2,700	44,739.00	0.20
178	688234	天岳先进	500	44,440.00	0.20
179	002335	科华数据	800	44,424.00	0.20
180	000932	华菱钢铁	7,900	44,398.00	0.20
181	600637	东方明珠	4,500	44,325.00	0.20
182	000703	恒逸石化	4,100	44,157.00	0.19
183	000887	中鼎股份	1,900	44,099.00	0.19
184	600909	华安证券	6,500	44,070.00	0.19
185	000683	博源化工	5,900	43,896.00	0.19
186	600332	白云山	1,700	43,758.00	0.19
187	000400	许继电气	1,700	43,707.00	0.19
188	600060	海信视像	1,800	43,704.00	0.19
189	000750	国海证券	10,300	43,672.00	0.19
190	300001	特锐德	1,700	43,656.00	0.19
191	000623	吉林敖东	2,200	42,966.00	0.19

192	300677	英科医疗	1,100	42,790.00	0.19
193	688702	盛科通信	300	42,507.00	0.19
194	603444	吉比特	100	42,385.00	0.19
195	000039	中集集团	4,200	42,378.00	0.19
196	600563	法拉电子	400	41,980.00	0.19
197	000009	中国宝安	4,200	41,370.00	0.18
198	600737	中粮糖业	2,400	41,304.00	0.18
199	300383	光环新网	3,300	41,283.00	0.18
200	600369	西南证券	9,200	41,216.00	0.18
201	688180	君实生物	1,200	40,992.00	0.18
202	000060	中金岭南	7,000	40,950.00	0.18
203	688188	柏楚电子	300	40,767.00	0.18
204	600521	华海药业	2,400	40,728.00	0.18
205	600171	上海贝岭	1,300	40,625.00	0.18
206	603568	伟明环保	1,600	40,608.00	0.18
207	002203	海亮股份	3,200	40,512.00	0.18
208	601990	南京证券	5,100	40,392.00	0.18
209	300142	沃森生物	3,700	40,367.00	0.18
210	603486	科沃斯	500	40,340.00	0.18
211	600177	雅戈尔	5,300	40,280.00	0.18
212	300972	万辰集团	200	40,214.00	0.18
213	600704	物产中大	7,200	40,104.00	0.18
214	002152	广电运通	2,900	40,049.00	0.18
215	688629	华丰科技	400	40,024.00	0.18
216	688387	信科移动	3,100	39,990.00	0.18
217	601997	贵阳银行	6,800	39,916.00	0.18
218	603345	安井食品	500	39,640.00	0.17
219	002841	视源股份	1,000	39,630.00	0.17
220	002007	华兰生物	2,600	39,338.00	0.17
221	600801	华新建材	1,600	39,264.00	0.17
222	688278	特宝生物	468	39,162.24	0.17
223	001696	宗申动力	1,800	39,042.00	0.17
224	688778	厦钨新能	500	38,685.00	0.17
225	002429	兆驰股份	5,200	38,584.00	0.17
226	600435	北方导航	2,500	38,550.00	0.17
227	002044	美年健康	7,300	38,544.00	0.17
228	300432	富临精工	2,300	38,410.00	0.17
229	000738	航发控制	1,800	38,358.00	0.17
230	600378	昊华科技	1,200	38,352.00	0.17
231	000729	燕京啤酒	3,400	38,182.00	0.17
232	601611	中国核建	2,800	37,744.00	0.17
233	002939	长城证券	3,700	37,740.00	0.17
234	600516	方大炭素	6,600	37,554.00	0.17

235	600208	衢州发展	9,700	37,539.00	0.17
236	600499	科达制造	2,700	37,449.00	0.17
237	688375	国博电子	400	37,244.00	0.16
238	601216	君正集团	7,700	37,114.00	0.16
239	688266	泽璟制药	400	37,080.00	0.16
240	300487	蓝晓科技	600	37,050.00	0.16
241	601799	星宇股份	300	37,011.00	0.16
242	600153	建发股份	4,000	37,000.00	0.16
243	603816	顾家家居	1,200	36,888.00	0.16
244	601567	三星医疗	1,600	36,832.00	0.16
245	688114	华大智造	600	36,456.00	0.16
246	603379	三美股份	600	36,432.00	0.16
247	603699	纽威股份	700	36,379.00	0.16
248	603728	鸣志电器	500	36,175.00	0.16
249	600642	申能股份	4,600	35,788.00	0.16
250	300763	锦浪科技	500	35,705.00	0.16
251	601212	白银有色	6,100	35,685.00	0.16
252	002056	横店东磁	1,800	35,100.00	0.15
253	000155	川能动力	3,000	34,950.00	0.15
254	600863	华能蒙电	7,800	34,944.00	0.15
255	600316	洪都航空	1,000	34,910.00	0.15
256	600486	扬农化工	500	34,695.00	0.15
257	000519	中兵红箭	1,900	34,599.00	0.15
258	603156	养元饮品	1,200	34,500.00	0.15
259	688772	珠海冠宇	1,600	34,448.00	0.15
260	688166	博瑞医药	700	34,342.00	0.15
261	301611	珂玛科技	400	34,292.00	0.15
262	601958	金钼股份	2,200	34,276.00	0.15
263	603605	珀莱雅	500	34,240.00	0.15
264	002603	以岭药业	2,000	34,140.00	0.15
265	300679	电连技术	700	34,076.00	0.15
266	688538	和辉光电	12,800	34,048.00	0.15
267	688018	乐鑫科技	200	34,000.00	0.15
268	603338	浙江鼎力	600	33,984.00	0.15
269	002262	恩华药业	1,400	33,782.00	0.15
270	603806	福斯特	2,400	33,504.00	0.15
271	002926	华西证券	3,600	33,408.00	0.15
272	000723	美锦能源	7,100	33,370.00	0.15
273	600398	海澜之家	5,500	33,275.00	0.15
274	000629	钒钛股份	10,700	33,170.00	0.15
275	600820	隧道股份	5,100	33,099.00	0.15
276	688582	芯动联科	500	33,055.00	0.15
277	600901	江苏金租	5,400	33,048.00	0.15

278	600348	华阳股份	4,000	33,040.00	0.15
279	600312	平高电气	1,900	32,965.00	0.15
280	002430	杭氧股份	1,100	32,857.00	0.15
281	001389	广合科技	400	32,652.00	0.14
282	603939	益丰药房	1,500	32,580.00	0.14
283	600038	中直股份	900	32,517.00	0.14
284	603737	三棵树	700	32,389.00	0.14
285	601106	中国一重	8,100	32,319.00	0.14
286	603077	和邦生物	14,200	32,092.00	0.14
287	600170	上海建工	12,100	32,065.00	0.14
288	600329	达仁堂	700	31,934.00	0.14
289	600967	内蒙一机	1,900	31,920.00	0.14
290	603298	杭叉集团	1,200	31,884.00	0.14
291	601699	潞安环能	2,700	31,860.00	0.14
292	600166	福田汽车	10,900	31,828.00	0.14
293	002984	森麒麟	1,500	31,755.00	0.14
294	300676	华大基因	700	31,752.00	0.14
295	300100	双林股份	800	31,696.00	0.14
296	002958	青农商行	10,200	31,620.00	0.14
297	002385	大北农	7,900	31,600.00	0.14
298	002607	中公教育	11,500	31,510.00	0.14
299	600132	重庆啤酒	600	31,344.00	0.14
300	600970	中材国际	3,000	31,170.00	0.14
301	600562	国睿科技	1,100	31,086.00	0.14
302	601991	大唐发电	8,800	30,712.00	0.14
303	000050	深天马A	3,400	30,702.00	0.14
304	688301	奕瑞科技	300	30,333.00	0.13
305	300144	宋城演艺	3,700	30,303.00	0.13
306	600008	首创环保	10,100	30,300.00	0.13
307	600998	九州通	5,900	30,208.00	0.13
308	002025	航天电器	600	30,078.00	0.13
309	603589	口子窖	1,000	30,050.00	0.13
310	300623	捷捷微电	1,100	29,887.00	0.13
311	603885	吉祥航空	2,000	29,760.00	0.13
312	002500	山西证券	4,900	29,351.00	0.13
313	003031	中瓷电子	400	29,264.00	0.13
314	002244	滨江集团	2,900	29,145.00	0.13
315	600380	健康元	2,500	28,875.00	0.13
316	603290	斯达半导	300	28,827.00	0.13
317	300146	汤臣倍健	2,400	28,824.00	0.13
318	688297	中无人机	600	28,812.00	0.13
319	600095	湘财股份	2,600	28,756.00	0.13
320	002312	川发龙蟒	2,600	28,418.00	0.13

321	600282	南钢股份	5,400	28,404.00	0.13
322	002583	海能达	2,500	28,300.00	0.12
323	600763	通策医疗	700	28,147.00	0.12
324	002432	九安医疗	700	28,028.00	0.12
325	300558	贝达药业	600	28,014.00	0.12
326	600583	海油工程	5,100	27,999.00	0.12
327	000591	太阳能	6,300	27,972.00	0.12
328	600754	锦江酒店	1,100	27,797.00	0.12
329	600985	淮北矿业	2,500	27,775.00	0.12
330	601608	中信重工	4,200	27,678.00	0.12
331	600995	南网储能	2,200	27,654.00	0.12
332	601156	东航物流	1,500	27,615.00	0.12
333	000513	丽珠集团	800	27,568.00	0.12
334	000921	海信家电	1,100	27,291.00	0.12
335	603225	新凤鸣	1,400	27,244.00	0.12
336	600535	天士力	1,800	27,126.00	0.12
337	002773	康弘药业	900	26,973.00	0.12
338	688728	格科微	1,800	26,892.00	0.12
339	601666	平煤股份	3,400	26,758.00	0.12
340	600977	中国电影	1,700	26,724.00	0.12
341	601865	福莱特	1,700	26,639.00	0.12
342	601000	唐山港	6,900	26,496.00	0.12
343	600004	白云机场	2,800	26,488.00	0.12
344	603650	彤程新材	600	26,484.00	0.12
345	688318	财富趋势	200	26,464.00	0.12
346	601016	节能风电	8,900	26,255.00	0.12
347	002568	百润股份	1,200	26,172.00	0.12
348	600602	云赛智联	1,400	26,166.00	0.12
349	000987	越秀资本	3,200	26,048.00	0.11
350	603833	欧派家居	500	26,045.00	0.11
351	000825	太钢不锈	5,300	25,917.00	0.11
352	600511	国药股份	900	25,875.00	0.11
353	600848	上海临港	2,200	25,740.00	0.11
354	002831	裕同科技	900	25,659.00	0.11
355	300718	长盛轴承	300	25,608.00	0.11
356	603688	石英股份	700	25,606.00	0.11
357	600685	中船防务	900	25,605.00	0.11
358	600598	北大荒	1,700	25,415.00	0.11
359	688281	华秦科技	344	25,387.20	0.11
360	600126	杭钢股份	3,100	25,296.00	0.11
361	000032	深桑达 A	1,300	25,155.00	0.11
362	000598	兴蓉环境	3,500	25,095.00	0.11
363	601001	晋控煤业	1,900	24,985.00	0.11

364	002266	浙富控股	6,000	24,960.00	0.11
365	300735	光弘科技	1,000	24,860.00	0.11
366	003021	兆威机电	200	24,836.00	0.11
367	603927	中科软	1,300	24,817.00	0.11
368	002299	圣农发展	1,500	24,810.00	0.11
369	603000	人民网	1,300	24,765.00	0.11
370	601966	玲珑轮胎	1,700	24,701.00	0.11
371	600483	福能股份	2,600	24,622.00	0.11
372	000062	深圳华强	1,000	24,620.00	0.11
373	600739	辽宁成大	2,200	24,596.00	0.11
374	002423	中粮资本	2,100	24,570.00	0.11
375	600578	京能电力	4,800	24,480.00	0.11
376	603899	晨光股份	900	24,354.00	0.11
377	000563	陕国投 A	7,000	24,150.00	0.11
378	601333	广深铁路	7,900	24,016.00	0.11
379	002439	启明星辰	1,700	24,004.00	0.11
380	301536	星辰科技	400	23,964.00	0.11
381	601918	新集能源	3,600	23,796.00	0.11
382	600566	济川药业	900	23,670.00	0.10
383	000951	中国重汽	1,400	23,660.00	0.10
384	600655	豫园股份	4,600	23,598.00	0.10
385	600517	国网英大	3,900	23,439.00	0.10
386	603786	科博达	300	23,430.00	0.10
387	000958	电投产融	3,600	23,292.00	0.10
388	600808	马钢股份	5,500	23,210.00	0.10
389	002120	韵达股份	3,400	22,916.00	0.10
390	601118	海南橡胶	3,900	22,815.00	0.10
391	000739	普洛药业	1,400	22,778.00	0.10
392	601866	中远海发	9,000	22,680.00	0.10
393	600131	国网信通	1,400	22,596.00	0.10
394	000883	湖北能源	4,900	22,246.00	0.10
395	600546	山煤国际	2,200	22,198.00	0.10
396	300601	康泰生物	1,500	22,155.00	0.10
397	600582	天地科技	3,800	22,154.00	0.10
398	002670	国盛证券	1,300	21,892.00	0.10
399	601598	中国外运	3,600	21,816.00	0.10
400	000709	河钢股份	9,400	21,714.00	0.10
401	300529	健帆生物	1,100	21,637.00	0.10
402	000582	北部湾港	2,300	21,574.00	0.10
403	000027	深圳能源	3,300	21,516.00	0.09
404	000088	盐田港	4,800	21,360.00	0.09
405	600663	陆家嘴	2,700	21,357.00	0.09
406	688561	奇安信	600	21,348.00	0.09

407	000967	盈峰环境	2,900	21,286.00	0.09
408	002508	老板电器	1,100	21,285.00	0.09
409	603341	龙旗科技	500	21,130.00	0.09
410	002153	石基信息	1,900	20,577.00	0.09
411	600528	中铁工业	2,500	20,450.00	0.09
412	603858	步长制药	1,300	20,332.00	0.09
413	600707	彩虹股份	3,100	20,119.00	0.09
414	603565	中谷物流	2,000	20,080.00	0.09
415	600906	财达证券	3,000	20,010.00	0.09
416	300070	碧水源	5,100	19,992.00	0.09
417	600959	江苏有线	5,800	19,952.00	0.09
418	003022	联泓新科	1,000	19,810.00	0.09
419	300957	贝泰妮	500	19,805.00	0.09
420	301498	乖宝宠物	300	19,545.00	0.09
421	601098	中南传媒	1,700	19,142.00	0.08
422	300888	稳健医疗	500	18,920.00	0.08
423	002265	建设工业	700	18,774.00	0.08
424	688425	铁建重工	3,700	18,759.00	0.08
425	688709	成都华微	400	18,396.00	0.08
426	600062	华润双鹤	1,000	18,290.00	0.08
427	601928	凤凰传媒	1,800	18,072.00	0.08
428	600968	海油发展	4,700	18,048.00	0.08
429	688248	南网科技	400	17,896.00	0.08
430	688336	三生国健	300	17,871.00	0.08
431	603529	爱玛科技	600	17,820.00	0.08
432	002032	苏泊尔	400	17,632.00	0.08
433	688563	航材股份	300	17,535.00	0.08
434	688363	华熙生物	400	17,472.00	0.08
435	688172	燕东微	600	17,364.00	0.08
436	601061	中信金属	1,200	17,280.00	0.08
436	688192	迪哲医药	300	17,280.00	0.08
437	000959	首钢股份	3,500	17,150.00	0.08
438	001286	陕西能源	1,800	16,758.00	0.07
439	601965	中国汽研	1,000	16,600.00	0.07
440	600764	中国海防	600	16,404.00	0.07
441	600295	鄂尔多斯	1,300	16,068.00	0.07
442	600720	中交设计	2,200	15,884.00	0.07
443	600098	广州发展	2,400	15,696.00	0.07
444	002372	伟星新材	1,500	15,645.00	0.07
445	000537	绿发电力	1,900	15,599.00	0.07
446	000429	粤高速 A	1,300	15,314.00	0.07
447	301301	川宁生物	1,500	15,210.00	0.07
448	688349	三一重能	600	15,168.00	0.07

449	688100	威胜信息	363	14,265.90	0.06
450	688295	中复神鹰	434	14,239.54	0.06
451	603658	安图生物	400	14,168.00	0.06
452	600688	上海石化	5,000	13,900.00	0.06
453	000898	鞍钢股份	5,400	13,662.00	0.06
454	000937	冀中能源	2,500	13,450.00	0.06
455	002608	江苏国信	1,800	13,302.00	0.06
456	601139	深圳燃气	2,000	13,200.00	0.06
457	688520	神州细胞	300	12,993.00	0.06
458	600339	中油工程	3,800	12,730.00	0.06
459	600032	浙江新能	1,700	12,597.00	0.06
460	003035	南网能源	2,700	12,366.00	0.05
461	601019	山东出版	1,400	12,096.00	0.05
462	688475	萤石网络	400	12,044.00	0.05
463	301200	大族数控	100	11,877.00	0.05
464	601228	广州港	3,500	11,340.00	0.05
465	600927	永安期货	700	11,249.00	0.05
466	603049	中策橡胶	200	11,190.00	0.05
467	603707	健友股份	1,200	10,836.00	0.05
468	300140	节能环境	1,500	10,155.00	0.04
469	688819	天能股份	300	9,966.00	0.04
470	600007	中国国贸	500	9,910.00	0.04
471	002461	珠江啤酒	1,000	9,290.00	0.04
472	000539	粤电力A	2,100	9,282.00	0.04
473	002945	华林证券	600	9,198.00	0.04
474	601921	浙版传媒	1,100	8,602.00	0.04
475	001213	中铁特货	2,100	8,505.00	0.04
476	600299	安迪苏	900	8,073.00	0.04
477	001221	悍高集团	100	5,791.00	0.03

8.3.2 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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	603087	甘李药业	1,291,536.00	3.63
2	600927	永安期货	1,230,736.00	3.46
3	300054	鼎龙股份	1,156,444.00	3.25
4	000893	亚钾国际	1,146,370.00	3.23
5	688249	晶合集成	1,122,471.58	3.16
6	002056	横店东磁	1,104,495.00	3.11

7	002595	豪迈科技	1,060,748.00	2.98
8	600968	海油发展	1,053,936.00	2.97
9	603737	三棵树	1,053,049.00	2.96
10	601615	明阳智能	1,039,656.00	2.92
11	688065	凯赛生物	1,034,057.65	2.91
12	601665	齐鲁银行	1,027,009.00	2.89
13	603486	科沃斯	1,014,796.00	2.85
14	600535	天士力	993,586.00	2.80
15	000155	川能动力	992,167.00	2.79
16	601611	中国核建	989,390.00	2.78
17	300699	光威复材	985,704.00	2.77
18	603589	口子窖	984,171.00	2.77
19	601928	凤凰传媒	976,960.00	2.75
20	603000	人民网	969,310.00	2.73
21	002432	九安医疗	967,959.00	2.72
22	600348	华阳股份	966,220.00	2.72
23	600141	兴发集团	959,740.00	2.70
24	688563	航材股份	957,726.28	2.69
25	603927	中科软	956,989.00	2.69
26	000783	长江证券	954,259.00	2.68
27	002318	久立特材	948,505.00	2.67
28	600707	彩虹股份	931,519.00	2.62
29	601666	平煤股份	924,676.00	2.60
30	600499	科达制造	915,170.00	2.57
31	688475	萤石网络	913,272.04	2.57
32	000959	首钢股份	911,749.00	2.57
33	688425	铁建重工	910,281.91	2.56
34	000830	鲁西化工	905,035.00	2.55
35	601958	金钼股份	900,406.00	2.53
36	002299	圣农发展	897,319.00	2.52
37	601179	中国西电	896,574.00	2.52
38	600862	中航高科	893,106.00	2.51
39	600885	宏发股份	886,096.00	2.49
40	600118	中国卫星	884,471.00	2.49
41	002831	裕同科技	883,139.00	2.48
42	600765	中航重机	871,953.00	2.45
43	688387	信科移动	868,938.61	2.44
44	601212	白银有色	865,623.00	2.44
45	600153	建发股份	861,866.00	2.42
46	600007	中国国贸	859,358.00	2.42
47	003022	联泓新科	855,013.00	2.41
48	600685	中船防务	849,215.00	2.39
49	002603	以岭药业	848,281.00	2.39

50	600977	中国电影	847,190.00	2.38
51	000683	博源化工	845,662.00	2.38
52	300144	宋城演艺	845,627.00	2.38
53	002273	水晶光电	840,189.86	2.36
54	300496	中科创达	834,524.00	2.35
55	601233	桐昆股份	833,990.00	2.35
56	603707	健友股份	832,417.00	2.34
57	002472	双环传动	832,387.00	2.34
58	000960	锡业股份	832,034.00	2.34
59	600258	首旅酒店	831,388.00	2.34
60	002409	雅克科技	829,000.00	2.33
61	601019	山东出版	828,898.00	2.33
62	603885	吉祥航空	818,787.00	2.30
63	688100	威胜信息	811,715.49	2.28
64	002080	中材科技	811,055.00	2.28
65	603379	三美股份	809,985.00	2.28
66	000403	派林生物	804,815.00	2.26
67	000878	云南铜业	801,940.00	2.26
68	600282	南钢股份	800,133.00	2.25
69	300567	精测电子	797,356.00	2.24
70	002429	兆驰股份	796,242.00	2.24
71	600498	烽火通信	796,057.00	2.24
72	002926	华西证券	793,502.00	2.23
73	002185	华天科技	791,174.00	2.23
74	600754	锦江酒店	786,415.00	2.21
75	002958	青农商行	783,165.00	2.20
76	002532	天山铝业	782,106.00	2.20
77	000738	航发控制	781,740.00	2.20
78	601965	中国汽研	777,258.00	2.19
79	600970	中材国际	775,780.00	2.18
80	600801	华新建材	768,359.00	2.16
81	000887	中鼎股份	759,485.00	2.14
82	000066	中国长城	758,779.00	2.13
83	002203	海亮股份	756,796.00	2.13
84	600329	达仁堂	756,135.00	2.13
85	603899	晨光股份	755,111.00	2.12
86	600998	九州通	753,795.00	2.12
87	600820	隧道股份	751,391.00	2.11
88	600295	鄂尔多斯	749,918.00	2.11
89	003035	南网能源	746,494.00	2.10
90	002244	滨江集团	742,729.00	2.09
91	002261	拓维信息	740,017.00	2.08
92	605358	立昂微	738,597.00	2.08

93	002414	高德红外	738,563.60	2.08
94	002821	凯莱英	736,538.00	2.07
95	603939	益丰药房	735,863.00	2.07
96	000050	深天马 A	732,481.00	2.06
97	000932	华菱钢铁	731,734.00	2.06
98	600038	中直股份	730,681.00	2.06
99	601098	中南传媒	730,634.00	2.06
100	600583	海油工程	729,362.00	2.05
101	000060	中金岭南	729,029.00	2.05
102	688777	中控技术	728,870.20	2.05
103	688278	特宝生物	728,734.78	2.05
104	600612	老凤祥	721,291.00	2.03
105	002128	电投能源	719,779.00	2.02
106	603160	汇顶科技	717,393.00	2.02
107	600486	扬农化工	716,770.00	2.02
108	601918	新集能源	714,438.00	2.01
109	603556	海兴电力	713,121.00	2.01
110	300677	英科医疗	712,269.00	2.00
111	000987	越秀资本	711,312.00	2.00

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。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	603087	甘李药业	1,530,283.00	4.31
2	002056	横店东磁	1,301,141.00	3.66
3	600927	永安期货	1,290,419.00	3.63
4	688065	凯赛生物	1,222,168.21	3.44
5	603927	中科软	1,216,134.40	3.42
6	600141	兴发集团	1,186,429.87	3.34
7	688425	铁建重工	1,154,758.24	3.25
8	688249	晶合集成	1,153,779.18	3.25
9	000959	首钢股份	1,150,911.00	3.24
10	000783	长江证券	1,147,763.00	3.23
11	600348	华阳股份	1,144,891.00	3.22
12	600535	天士力	1,116,412.00	3.14
13	300054	鼎龙股份	1,116,084.00	3.14
14	000893	亚钾国际	1,113,635.00	3.13
15	600499	科达制造	1,105,229.00	3.11
16	600977	中国电影	1,096,984.00	3.09
17	601611	中国核建	1,087,923.00	3.06
18	002595	豪迈科技	1,068,029.00	3.00
19	003022	联泓新科	1,059,508.00	2.98

20	000830	鲁西化工	1,053,147.00	2.96
21	601615	明阳智能	1,050,184.00	2.95
22	002831	裕同科技	1,048,718.00	2.95
23	601233	桐昆股份	1,046,982.00	2.95
24	601958	金铂股份	1,036,626.00	2.92
25	603486	科沃斯	1,029,360.00	2.90
26	600968	海油发展	1,022,338.00	2.88
27	688387	信科移动	1,016,999.23	2.86
28	603737	三棵树	1,014,760.20	2.85
29	601212	白银有色	1,010,262.00	2.84
30	603000	人民网	1,006,412.00	2.83
31	601139	深圳燃气	1,006,087.00	2.83
32	002432	九安医疗	1,003,572.94	2.82
33	000738	航发控制	994,016.00	2.80
34	603379	三美股份	992,257.00	2.79
35	000155	川能动力	989,177.00	2.78
36	300699	光威复材	980,836.00	2.76
37	003035	南网能源	978,846.54	2.75
38	601665	齐鲁银行	956,619.00	2.69
39	600282	南钢股份	956,283.00	2.69
40	688475	萤石网络	951,252.86	2.68
41	603885	吉祥航空	942,840.00	2.65
42	000039	中集集团	942,756.00	2.65
43	002958	青农商行	941,806.00	2.65
44	601928	凤凰传媒	935,016.00	2.63
45	603707	健友股份	934,023.00	2.63
46	603589	口子窖	931,764.00	2.62
47	688563	航材股份	929,881.06	2.62
48	000878	云南铜业	927,006.00	2.61
49	600486	扬农化工	913,100.00	2.57
50	002414	高德红外	910,291.00	2.56
51	600329	达仁堂	903,953.00	2.54
52	002318	久立特材	903,918.00	2.54
53	600583	海油工程	903,000.00	2.54
54	600820	隧道股份	899,593.00	2.53
55	601717	中创智领	897,456.00	2.52
56	000050	深天马 A	894,318.00	2.52
57	002299	圣农发展	892,479.00	2.51
58	000932	华菱钢铁	892,009.00	2.51
59	600707	彩虹股份	889,339.00	2.50
60	601666	平煤股份	883,502.00	2.49
61	300144	宋城演艺	882,786.00	2.48
62	603939	益丰药房	881,404.00	2.48

63	600295	鄂尔多斯	881,004.00	2.48
64	300070	碧水源	876,242.00	2.47
65	000060	中金岭南	872,971.00	2.46
66	600380	健康元	872,528.00	2.45
67	601179	中国西电	865,193.00	2.43
68	002603	以岭药业	862,783.00	2.43
69	002340	格林美	860,601.00	2.42
70	600258	首旅酒店	858,075.00	2.41
71	600765	中航重机	850,260.00	2.39
72	600685	中船防务	840,890.00	2.37
73	600578	京能电力	839,131.00	2.36
74	002273	水晶光电	836,539.00	2.35
75	600007	中国国贸	835,690.00	2.35
76	688100	威胜信息	833,473.36	2.34
77	600153	建发股份	832,163.00	2.34
78	600862	中航高科	831,268.00	2.34
79	600885	宏发股份	829,021.28	2.33
80	300001	特锐德	828,867.00	2.33
81	002080	中材科技	827,368.00	2.33
82	300496	中科创达	819,765.00	2.31
83	002128	电投能源	818,334.00	2.30
84	600118	中国卫星	815,552.00	2.29
85	000403	派林生物	814,338.70	2.29
86	600598	北大荒	810,482.00	2.28
87	000987	越秀资本	810,226.00	2.28
88	600801	华新建材	807,111.00	2.27
89	000960	锡业股份	806,928.00	2.27
90	002064	华峰化学	806,616.00	2.27
91	002508	老板电器	805,679.00	2.27
92	002926	华西证券	803,671.00	2.26
93	600528	中铁工业	802,254.00	2.26
94	601019	山东出版	799,246.00	2.25
95	000539	粤电力A	797,602.00	2.24
96	000683	博源化工	793,966.00	2.23
97	002429	兆驰股份	793,865.00	2.23
98	002472	双环传动	792,889.00	2.23
99	600663	陆家嘴	789,344.00	2.22
100	300567	精测电子	787,523.00	2.22
101	002409	雅克科技	783,953.00	2.21
102	600339	中油工程	781,540.00	2.20
103	002078	太阳纸业	780,143.00	2.19
104	601991	大唐发电	774,605.00	2.18
105	000066	中国长城	773,584.00	2.18

106	603858	步长制药	772,506.00	2.17
107	000887	中鼎股份	772,050.00	2.17
108	600754	锦江酒店	771,568.00	2.17
109	601061	中信金属	770,790.00	2.17
110	600688	上海石化	766,576.00	2.16
111	000009	中国宝安	766,212.52	2.16
112	600970	中材国际	759,652.00	2.14
113	600498	烽火通信	758,966.00	2.14
114	600032	浙江新能	741,074.00	2.08
115	603899	晨光股份	740,463.00	2.08
116	600516	方大炭素	740,188.00	2.08
117	605358	立昂微	739,741.00	2.08
118	600998	九州通	737,303.60	2.07
119	603056	德邦股份	734,410.00	2.07
120	002261	拓维信息	733,543.00	2.06
121	002430	杭氧股份	728,874.00	2.05
122	002203	海亮股份	726,763.00	2.04
123	600566	济川药业	726,757.00	2.04
124	002821	凯莱英	725,707.00	2.04
125	688295	中复神鹰	725,678.03	2.04
126	601965	中国汽研	724,117.86	2.04
127	002572	索菲亚	720,858.00	2.03
128	600612	老凤祥	715,713.00	2.01
129	002244	滨江集团	715,333.10	2.01
130	002756	永兴材料	711,079.00	2.00

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。

8.4.3 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	262,114,491.55
卖出股票收入（成交）总额	280,255,839.01

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注**8.12.1 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。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

8.12.3 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	8,733.66
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,278.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,012.16

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
平安中证 500 指数 增强 A	317	26,323.18	5,002,250.23	59.95	3,342,196.36	40.05
平安中证 500 指数 增强 C	1,076	8,823.70	0.00	0.00	9,494,303.23	100.00
合计	1,361	13,107.09	5,002,250.23	28.04	12,836,499.59	71.96

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例 (%)
基金管 理人所有从业 人员持有本基 金	平安中证 500 指数增强 A	16,079.87	0.1927
	平安中证 500 指数增强 C	-	-
	合计	16,079.87	0.0901

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 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	份额级别	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	平安中证 500 指数增强 A	0
	平安中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安中证 500 指数增强 A	0
	平安中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品的情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	5,002,250.23	28.04	10,000,000.00	56.06	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	5,002,250.23	28.04	10,000,000.00	56.06	3 年

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 27 日）基金份额总额	12,013,400.08	23,981,471.99
本报告期期初基金份额总额	16,590,522.16	17,947,713.80
本报告期基金总申购份额	2,451,827.24	20,860,480.19

减：本报告期基金总赎回份额	10,697,902.81	29,313,890.76
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,344,446.59	9,494,303.23

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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：本报告期内，李海波先生新任公司督察长，原督察长陈特正先生转任风控负责人；游自强先生新任公司信息技术负责人，副总经理林婉文女士不再兼任信息技术负责人。公司根据《中华人民共和国公司法》以及中国证监会《关于新〈公司法〉配套制度规则实施相关过渡期安排》等有关法律法规、监管规定完成了监事会改革工作，取消了监事会。

托管人：本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、本基金托管业务的诉讼或仲裁。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 4 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 5,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人相关从业人员的基金托管业务履职不涉及受调查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰海通证券	2	236,891,752.05	43.68	44,036.34	43.67	
华泰证券	3	172,877,225.05	31.87	32,139.20	31.88	
方正证券	2	132,601,353.46	24.45	24,651.81	24.45	
财通证券	1	-	-	-	-	
诚通证券	1	-	-	-	-	
德邦证券	2	-	-	-	-	
东方证券	3	-	-	-	-	
广发证券	3	-	-	-	-	
国海证券	1	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	
国联民生证券	2	-	-	-	-	
国盛证券	1	-	-	-	-	
国投证券	3	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
华福证券	2	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
华源证券	1	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申万宏源证券	2	-	-	-	-	
天风证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	2	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
浙商证券	2	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	

中泰证券	1	-	-	-	-
中信建投 证券	1	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-

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、报告期内新增交易单元的情况：新增华源证券交易单元 1 个，新增长江证券交易单元 1 个。

4、报告期内退租交易单元的情况：减少华泰证券交易单元 1 个，减少方正证券交易单元 1 个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰海通 证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生 证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-

国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 15 日
2	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 15 日
3	平安中证 500 指数增强型发起式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	2025 年 01 月 15 日
4	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 15 日
5	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 21 日
6	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	2025 年 02 月 08 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国泰君安证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 20 日
8	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 02 月 28 日

9	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 11 日
10	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 20 日
11	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 20 日
12	关于平安基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 20 日
13	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 25 日
14	平安中证 500 指数增强型发起式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	2025 年 03 月 25 日
15	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 27 日
16	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	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
17	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 21 日
18	平安基金管理有限公司关于新增大连网金基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 25 日
19	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
20	平安中证 500 指数增强型发起式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	2025 年 05 月 30 日
21	平安基金管理有限公司关于新增上海华夏财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 18 日
22	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 30 日
23	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 18 日
24	关于暂停鼎信汇金（北京）投资管理有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 23 日
25	关于“平安基金”APP 业务迁移的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 07 月 26 日
26	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 06 日
27	平安中证 500 指数增强型发起式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	2025 年 08 月 06 日

28	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 06 日
29	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 08 月 28 日
30	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	2025 年 10 月 01 日
31	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 25 日
32	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 10 月 25 日
33	平安基金管理有限公司关于旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 26 日
34	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 27 日
35	平安基金管理有限公司关于暂停中证金牛（北京）基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 12 月 31 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2025 年 01 月 01 日-2025 年 02 月 24 日； 2025 年 06 月 19 日-2025 年 12 月 31 日	10,002,250.23	0.00	5,000,000.00	5,002,250.23	28.04
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大

量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 日起，平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担，并相应修订各基金基金合同有关内容。本次调整后，基金管理人旗下全部指数基金指数使用费均由基金管理人承担。详细内容可阅读本公司于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于平安基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- （3）平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金托管协议
- （4）法律意见书
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

13.2 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

13.3 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 03 月 27 日