

# 平安恒生指数增强型证券投资基金 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

|                                         |           |
|-----------------------------------------|-----------|
| <b>§ 1 重要提示及目录</b>                      | <b>2</b>  |
| 1.1 重要提示                                | 2         |
| 1.2 目录                                  | 3         |
| <b>§ 2 基金简介</b>                         | <b>5</b>  |
| 2.1 基金基本情况                              | 5         |
| 2.2 基金产品说明                              | 5         |
| 2.3 基金管理人和基金托管人                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>                | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 10        |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>10</b> |
| 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              | 11        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 11        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 12        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 12        |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 13        |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 13        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>13</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 13        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13        |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 13        |
| <b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>              | <b>14</b> |
| 6.1 资产负债表                               | 14        |
| 6.2 利润表                                 | 15        |
| 6.3 净资产变动表                              | 16        |
| 6.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 7 投资组合报告</b>                       | <b>42</b> |
| 7.1 期末基金资产组合情况                          | 42        |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 43        |
| 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       | 43        |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 47        |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 48        |
| 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      | 48        |
| 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   | 48        |

|                                             |           |
|---------------------------------------------|-----------|
| 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 ..... | 48        |
| 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 .....    | 48        |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....                   | 48        |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....             | 49        |
| 7.12 投资组合报告附注 .....                         | 49        |
| <b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>                  | <b>50</b> |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                 | 50        |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....              | 50        |
| 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 .....      | 50        |
| <b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>                  | <b>51</b> |
| <b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>                    | <b>51</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 .....                      | 51        |
| 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 .....      | 51        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....           | 51        |
| 10.4 基金投资策略的改变 .....                        | 52        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                 | 52        |
| 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....          | 52        |
| 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 .....      | 52        |
| 10.8 其他重大事件 .....                           | 53        |
| <b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>            | <b>55</b> |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....    | 55        |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                   | 55        |
| <b>§ 12 备查文件目录 .....</b>                    | <b>55</b> |
| 12.1 备查文件目录 .....                           | 55        |
| 12.2 存放地点 .....                             | 55        |
| 12.3 查阅方式 .....                             | 55        |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

|                     |                  |                  |                |
|---------------------|------------------|------------------|----------------|
| 基金名称                | 平安恒生指数增强型证券投资基金  |                  |                |
| 基金简称                | 平安恒生指数增强         |                  |                |
| 基金主代码               | 025293           |                  |                |
| 基金运作方式              | 契约型开放式           |                  |                |
| 基金合同生效日             | 2025 年 11 月 4 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<br>额总额      | 543,674,068.57 份 |                  |                |
| 基金合同存续期             | 不定期              |                  |                |
| 下属分级基金的基<br>金简称     | 平安恒生指数增强 A       | 平安恒生指数增强 C       | 平安恒生指数增强 E     |
| 下属分级基金的交<br>易代码     | 025293           | 025294           | 025295         |
| 报告期末下属分级<br>基金的份额总额 | 227,511,918.33 份 | 313,900,916.38 份 | 2,261,233.86 份 |

2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 本基金为股票指数增强型基金，通过积极的指数组合管理与风险控制，追求超越业绩比较基准的投资收益。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资策略   | <p>本基金采用指数增强投资策略，以恒生指数为基金的标的指数，结合深入的宏观和基本面研究以及量化投资技术，动态调整投资组合，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>（1）指数化投资策略</p> <p>（2）指数增强型策略</p> <p>（3）股票组合调整</p> <p>（4）存托凭证的投资</p> <p>（5）除上述策略外，本基金可根据投资需要采取其他股票投资策略，包括事件驱动策略、定向增发策略、大宗交易策略等，力求从更多不同的维度获取超额收益，提高投资组合表现。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>4、金融衍生品投资策略</p> <p>（1）股指期货投资策略</p> <p>（2）股票期权投资策略</p> <p>（3）国债期货投资策略</p> <p>（4）信用衍生品投资策略</p> <p>5、融资与转融通证券出借业务投资策略</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，在履行适当程序后，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p> |
| 业绩比较基准 | 恒生指数收益率（经汇率调整）×95%+人民币银行活期存款利率（税后）×5%                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，预期风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为股票指数增强基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 本基金投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |

## 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 5033 号平安金融中心 34 层 | 广东省深圳市罗湖区深南东路 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 | 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) |                |             |
|---------------|-------------------------------------|----------------|-------------|
|               | 平安恒生指数增强 A                          | 平安恒生指数增强 C     | 平安恒生指数增强 E  |
| 本期已实现收益       | -2,203,015.68                       | -3,657,106.30  | -32,163.34  |
| 本期利润          | -27,892,483.79                      | -40,091,009.62 | -362,058.18 |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1006                             | -0.1028        | -0.1084     |
| 本期加权平         | -10.38%                             | -10.63%        | -11.21%     |

|                       |                       |                |              |
|-----------------------|-----------------------|----------------|--------------|
| 均净值利润<br>率            |                       |                |              |
| 本期基金份<br>额净值增长<br>率   | -12.22%               | -12.41%        | -12.41%      |
| 3.1.2 期<br>末数据和<br>指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                |              |
| 期末可供分<br>配利润          | -32,492,330.89        | -45,569,744.92 | -328,238.69  |
| 期末可供分<br>配基金份额<br>利润  | -0.1428               | -0.1452        | -0.1452      |
| 期末基金资<br>产净值          | 195,019,587.44        | 268,331,171.46 | 1,932,995.17 |
| 期末基金份<br>额净值          | 0.8572                | 0.8548         | 0.8548       |
| 3.1.3 累<br>计期末指<br>标  | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |                |              |
| 基金份额累<br>计净值增长<br>率   | -14.28%               | -14.52%        | -14.52%      |

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

平安恒生指数增强 A

| 阶段 | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|-----|-----|
|----|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|-----|-----|

|                |         |       |         |       |        |        |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去三个月          | -8.78%  | 0.98% | -8.74%  | 1.08% | -0.04% | -0.10% |
| 过去六个月          | -12.22% | 1.03% | -13.45% | 1.15% | 1.23%  | -0.12% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -14.28% | 0.90% | -15.86% | 1.11% | 1.58%  | -0.21% |

平安恒生指数增强 C

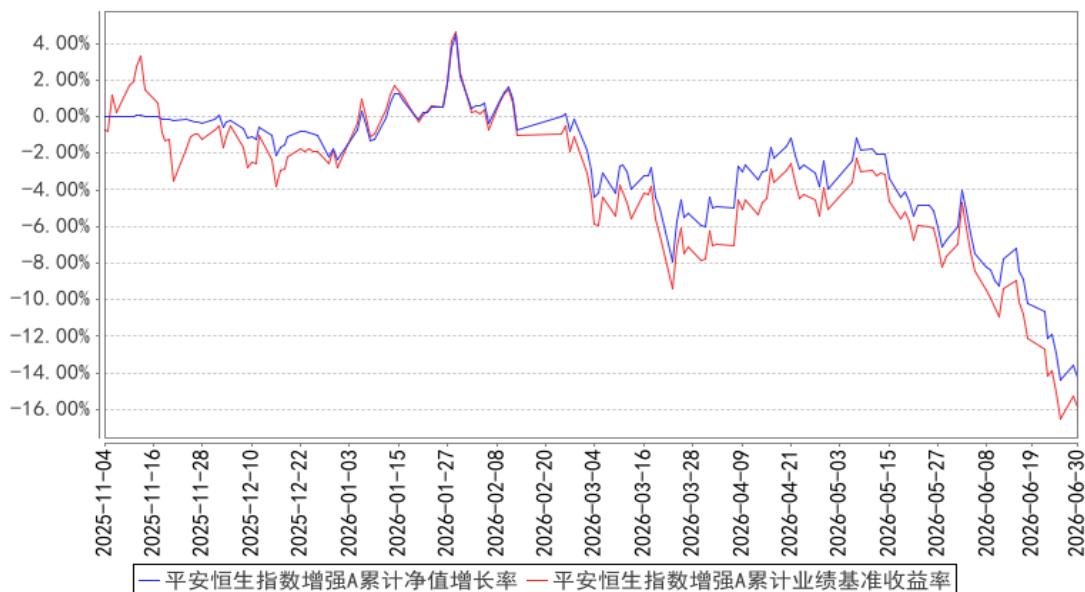
| 阶段             | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④    |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -8.88%       | 0.98%               | -8.74%         | 1.08%                 | -0.14% | -0.10% |
| 过去六个月          | -12.41%      | 1.03%               | -13.45%        | 1.15%                 | 1.04%  | -0.12% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -14.52%      | 0.90%               | -15.86%        | 1.11%                 | 1.34%  | -0.21% |

平安恒生指数增强 E

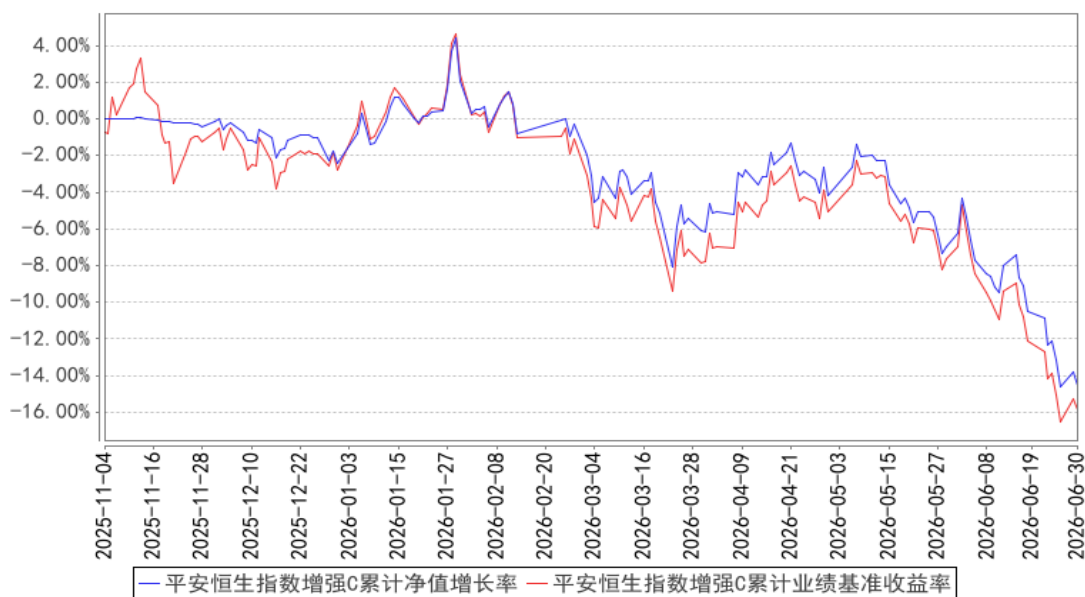
| 阶段             | 份额净值增<br>长率① | 份额净值增<br>长率标准差<br>② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①－③    | ②－④    |
|----------------|--------------|---------------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月          | -8.88%       | 0.98%               | -8.74%         | 1.08%                 | -0.14% | -0.10% |
| 过去六个月          | -12.41%      | 1.03%               | -13.45%        | 1.15%                 | 1.04%  | -0.12% |
| 自基金合同<br>生效起至今 | -14.52%      | 0.90%               | -15.86%        | 1.11%                 | 1.34%  | -0.21% |

### 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

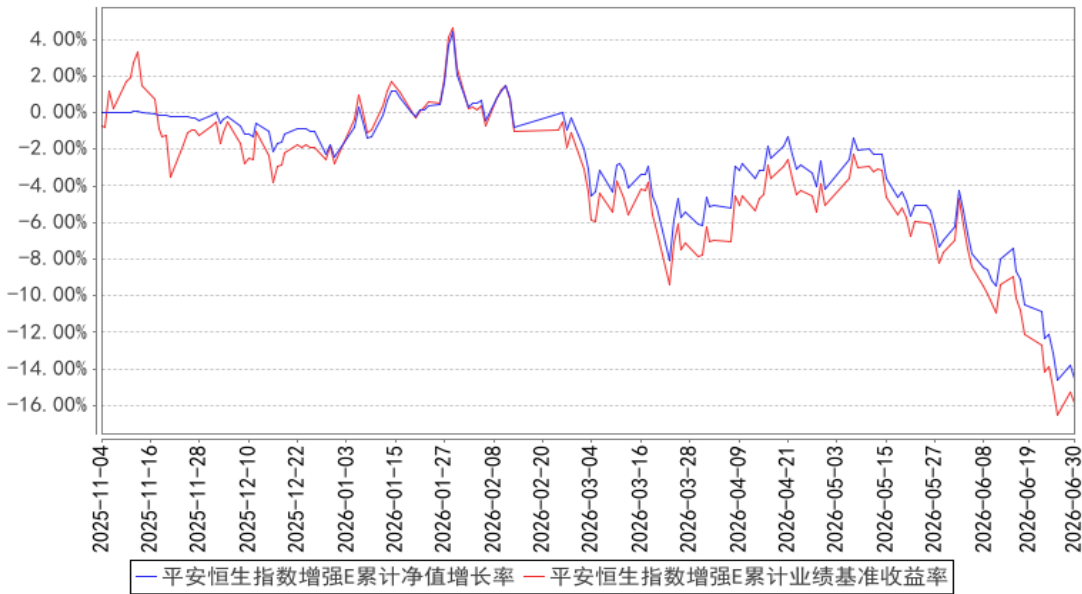
平安恒生指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安恒生指数增强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



平安恒生指数增强E累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2025 年 11 月 04 日正式生效，截至报告期末未满一年；

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 | 证券从 | 说明 |
|----|----|-----------|-----|----|
|----|----|-----------|-----|----|

|    |                     | (助理) 期限         |      | 业年限  |                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|----|---------------------|-----------------|------|------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |                     | 任职日期            | 离任日期 |      |                                                                                                                                                                                                                                                                               |
| 俞瑶 | 平安恒生指数增强型证券投资基金基金经理 | 2025 年 11 月 4 日 | -    | 15 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。 |

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

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

2026 年上半年，港股市场呈现“年初冲高、二季度震荡回调”的宽幅震荡行情，市场重心在经历估值修复后逐步进入基本面验证期，恒生指数最终震荡整固。在此背景下，本基金严格执行“核心被动跟踪及量化增强”的投资策略。在行业及板块配置上，遵循“红利防御为底仓，成长赛道动态优化”的均衡思路：一方面，中后期积极超配电信运营商、基础能源及大型国有银行等高股息、高现金流的红利价值资产，有效发挥了组合的“压舱石”防守作用；另一方面，标配并精选估值具备吸引力、且兼具 AI 催化与盈利改善的头部互联网科技蓝筹，同时通过量化模型前瞻性地低配了复苏承压的传统消费与医药生物板块，规避了阶段性回调损失。尽管二季度受市场风格剧烈轮动影响，组合超额收益波动较大，但通过多因子模型的动态调整与严格的风险预算控制，最终在复杂的市场环境下成功守住了超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安恒生指数增强 A 的基金份额净值 0.8572 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.22%，同期业绩比较基准收益率为-13.45%；截至本报告期末平安恒生指数增强 C 的基金份额净值 0.8548 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.41%，同期业绩比较基准收益率为-13.45%；截至本报告期末平安恒生指数增强 E 的基金份额净值 0.8548 元，本报告期基金份额净值增长率为-12.41%，同期业绩比较基准收益率为-13.45%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，港股市场在充分回调后，估值性价比与吸引力再度凸显，市场焦点有望从“流动性预期驱动”转向“企业基本面修复驱动”。本基金将继续维持“红利价值筑底、成长周期均衡”的布局思路，紧密跟踪中报业绩及宏观政策落地节奏，在低利率环境下继续坚守高股息红利资产与核心科技创新的双轮驱动，并适时捕捉周期板块的复苏弹性。量化操作上将持续迭代多因子模型，把严控跟踪误差作为首要任务，力争在多变的市场环境中持续为持有人获取稳健的阿尔法超

额回报。

#### 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：平安恒生指数增强型证券投资基金

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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|-------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产：        |         |                        |                          |
| 货币资金        | 6.4.7.1 | 31,402,422.26          | 66,695,702.25            |
| 结算备付金       |         | -                      | -                        |
| 存出保证金       |         | -                      | -                        |
| 交易性金融资产     | 6.4.7.2 | 438,770,273.48         | 655,906,425.28           |
| 其中：股票投资     |         | 438,770,273.48         | 655,906,425.28           |
| 基金投资        |         | -                      | -                        |
| 债券投资        |         | -                      | -                        |
| 资产支持证券投资    |         | -                      | -                        |
| 贵金属投资       |         | -                      | -                        |
| 其他投资        |         | -                      | -                        |
| 衍生金融资产      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 买入返售金融资产    | 6.4.7.4 | -                      | -                        |
| 应收清算款       |         | 6,383,238.10           | 23,264,048.90            |
| 应收股利        |         | 2,046,265.57           | 908,397.47               |
| 应收申购款       |         | 672,924.81             | -                        |
| 递延所得税资产     |         | -                      | -                        |
| 其他资产        | 6.4.7.8 | -                      | -                        |
| 资产总计        |         | 479,275,124.22         | 746,774,573.90           |
| 负 债 和 净 资 产 |         |                        |                          |
| 负 债：        |         |                        |                          |
| 短期借款        |         | -                      | -                        |
| 交易性金融负债     |         | -                      | -                        |
| 衍生金融负债      | 6.4.7.3 | -                      | -                        |
| 卖出回购金融资产款   |         | -                      | -                        |
| 应付清算款       |         | -                      | -                        |
| 应付赎回款       |         | 13,426,397.28          | -                        |
| 应付管理人报酬     |         | 340,745.86             | 514,505.92               |
| 应付托管费       |         | 42,593.23              | 64,313.22                |
| 应付销售服务费     |         | 99,184.02              | 149,854.35               |
| 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     | 6.4.7.9  | 82,449.76      | -              |
| 负债合计     |          | 13,991,370.15  | 728,673.49     |
| 净资产：     |          |                |                |
| 实收基金     | 6.4.7.10 | 543,674,068.57 | 764,294,373.86 |
| 未分配利润    | 6.4.7.12 | -78,390,314.50 | -18,248,473.45 |
| 净资产合计    |          | 465,283,754.07 | 746,045,900.41 |
| 负债和净资产总计 |          | 479,275,124.22 | 746,774,573.90 |

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 543,674,068.57 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8572 元，基金份额总额 227,511,918.33 份；下属 C 类基金份额净值 0.8548 元，基金份额总额 313,900,916.38 份；下属 E 类基金份额净值 0.8548 元，基金份额总额 2,261,233.86 份。

6.2 利润表

会计主体：平安恒生指数增强型证券投资基金

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6<br>月 30 日 |
|----------------------------|----------|------------------------------------------|
| 一、营业总收入                    |          | -64,573,796.23                           |
| 1. 利息收入                    |          | 14,303.98                                |
| 其中：存款利息收入                  | 6.4.7.13 | 14,303.98                                |
| 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）          |          | -2,388,739.95                            |
| 其中：股票投资收益                  | 6.4.7.14 | -10,343,625.29                           |
| 基金投资收益                     |          | -                                        |
| 债券投资收益                     | 6.4.7.15 | -                                        |
| 资产支持证券投资收益                 | 6.4.7.16 | -                                        |
| 贵金属投资收益                    | 6.4.7.17 | -                                        |
| 衍生工具收益                     | 6.4.7.18 | -                                        |
| 股利收益                       | 6.4.7.19 | 7,954,885.34                             |
| 以摊余成本计量的金融资<br>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<br>“-”号填列） | 6.4.7.20 | -62,453,266.27                           |

|                     |                |                   |
|---------------------|----------------|-------------------|
| 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    | 253, 906. 01      |
| 减：二、营业总支出           |                | 3, 771, 755. 36   |
| 1. 管理人报酬            | 6. 4. 10. 2. 1 | 2, 584, 269. 65   |
| 其中：暂估管理人报酬          |                | -                 |
| 2. 托管费              | 6. 4. 10. 2. 2 | 323, 033. 66      |
| 3. 销售服务费            | 6. 4. 10. 2. 3 | 757, 620. 56      |
| 4. 投资顾问费            |                | -                 |
| 5. 利息支出             |                | -                 |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |                | -                 |
| 6. 信用减值损失           | 6. 4. 7. 22    | -                 |
| 7. 税金及附加            |                | -                 |
| 8. 其他费用             | 6. 4. 7. 23    | 106, 831. 49      |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |                | -68, 345, 551. 59 |
| 减：所得税费用             |                | -                 |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |                | -68, 345, 551. 59 |
| 五、其他综合收益的税后净额       |                | -                 |
| 六、综合收益总额            |                | -68, 345, 551. 59 |

6.3 净资产变动表

会计主体：平安恒生指数增强型证券投资基金

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<br>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                           | 764, 294, 373. 86                     | -18, 248, 473. 45 | 746, 045, 900. 41  |
| 二、本期期初净资产                           | 764, 294, 373. 86                     | -18, 248, 473. 45 | 746, 045, 900. 41  |
| 三、本期增减变动额<br>（减少以“-”号填列）            | -220, 620, 305. 29                    | -60, 141, 841. 05 | -280, 762, 146. 34 |
| （一）、综合收益总额                          | -                                     | -68, 345, 551. 59 | -68, 345, 551. 59  |
| （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） | -220, 620, 305. 29                    | 8, 203, 710. 54   | -212, 416, 594. 75 |

|                                          |                 |                |                 |
|------------------------------------------|-----------------|----------------|-----------------|
| 其中：1. 基金申购款                              | 176,824,269.53  | -5,667,876.91  | 171,156,392.62  |
| 2. 基金赎回款                                 | -397,444,574.82 | 13,871,587.45  | -383,572,987.37 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | -               | -              | -               |
| 四、本期期末净资产                                | 543,674,068.57  | -78,390,314.50 | 465,283,754.07  |

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：

|            |            |           |
|------------|------------|-----------|
| <u>罗春风</u> | <u>肖宇鹏</u> | <u>马杰</u> |
| 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

平安恒生指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]1683 号文《关于准予平安恒生指数增强型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《平安恒生指数增强型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）作为管理人向社会公开募集，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2025）验字第 70039114\_H29 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《基金合同》于 2025 年 11 月 4 日正式生效。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金募集期间为 2025 年 10 月 15 日至 2025 年 10 月 31 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 764,205,976.59 元，在募集期间产生的活期存款利息为人民币 88,397.27 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 764,294,373.86 元，折合 764,294,373.86 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。

本基金初始基金份额分为 A 类基金份额、C 类基金份额和 E 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股及其备选成份股（包括存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票、港股通标的股票、存托凭证）、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（含

分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券等)、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等)、资产支持证券、同业存单、债券回购、货币市场工具、现金以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或中国证监会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,可以将其纳入本基金的投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份股及其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,应当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,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会允许基金变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

#### 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 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

#### 6.4.4.2 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。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形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。

#### 6.4.4.4 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的有关过去事项、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。

#### 6.4.4.5 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。

#### 6.4.4.6 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。

#### 6.4.4.7 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。

#### 6.4.4.8 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）”。

#### 6.4.4.9 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。

#### 6.4.4.10 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。

#### 6.4.4.11 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。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.4.14 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。

### 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款           | 593,516.49             |
| 等于：本金          | 593,464.56             |
| 加：应计利息         | 51.93                  |
| 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           | 30,808,905.77          |
| 等于：本金          | 30,808,407.70          |

|        |               |
|--------|---------------|
| 加：应计利息 | 498.07        |
| 合计     | 31,402,422.26 |

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商基金专用账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            |       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |      |                |                |
|---------------|-------|------------------------|------|----------------|----------------|
|               |       | 成本                     | 应计利息 | 公允价值           | 公允价值变动         |
| 股票            |       | 512,939,346.73         | -    | 438,770,273.48 | -74,169,073.25 |
| 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            |       | 512,939,346.73         | -    | 438,770,273.48 | -74,169,073.25 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

|    |
|----|
| 无。 |
|----|

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | 626.90                 |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付交易费用      | -                      |
| 其中：交易所市场    | -                      |
| 银行间市场       | -                      |
| 应付利息        | -                      |
| 预提费用        | 81,822.86              |
| 合计          | 82,449.76              |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

平安恒生指数增强 A

| 项目 | 本期<br>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          | 318,996,232.26  | 318,996,232.26  |
| 本期申购          | 47,009,013.46   | 47,009,013.46   |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -138,493,327.39 | -138,493,327.39 |
| 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           | 227,511,918.33  | 227,511,918.33  |

平安恒生指数增强 C

| 项目            | 本期<br>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          | 441,682,050.55                        | 441,682,050.55  |
| 本期申购          | 129,469,707.72                        | 129,469,707.72  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -257,250,841.89                       | -257,250,841.89 |
| 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           | 313,900,916.38                        | 313,900,916.38  |

平安恒生指数增强 E

| 项目            | 本期<br>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          | 3,616,091.05                          | 3,616,091.05  |
| 本期申购          | 345,548.35                            | 345,548.35    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,700,405.54                         | -1,700,405.54 |
| 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           | 2,261,233.86                          | 2,261,233.86  |

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

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

平安恒生指数增强 A

| 项目   | 已实现部分         | 未实现部分         | 未分配利润合计       |
|------|---------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | -2,611,934.33 | -4,891,116.67 | -7,503,051.00 |

|                |               |                |                |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 本期期初           | -2,611,934.33 | -4,891,116.67  | -7,503,051.00  |
| 本期利润           | -2,203,015.68 | -25,689,468.11 | -27,892,483.79 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,001,547.77  | 1,901,656.13   | 2,903,203.90   |
| 其中：基金申购款       | -565,811.20   | -926,258.87    | -1,492,070.07  |
| 基金赎回款          | 1,567,358.97  | 2,827,915.00   | 4,395,273.97   |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | -3,813,402.24 | -28,678,928.65 | -32,492,330.89 |

平安恒生指数增强 C

| 项目             | 已实现部分         | 未实现部分          | 未分配利润合计        |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 上年度末           | -3,888,893.36 | -6,769,269.68  | -10,658,163.04 |
| 本期期初           | -3,888,893.36 | -6,769,269.68  | -10,658,163.04 |
| 本期利润           | -3,657,106.30 | -36,433,903.32 | -40,091,009.62 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 1,490,209.31  | 3,689,218.43   | 5,179,427.74   |
| 其中：基金申购款       | -1,808,965.83 | -2,354,647.66  | -4,163,613.49  |
| 基金赎回款          | 3,299,175.14  | 6,043,866.09   | 9,343,041.23   |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | -6,055,790.35 | -39,513,954.57 | -45,569,744.92 |

平安恒生指数增强 E

| 项目             | 已实现部分      | 未实现部分       | 未分配利润合计     |
|----------------|------------|-------------|-------------|
| 上年度末           | -31,838.78 | -55,420.63  | -87,259.41  |
| 本期期初           | -31,838.78 | -55,420.63  | -87,259.41  |
| 本期利润           | -32,163.34 | -329,894.84 | -362,058.18 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 20,368.80  | 100,710.10  | 121,078.90  |
| 其中：基金申购款       | -4,687.26  | -7,506.09   | -12,193.35  |
| 基金赎回款          | 25,056.06  | 108,216.19  | 133,272.25  |
| 本期已分配利润        | -          | -           | -           |
| 本期末            | -43,633.32 | -284,605.37 | -328,238.69 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 3,395.59                              |
| 定期存款利息收入  | -                                     |
| 其他存款利息收入  | 10,908.39                             |
| 结算备付金利息收入 | -                                     |
| 其他        | -                                     |
| 合计        | 14,303.98                             |

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

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期<br>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 | -10,343,625.29             |
| 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               | -10,343,625.29             |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 398,400,545.40             |
| 减：卖出股票成本总额 | 407,888,165.14             |
| 减：交易费用     | 856,005.55                 |
| 买卖股票差价收入   | -10,343,625.29             |

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------------|---------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 7,954,885.34                          |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                     |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                     |
| 合计            | 7,954,885.34                          |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -62,453,266.27                        |
| 股票投资       | -62,453,266.27                        |
| 债券投资       | -                                     |
| 资产支持证券投资   | -                                     |

|                        |                |
|------------------------|----------------|
| 基金投资                   | -              |
| 贵金属投资                  | -              |
| 其他                     | -              |
| 2. 衍生工具                | -              |
| 权证投资                   | -              |
| 3. 其他                  | -              |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -              |
| 合计                     | -62,453,266.27 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | 253,101.82                            |
| 基金转换费收入 | 804.19                                |
| 合计      | 253,906.01                            |

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《平安恒生指数增强型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。

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---------|---------------------------------------|
| 审计费用    | 22,315.49                             |
| 信息披露费   | 59,507.37                             |
| 证券出借违约金 | -                                     |
| 其他      | 25,008.63                             |
| 合计      | 106,831.49                            |

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、注册登记机构、基金销售机构         |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”）       | 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                   |
| 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               |

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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----|---------------------------------------|
|----|---------------------------------------|

|                  |              |
|------------------|--------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费   | 2,584,269.65 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 917,323.58   |
| 应支付基金管理人的净管理费    | 1,666,946.07 |

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 0.80%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×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|----------------|---------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 323,033.66                            |

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

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |                |                |            |
|----------------|---------------------------------------|----------------|----------------|------------|
|                | 当期发生的基金应支付的销售服务费                      |                |                |            |
|                | 平安恒生指数增<br>强 A                        | 平安恒生指数增<br>强 C | 平安恒生指数增<br>强 E | 合计         |
| 陆基金            | -                                     | 22.83          | 0.11           | 22.94      |
| 平安基金           | -                                     | 13,518.25      | -              | 13,518.25  |
| 平安人寿           | -                                     | 32.90          | 1.07           | 33.97      |
| 平安银行           | -                                     | 568,656.72     | 5,474.70       | 574,131.42 |
| 合计             | -                                     | 582,230.70     | 5,475.88       | 587,706.58 |

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 0.40%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×0.40%/当年天数；

支付基金销售机构的销售服务费按 E 类基金份额前一日基金资产净值 0.40%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 E 类基金份额销售服务费＝前一日 E 类基金份额基金资产净值×0.40%/当年天数。

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：本基金本报告期末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：本基金本报告期内转融通证券出借业务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：本基金本报告期内转融通证券出借业务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

注：无。

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 |          |
|         | 期末余额                            | 当期利息收入   |
| 平安银行-活期 | 593,516.49                      | 3,395.59 |

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：本基金本报告期末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

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日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

可变现资产的可变现价值。

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

6. 4. 13. 4 市场风险

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

6. 4. 13. 4. 1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6. 4. 13. 4. 1. 1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>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                   | 31,402,422.26 | -     | -     | -              | 31,402,422.26  |
| 交易性金融资产                | -             | -     | -     | 438,770,273.48 | 438,770,273.48 |
| 应收股利                   | -             | -     | -     | 2,046,265.57   | 2,046,265.57   |
| 应收申购款                  | -             | -     | -     | 672,924.81     | 672,924.81     |
| 应收清算款                  | -             | -     | -     | 6,383,238.10   | 6,383,238.10   |
| 资产总计                   | 31,402,422.26 | -     | -     | 447,872,701.96 | 479,275,124.22 |
| 负债                     |               |       |       |                |                |
| 应付赎回款                  | -             | -     | -     | 13,426,397.28  | 13,426,397.28  |
| 应付管理人报酬                | -             | -     | -     | 340,745.86     | 340,745.86     |
| 应付托管费                  | -             | -     | -     | 42,593.23      | 42,593.23      |

|                          |               |       |       |                 |                |
|--------------------------|---------------|-------|-------|-----------------|----------------|
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 99,184.02       | 99,184.02      |
| 其他负债                     | -             | -     | -     | 82,449.76       | 82,449.76      |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 13,991,370.15   | 13,991,370.15  |
| 利率敏感度缺口                  | 31,402,422.26 | -     | -     | -433,881,331.81 | 465,283,754.07 |
| 上年度末<br>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                     | 66,695,702.25 | -     | -     | -               | 66,695,702.25  |
| 交易性金融资产                  | -             | -     | -     | -655,906,425.28 | 655,906,425.28 |
| 应收股利                     | -             | -     | -     | 908,397.47      | 908,397.47     |
| 应收清算款                    | -             | -     | -     | -23,264,048.90  | 23,264,048.90  |
| 资产总计                     | 66,695,702.25 | -     | -     | -680,078,871.65 | 746,774,573.90 |
| 负债                       |               |       |       |                 |                |
| 应付管理人报酬                  | -             | -     | -     | 514,505.92      | 514,505.92     |
| 应付托管费                    | -             | -     | -     | 64,313.22       | 64,313.22      |
| 应付销售服务费                  | -             | -     | -     | 149,854.35      | 149,854.35     |
| 负债总计                     | -             | -     | -     | 728,673.49      | 728,673.49     |
| 利率敏感度缺口                  | 66,695,702.25 | -     | -     | -679,350,198.16 | 746,045,900.41 |

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交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |                |               |                |
|----------|------------------------|----------------|---------------|----------------|
|          | 美元<br>折合人民币            | 港币<br>折合人民币    | 其他币种<br>折合人民币 | 合计             |
| 以外币计价的资产 |                        |                |               |                |
| 交易性金融资产  | -                      | 438,770,273.48 | -             | 438,770,273.48 |
| 资产合计     | -                      | 438,770,273.48 | -             | 438,770,273.48 |

|                       |                          |                   |               |                   |
|-----------------------|--------------------------|-------------------|---------------|-------------------|
| 以外币计价的<br>负债          |                          |                   |               |                   |
| 负债合计                  | -                        | -                 | -             | -                 |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 438, 770, 273. 48 | -             | 438, 770, 273. 48 |
| 项目                    | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |                   |               |                   |
|                       | 美元<br>折合人民<br>币          | 港币<br>折合人民币       | 其他币种<br>折合人民币 | 合计                |
| 以外币计价的<br>资产          |                          |                   |               |                   |
| 交易性金融资<br>产           | -                        | 655, 906, 425. 28 | -             | 655, 906, 425. 28 |
| 资产合计                  | -                        | 655, 906, 425. 28 | -             | 655, 906, 425. 28 |
| 以外币计价的<br>负债          |                          |                   |               |                   |
| 负债合计                  | -                        | -                 | -             | -                 |
| 资产负债表外<br>汇风险敞口净<br>额 | -                        | 655, 906, 425. 28 | -             | 655, 906, 425. 28 |

6. 4. 13. 4. 2. 2 外汇风险的敏感性分析

|    |                     |                                 |                            |
|----|---------------------|---------------------------------|----------------------------|
| 假设 | 除市场汇率以外的其他市场变量保持不变  |                                 |                            |
| 分析 | 相关风险变量的变<br>动       | 对资产负债表日基金资产净值的<br>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<br>31 日） |
|    | 所有外币相对于人<br>民币升值 5% | 21, 938, 513. 67                | 32, 795, 321. 26           |
|    | 所有外币相对于人<br>民币贬值 5% | -21, 938, 513. 67               | -32, 795, 321. 26          |

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<br>2026 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末<br>2025年12月31日 |                  |
|---------------|------------------------|------------------|---------------------|------------------|
|               | 公允价值                   | 占基金资产净值<br>比例（%） | 公允价值                | 占基金资产净值<br>比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资  | 438,770,273.48         | 94.30            | 655,906,425.28      | 87.92            |
| 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            | 438,770,273.48         | 94.30            | 655,906,425.28      | 87.92            |

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%            | 12,119,301.39               | 1,204,310.84           |
|    | 沪深 300 指数下降 5%            | -12,119,301.39              | -1,204,310.84          |

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：<br><br>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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次          | 438,770,273.48         | 655,906,425.28           |
| 第二层次          | -                      | -                        |
| 第三层次          | -                      | -                        |
| 合计            | 438,770,273.48         | 655,906,425.28           |

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<br>(%) |
|----|------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资 | 438,770,273.48 | 91.55            |

|   |                   |                |        |
|---|-------------------|----------------|--------|
|   | 其中：股票             | 438,770,273.48 | 91.55  |
| 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      | 31,402,422.26  | 6.55   |
| 8 | 其他各项资产            | 9,102,428.48   | 1.90   |
| 9 | 合计                | 479,275,124.22 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 438,770,273.48 元，占净值比例 94.30%。

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

注：本基金本报告期末未持有指数投资的境内股票。

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 原材料     | 16,076,365.45  | 3.46         |
| 周期性消费品  | 15,175,032.01  | 3.26         |
| 非周期性消费品 | 62,711,089.65  | 13.48        |
| 能源      | 20,091,828.42  | 4.32         |
| 金融      | 147,175,964.26 | 31.63        |
| 医疗      | 15,756,792.87  | 3.39         |
| 工业      | 32,243,194.67  | 6.93         |
| 地产业     | 20,610,229.43  | 4.43         |
| 信息技术    | 45,541,964.13  | 9.79         |
| 电信服务    | 55,217,666.72  | 11.87        |
| 公用事业    | 8,170,145.87   | 1.76         |
| 合计      | 438,770,273.48 | 94.30        |

注：以上分类采用全球行业分类标准。

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<br>(股) | 公允价值 (元)      | 占基金资产净值比例<br>(%) |
|----|-------|--------|-----------|---------------|------------------|
| 1  | 00005 | 汇丰控股   | 327,200   | 42,031,635.92 | 9.03             |
| 2  | 00700 | 腾讯控股   | 90,200    | 33,671,911.66 | 7.24             |
| 3  | 01299 | 友邦保险   | 428,200   | 26,573,191.71 | 5.71             |
| 4  | 09988 | 阿里巴巴-W | 327,000   | 26,370,871.67 | 5.67             |
| 5  | 00939 | 建设银行   | 3,678,000 | 25,779,832.08 | 5.54             |
| 6  | 03988 | 中国银行   | 3,610,000 | 15,645,972.85 | 3.36             |
| 7  | 00941 | 中国移动   | 211,000   | 13,955,557.41 | 3.00             |
| 8  | 00388 | 香港交易所  | 42,600    | 13,431,083.49 | 2.89             |
| 9  | 00883 | 中国海洋石油 | 731,000   | 12,901,372.22 | 2.77             |
| 10 | 01810 | 小米集团-W | 617,200   | 11,600,534.46 | 2.49             |
| 11 | 00981 | 中芯国际   | 129,500   | 10,055,463.92 | 2.16             |
| 12 | 01113 | 长实集团   | 244,500   | 9,382,085.79  | 2.02             |
| 13 | 03690 | 美团-W   | 150,700   | 8,965,998.22  | 1.93             |
| 14 | 01398 | 工商银行   | 1,248,000 | 6,969,801.07  | 1.50             |
| 15 | 00001 | 长和     | 99,000    | 5,696,602.31  | 1.22             |
| 16 | 00175 | 吉利汽车   | 349,000   | 5,110,669.80  | 1.10             |
| 17 | 00669 | 创科实业   | 44,500    | 5,005,236.51  | 1.08             |
| 18 | 02388 | 中银香港   | 135,500   | 4,987,639.69  | 1.07             |
| 19 | 01378 | 中国宏桥   | 275,000   | 4,791,356.08  | 1.03             |
| 20 | 00012 | 恒基地产   | 204,000   | 4,394,168.16  | 0.94             |
| 21 | 01211 | 比亚迪股份  | 69,100    | 4,348,217.52  | 0.93             |
| 22 | 01024 | 快手-W   | 108,800   | 3,931,126.78  | 0.84             |
| 23 | 00002 | 中电控股   | 57,500    | 3,655,726.95  | 0.79             |
| 24 | 00066 | 港铁公司   | 136,500   | 3,615,990.79  | 0.78             |
| 25 | 01044 | 恒安国际   | 190,000   | 3,587,632.63  | 0.77             |
| 26 | 00016 | 新鸿基地产  | 34,000    | 3,316,297.61  | 0.71             |
| 27 | 00992 | 联想集团   | 160,000   | 3,199,043.36  | 0.69             |
| 28 | 01088 | 中国神华   | 89,500    | 3,118,737.23  | 0.67             |
| 29 | 02269 | 药明生物   | 100,500   | 3,020,208.92  | 0.65             |
| 30 | 01801 | 信达生物   | 43,000    | 2,972,872.94  | 0.64             |
| 31 | 02899 | 紫金矿业   | 122,000   | 2,903,388.94  | 0.62             |
| 32 | 09992 | 泡泡玛特   | 21,000    | 2,821,658.39  | 0.61             |
| 33 | 00288 | 万洲国际   | 374,500   | 2,696,504.67  | 0.58             |
| 34 | 01109 | 华润置地   | 95,000    | 2,475,367.50  | 0.53             |
| 35 | 00857 | 中国石油股份 | 322,000   | 2,371,627.89  | 0.51             |
| 36 | 03750 | 宁德时代   | 3,700     | 2,255,971.77  | 0.48             |
| 37 | 01876 | 百威亚太   | 375,200   | 1,987,867.76  | 0.43             |
| 38 | 02020 | 安踏体育   | 31,600    | 1,950,051.09  | 0.42             |
| 39 | 00027 | 银河娱乐   | 75,000    | 1,916,455.58  | 0.41             |
| 40 | 02057 | 中通快递-W | 12,500    | 1,863,039.75  | 0.40             |
| 41 | 00762 | 中国联通   | 304,000   | 1,613,279.51  | 0.35             |
| 42 | 02015 | 理想汽车-W | 38,400    | 1,536,874.91  | 0.33             |

|    |       |          |         |              |      |
|----|-------|----------|---------|--------------|------|
| 43 | 02359 | 药明康德     | 11,400  | 1,521,855.94 | 0.33 |
| 44 | 09633 | 农夫山泉     | 44,200  | 1,521,008.23 | 0.33 |
| 45 | 02331 | 李宁       | 100,500 | 1,284,898.13 | 0.28 |
| 46 | 02319 | 蒙牛乳业     | 82,000  | 1,145,947.50 | 0.25 |
| 47 | 00006 | 电能实业     | 22,000  | 1,091,072.51 | 0.23 |
| 48 | 03692 | 翰森制药     | 42,000  | 1,080,510.94 | 0.23 |
| 49 | 00968 | 信义光能     | 596,000 | 1,066,370.95 | 0.23 |
| 50 | 00291 | 华润啤酒     | 54,500  | 1,007,309.55 | 0.22 |
| 51 | 01177 | 中国生物制药   | 261,000 | 999,709.74   | 0.21 |
| 52 | 03993 | 洛阳钼业     | 75,000  | 988,844.18   | 0.21 |
| 53 | 01093 | 石药集团     | 158,000 | 956,499.37   | 0.21 |
| 54 | 00003 | 香港中华煤气   | 159,000 | 897,646.43   | 0.19 |
| 55 | 00688 | 中国海外发展   | 76,500  | 801,315.54   | 0.17 |
| 56 | 02382 | 舜宇光学科技   | 15,000  | 794,723.25   | 0.17 |
| 57 | 00267 | 中信股份     | 84,000  | 774,086.50   | 0.17 |
| 58 | 02628 | 中国人寿     | 27,000  | 625,199.66   | 0.13 |
| 59 | 03968 | 招商银行     | 14,000  | 546,213.72   | 0.12 |
| 60 | 00386 | 中国石油化工股份 | 118,000 | 409,955.60   | 0.09 |
| 61 | 06618 | 京东健康     | 9,900   | 282,379.50   | 0.06 |
| 62 | 00728 | 中国电信     | 76,000  | 281,861.85   | 0.06 |
| 63 | 06690 | 海尔智家     | 16,000  | 277,658.06   | 0.06 |
| 64 | 00836 | 华润电力     | 18,000  | 264,525.59   | 0.06 |
| 65 | 00300 | 美的集团     | 3,100   | 222,400.91   | 0.05 |
| 66 | 01099 | 国药控股     | 9,600   | 132,658.85   | 0.03 |
| 67 | 02313 | 申洲国际     | 3,700   | 126,488.67   | 0.03 |
| 68 | 02618 | 京东物流     | 11,900  | 121,445.00   | 0.03 |
| 69 | 01997 | 九龙仓置业    | 6,000   | 111,417.59   | 0.02 |
| 70 | 01928 | 金沙中国有限公司 | 9,600   | 108,811.94   | 0.02 |
| 71 | 02688 | 新奥能源     | 3,000   | 105,424.60   | 0.02 |
| 72 | 00868 | 信义玻璃     | 13,000  | 96,313.51    | 0.02 |
| 73 | 06862 | 海底捞      | 9,000   | 83,016.01    | 0.02 |
| 74 | 01209 | 华润万象生活   | 2,600   | 82,831.88    | 0.02 |
| 75 | 00241 | 阿里健康     | 30,000  | 80,254.02    | 0.02 |
| 76 | 01929 | 周大福      | 8,200   | 77,631.00    | 0.02 |
| 77 | 00285 | 比亚迪电子    | 3,000   | 54,510.20    | 0.01 |
| 78 | 00960 | 龙湖集团     | 9,000   | 46,745.36    | 0.01 |
| 79 | 01038 | 长江基建集团   | 500     | 25,926.22    | 0.01 |
| 80 | 00322 | 康师傅控股    | 2,000   | 16,988.84    | 0.00 |

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 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例 |
|----|------|------|----|---------|-----------|
|----|------|------|----|---------|-----------|

|    | 码     |                | (股)       |              | (%)  |
|----|-------|----------------|-----------|--------------|------|
| 1  | 00148 | 建滔集团           | 78,500    | 8,038,560.53 | 1.73 |
| 2  | 00696 | 中国民航信息网络       | 669,000   | 4,694,964.40 | 1.01 |
| 3  | 00303 | VTECH HOLDINGS | 86,800    | 3,878,822.70 | 0.83 |
| 4  | 00019 | 太古股份公司 A       | 51,000    | 3,618,987.29 | 0.78 |
| 5  | 06963 | 阳光保险           | 1,092,500 | 3,226,228.98 | 0.69 |
| 6  | 03877 | 中国船舶租赁         | 1,676,000 | 3,144,289.97 | 0.68 |
| 7  | 01766 | 中国中车           | 617,000   | 2,406,170.12 | 0.52 |
| 8  | 01114 | BRILLIANCE CHI | 1,448,000 | 2,402,131.36 | 0.52 |
| 9  | 00270 | 粤海投资           | 316,000   | 2,129,823.57 | 0.46 |
| 10 | 01186 | 中国铁建           | 532,000   | 2,111,653.50 | 0.45 |
| 11 | 00576 | 浙江沪杭甬          | 400,000   | 2,060,200.60 | 0.44 |
| 12 | 00142 | 第一太平           | 492,000   | 2,051,167.68 | 0.44 |
| 13 | 01128 | 永利澳门           | 434,400   | 1,905,355.51 | 0.41 |
| 14 | 00546 | 阜丰集团           | 418,000   | 1,717,244.95 | 0.37 |
| 15 | 06818 | 中国光大银行         | 674,000   | 1,715,229.91 | 0.37 |
| 16 | 01513 | 丽珠医药           | 78,800    | 1,634,388.75 | 0.35 |
| 17 | 03339 | 中国龙工           | 721,000   | 1,628,183.83 | 0.35 |
| 18 | 03969 | 中国通号           | 563,000   | 1,564,779.68 | 0.34 |
| 19 | 01066 | 威高股份           | 549,600   | 1,513,215.60 | 0.33 |
| 20 | 02877 | 神威药业           | 179,000   | 1,147,371.92 | 0.25 |
| 21 | 00440 | 大新金融           | 34,800    | 1,140,107.37 | 0.25 |
| 22 | 02356 | 大新银行集团         | 110,800   | 1,113,442.88 | 0.24 |
| 23 | 06869 | 长飞光纤光缆         | 5,000     | 1,109,138.35 | 0.24 |
| 24 | 02099 | 中国黄金国际         | 10,100    | 1,074,613.49 | 0.23 |
| 25 | 01883 | 中信国际电讯         | 473,000   | 1,014,735.65 | 0.22 |
| 26 | 01258 | 中国有色矿业         | 102,000   | 996,661.13   | 0.21 |
| 27 | 02689 | 玖龙纸业           | 163,000   | 966,948.03   | 0.21 |
| 28 | 00179 | 德昌电机控股         | 49,000    | 826,069.22   | 0.18 |
| 29 | 03613 | 同仁堂国药          | 142,000   | 797,971.63   | 0.17 |
| 30 | 01530 | 三生制药           | 53,000    | 777,499.90   | 0.17 |
| 31 | 01999 | 敏华控股           | 284,000   | 737,537.92   | 0.16 |
| 32 | 06693 | 赤峰黄金           | 36,000    | 718,534.04   | 0.15 |
| 33 | 00934 | 中石化冠德          | 224,000   | 682,888.75   | 0.15 |
| 34 | 00293 | 国泰航空           | 56,000    | 631,331.62   | 0.14 |
| 35 | 03668 | 兖煤澳大利亚         | 23,700    | 607,246.73   | 0.13 |
| 36 | 01361 | 3 6 1 度        | 163,000   | 569,126.07   | 0.12 |
| 37 | 00788 | 中国铁塔           | 68,000    | 520,330.93   | 0.11 |
| 38 | 00297 | 中化化肥           | 454,000   | 504,731.78   | 0.11 |
| 39 | 00551 | 裕元集团           | 47,000    | 500,067.66   | 0.11 |

|    |       |        |        |            |      |
|----|-------|--------|--------|------------|------|
| 40 | 02631 | 天岳先进   | 4,500  | 395,146.82 | 0.08 |
| 41 | 01199 | 中远海运港口 | 92,000 | 357,981.57 | 0.08 |
| 42 | 01368 | 特步国际   | 93,000 | 303,714.56 | 0.07 |
| 43 | 00881 | 中升控股   | 63,000 | 265,385.45 | 0.06 |
| 44 | 01658 | 邮储银行   | 62,000 | 246,094.96 | 0.05 |
| 45 | 00811 | 新华文轩   | 31,000 | 228,862.93 | 0.05 |
| 46 | 01208 | 五矿资源   | 36,000 | 216,998.53 | 0.05 |
| 47 | 02865 | 钧达股份   | 8,400  | 156,276.46 | 0.03 |
| 48 | 02259 | 紫金黄金国际 | 1,700  | 130,673.35 | 0.03 |

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  | 00700 | 腾讯控股   | 30,174,807.47 | 4.04           |
| 2  | 09988 | 阿里巴巴-W | 10,425,933.78 | 1.40           |
| 3  | 00981 | 中芯国际   | 9,496,642.59  | 1.27           |
| 4  | 02388 | 中银香港   | 7,656,770.13  | 1.03           |
| 5  | 00005 | 汇丰控股   | 7,369,322.67  | 0.99           |
| 6  | 03690 | 美团-W   | 6,949,312.41  | 0.93           |
| 7  | 00762 | 中国联通   | 6,937,735.36  | 0.93           |
| 8  | 01211 | 比亚迪股份  | 6,554,453.46  | 0.88           |
| 9  | 01299 | 友邦保险   | 5,111,204.20  | 0.69           |
| 10 | 02099 | 中国黄金国际 | 4,973,250.59  | 0.67           |
| 11 | 00939 | 建设银行   | 4,853,936.98  | 0.65           |
| 12 | 00669 | 创科实业   | 4,759,880.90  | 0.64           |
| 13 | 01876 | 百威亚太   | 4,512,132.46  | 0.60           |
| 14 | 00016 | 新鸿基地产  | 4,214,919.99  | 0.56           |
| 15 | 01088 | 中国神华   | 4,204,802.46  | 0.56           |
| 16 | 09992 | 泡泡玛特   | 4,057,341.06  | 0.54           |
| 17 | 02899 | 紫金矿业   | 3,982,903.92  | 0.53           |
| 18 | 02269 | 药明生物   | 3,896,839.08  | 0.52           |
| 19 | 01530 | 三生制药   | 3,884,325.96  | 0.52           |
| 20 | 01801 | 信达生物   | 3,767,378.59  | 0.50           |

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  | 00700 | 腾讯控股 | 34,714,995.58 | 4.65           |
| 2  | 01299 | 友邦保险 | 25,271,054.37 | 3.39           |
| 3  | 00939 | 建设银行 | 25,040,483.23 | 3.36           |

|    |       |          |               |      |
|----|-------|----------|---------------|------|
| 4  | 00005 | 汇丰控股     | 20,168,789.36 | 2.70 |
| 5  | 09988 | 阿里巴巴-W   | 19,434,202.27 | 2.60 |
| 6  | 03988 | 中国银行     | 16,589,512.63 | 2.22 |
| 7  | 00883 | 中国海洋石油   | 16,546,076.16 | 2.22 |
| 8  | 00941 | 中国移动     | 14,769,229.03 | 1.98 |
| 9  | 00388 | 香港交易所    | 14,534,708.45 | 1.95 |
| 10 | 01378 | 中国宏桥     | 11,870,392.16 | 1.59 |
| 11 | 01113 | 长实集团     | 11,255,986.17 | 1.51 |
| 12 | 01810 | 小米集团-W   | 10,844,175.57 | 1.45 |
| 13 | 00001 | 长和       | 8,473,967.85  | 1.14 |
| 14 | 00012 | 恒基地产     | 8,444,265.84  | 1.13 |
| 15 | 00175 | 吉利汽车     | 8,272,605.95  | 1.11 |
| 16 | 00288 | 万洲国际     | 7,336,683.23  | 0.98 |
| 17 | 00066 | 港铁公司     | 7,256,072.36  | 0.97 |
| 18 | 00696 | 中国民航信息网络 | 7,187,879.96  | 0.96 |
| 19 | 00551 | 裕元集团     | 6,860,991.93  | 0.92 |
| 20 | 00148 | 建滔集团     | 6,387,367.73  | 0.86 |

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 | 253,205,279.61 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 398,400,545.40 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司、中国银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称    | 金额           |
|----|-------|--------------|
| 1  | 存出保证金 | -            |
| 2  | 应收清算款 | 6,383,238.10 |
| 3  | 应收股利  | 2,046,265.57 |
| 4  | 应收利息  | -            |
| 5  | 应收申购款 | 672,924.81   |
| 6  | 其他应收款 | -            |
| 7  | 待摊费用  | -            |
| 8  | 其他    | -            |
| 9  | 合计    | 9,102,428.48 |

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

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

份额单位：份

| 份额级别              | 持有人<br>户数<br>(户) | 户均持有的基<br>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<br>额比例<br>(%) | 持有份额           | 占总份<br>额比例<br>(%) |
| 平安恒生<br>指数增强<br>A | 2,688            | 84,639.85     | 5,514,335.11  | 2.42              | 221,997,583.22 | 97.58             |
| 平安恒生<br>指数增强<br>C | 2,565            | 122,378.52    | 47,813,933.74 | 15.23             | 266,086,982.64 | 84.77             |
| 平安恒生<br>指数增强<br>E | 137              | 16,505.36     | 0.00          | 0.00              | 2,261,233.86   | 100.00            |
| 合计                | 5,303            | 102,521.98    | 53,328,268.85 | 9.81              | 490,345,799.72 | 90.19             |

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）。

8.2 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<br>（%） |
|------------------------------|------------|------------|-----------------|
| 基金管<br>理人所有从业<br>人员持有本基<br>金 | 平安恒生指数增强 A | -          | -               |
|                              | 平安恒生指数增强 C | 250,000.00 | 0.0796          |
|                              | 平安恒生指数增强 E | -          | -               |
|                              | 合计         | 250,000.00 | 0.0460          |

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）。

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                                         | 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<br>员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开<br>放式基金 | 平安恒生指数增强 A | 0                 |
|                                            | 平安恒生指数增强 C | 0                 |
|                                            | 平安恒生指数增强 E | 0                 |

|                     |            |   |
|---------------------|------------|---|
|                     | 合计         | 0 |
| 本基金基金经理持有<br>本开放式基金 | 平安恒生指数增强 A | 0 |
|                     | 平安恒生指数增强 C | 0 |
|                     | 平安恒生指数增强 E | 0 |
|                     | 合计         | 0 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目                                        | 平安恒生指数增强 A     | 平安恒生指数增强 C     | 平安恒生指数增强 E   |
|-------------------------------------------|----------------|----------------|--------------|
| 基金合同生效<br>日（2025 年<br>11 月 4 日）<br>基金份额总额 | 318,996,232.26 | 441,682,050.55 | 3,616,091.05 |
| 本报告期期初<br>基金份额总额                          | 318,996,232.26 | 441,682,050.55 | 3,616,091.05 |
| 本报告期基金<br>总申购份额                           | 47,009,013.46  | 129,469,707.72 | 345,548.35   |
| 减：本报告期<br>基金总赎回份<br>额                     | 138,493,327.39 | 257,250,841.89 | 1,700,405.54 |
| 本报告期基金<br>拆分变动份额                          | -              | -              | -            |
| 本报告期末<br>基金份额总额                           | 227,511,918.33 | 313,900,916.38 | 2,261,233.86 |

§ 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 (%) |    |
| 招商证券 | 2      | 454,126,746.39 | 69.69            | 68,117.66 | 69.69          |    |
| 东莞证券 | 2      | 197,479,078.62 | 30.31            | 29,621.97 | 30.31          |    |

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 财务状况良好
- (2) 经营行为规范
- (3) 合规风控能力较高

2、基金管理人根据上述标准，选择具备证券经纪业务资格的证券公司，并签订证券经纪服务协议。

##### 10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 |                  | 债券回购交易 |                    | 权证交易 |                  |
|------|------|------------------|--------|--------------------|------|------------------|
|      | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 (%) | 成交金额   | 占当期债券回购成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 (%) |
| 招商证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |
| 东莞证券 | -    | -                | -      | -                  | -    | -                |

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  | 关于平安恒生指数增强型证券投资基金开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告                | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 01 月 29 日 |
| 2  | 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 | 2026 年 03 月 11 日 |
| 3  | 平安基金管理有限公司关于新增上海中欧财富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 | 2026 年 03 月 11 日 |
| 4  | 平安基金管理有限公司关于新增上海证达通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 | 2026 年 03 月 18 日 |
| 5  | 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 |
| 6  | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 04 月 02 日 |
| 7  | 平安恒生指数增强型证券投资基金 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 |
| 8  | 平安基金管理有限公司关于新增上海万得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 | 2026 年 04 月 23 日 |
| 9  | 平安基金管理有限公司关于新增上海利得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 | 2026 年 04 月 23 日 |
| 10 | 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 |
| 11 | 平安基金管理有限公司关于新增南京银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告                   | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 05 月 11 日 |
| 12 | 平安基金管理有限公司关于旗下部                                        | 中国证监会规定报刊及   | 2026 年 05 月 22 日 |

|    |                                                        |              |                  |
|----|--------------------------------------------------------|--------------|------------------|
|    | 分基金 2026 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告                | 网站           |                  |
| 13 | 平安恒生指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新                              | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 05 月 29 日 |
| 14 | 平安恒生指数增强型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 | 2026 年 05 月 29 日 |
| 15 | 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 | 2026 年 06 月 01 日 |
| 16 | 平安基金管理有限公司关于新增上海好买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 | 2026 年 06 月 03 日 |
| 17 | 平安基金管理有限公司关于新增南京苏宁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 | 2026 年 06 月 03 日 |
| 18 | 平安基金管理有限公司关于新增嘉实财富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 | 2026 年 06 月 03 日 |
| 19 | 平安基金管理有限公司关于新增华源证券股份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 | 2026 年 06 月 10 日 |
| 20 | 平安基金管理有限公司关于新增诺亚正行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 | 2026 年 06 月 10 日 |
| 21 | 平安基金管理有限公司关于新增泰信财富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 | 2026 年 06 月 10 日 |
| 22 | 平安基金管理有限公司关于新增万家财富基金销售（天津）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 | 2026 年 06 月 15 日 |
| 23 | 平安基金管理有限公司关于新增汇添富基金销售（上海）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 | 2026 年 06 月 18 日 |
| 24 | 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 |
| 25 | 平安基金管理有限公司关于新增上海陆享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 | 2026 年 06 月 26 日 |
| 26 | 平安基金管理有限公司关于旗下部分基金 2026 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2026 年 06 月 30 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

注：无。

### 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恒生指数增强型证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安恒生指数增强型证券投资基金基金合同
- (3) 平安恒生指数增强型证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2026 年 08 月 31 日