

平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资
基金
2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 年 03 月 26 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

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	56
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	56
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	56
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	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§ 9 开放式基金份额变动	58
§ 10 重大事件揭示	59
10.1 基金份额持有人大会决议	59
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	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
10.4 基金投资策略的改变	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	60
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	62
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	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§ 12 备查文件目录	62
12.1 备查文件目录	62
12.2 存放地点	62
12.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 A500ETF
场内简称	中证 A500ETF 指数基金
基金主代码	159215
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025 年 3 月 26 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,996,582,803.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	深圳证券交易所
上市日期	2025 年 4 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金采用完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代。特殊情况包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的预期日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，预期年化跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金日均跟踪偏离度和跟踪误差变大，基金管理人应采取合理措施，避免日均跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。 当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李海波	任航
	联系电话	0755-88622632	010-66060069
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95599
传真		0755-23997878	010-68121816
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	北京市东城区建国门内大街 69 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 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		518048	100031
法定代表人		罗春风	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公 司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025 年 3 月 26 日(基金合同生效日) – 2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	1,138,419.43
本期利润	35,628,007.20
加权平均基金份额本期利润	0.0181
本期加权平均净值利润率	1.83%
本期基金份额净值增长率	2.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-599,407.92
期末可供分配基金份额利润	-0.0003
期末基金资产净值	2,039,990,075.81
期末基金份额净值	1.0217
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.17%

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

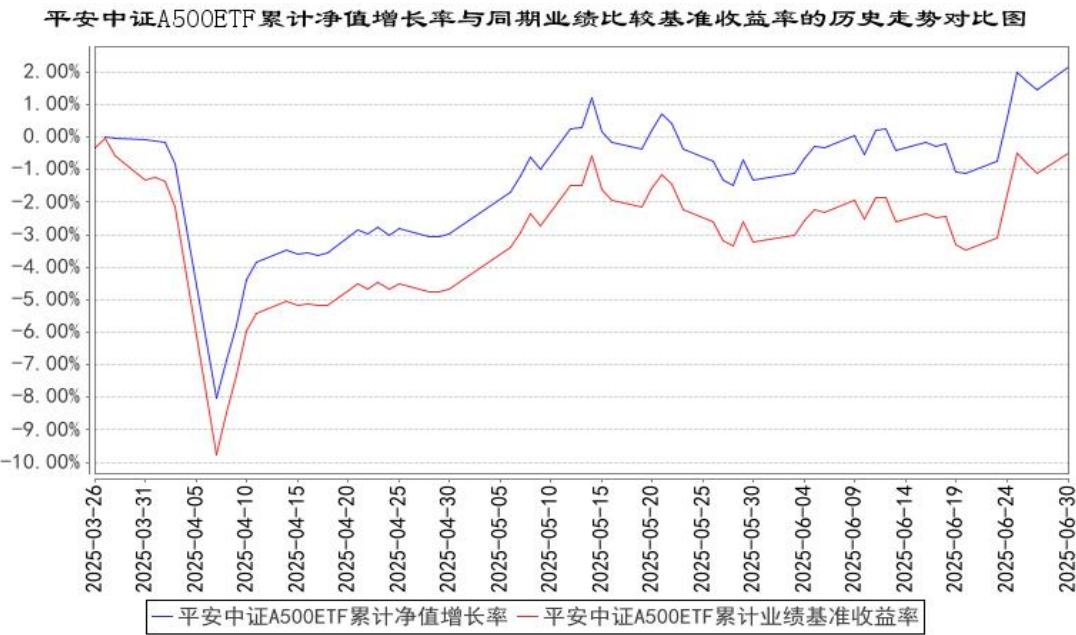
- 期末余额，而非当期发生数)；
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
4. 本基金基金合同于 2025 年 03 月 26 日正式生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.52%	0.59%	2.82%	0.60%	0.70%	-0.01%
过去三个月	2.26%	1.13%	0.84%	1.20%	1.42%	-0.07%
自基金合同生效起至今	2.17%	1.10%	-0.49%	1.16%	2.66%	-0.06%

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



- 注：1、本基金基金合同于 2025 年 03 月 26 日正式生效，截至报告期末未满半年；
- 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，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、海外、专户七大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2025 年 6 月 30 日，平安基金共管理 230 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6600 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李严	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2025 年 3 月 26 日	-	4 年	李严先生，复旦大学应用统计学专业硕士，曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心高级研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 A500 交易型开放式指数证券

					投资基金基金经理。同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

作为一只投资于中证 A500 指数的被动型产品，基金在投资管理上，采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。报告期内，本基金的日均偏离度为 0.03%，年化跟踪误差 0.66%，较好地实现了本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.0217 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.17%，业绩比较基准收益率为-0.49%。

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 年上半年，我们已经充分见证了 A 股市场的韧性和想象空间。整个上半年，新质生产力“deepseek”时刻带来盈利增长新锚的想象力，让投资者看到了本轮股市不仅仅是流动性补充和估值的修复，更有望看到盈利的改善带来中国资产持续性投资价值。对于海外超预期利空因素带来的影响，A 股市场能够快速反应并且实现新高，说明 A 股市场的抗风险能力相较于以往有了更

加明显的提升，这是未来慢牛的重要基础。

对于下半年展望。国内方面，财政货币协同发力，强调积极扩大内需，刺激服务业的不断发展和维稳制造业的利润修复，内生增长动能正稳步积累，全年经济增速实现 5%可期。上半年以来 A 股市场走出震荡上行的慢牛格局，筹码结构相对于历史数次牛市更加牢靠稳固，伴随投资热点层出不穷，增量资金逐步入场，市场的“资金-主题-增长”正循环正在形成，长期配置价值逐步凸显。

作为指数化产品管理者，积极做好组合管理，为投资者提供优质投资工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人——平安基金管理有限公司报告期内基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监

督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，平安基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	14,247,068.03
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	2,029,640,084.18
其中：股票投资		2,029,640,084.18
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		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	82,142.72

资产总计		2,043,969,294.93
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		265,531.22
应付托管费		88,510.43
应付销售服务费		-
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	3,625,177.47
负债合计		3,979,219.12
净资产:		
实收基金	6.4.7.10	1,996,582,803.00
未分配利润	6.4.7.12	43,407,272.81
净资产合计		2,039,990,075.81
负债和净资产总计		2,043,969,294.93

注:(1)报告截止日 2025 年 06 月 30 日,基金份额净值 1.0217 元,基金份额总额 1,996,582,803.00 份。

(2) 本基金合同于 2025 年 3 月 26 日生效,本报表实际编制期间为 2025 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 06 月 30 日。截至报告期末本基金合同生效未满一年,本报告期的财务报表及报表附注均无同期对比数据。

6.2 利润表

会计主体: 平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2025 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 3 月 26 日(基金合同生效日)至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		36,754,905.07
1. 利息收入		93,704.50
其中: 存款利息收入	6.4.7.13	93,704.50
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）		1,052,901.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-20,556,655.67
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	21,609,557.25
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	34,489,587.77
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	1,118,711.22
减：二、营业总支出		1,126,897.87
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	765,007.79
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	255,002.59
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	106,887.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		35,628,007.20
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		35,628,007.20
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		35,628,007.20

6.3 净资产变动表

会计主体：平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	2,026,582,803.00	-	2,026,582,803.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-30,000,000.00	43,407,272.81	13,407,272.81
(一)、综合收益总额	-	35,628,007.20	35,628,007.20
(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)	-30,000,000.00	7,779,265.61	-22,220,734.39
其中：1. 基金申购款	996,000,000.00	-5,855,014.28	990,144,985.72
2. 基金赎回款	-1,026,000,000.00	13,634,279.89	-1,012,365,720.11
(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	1,996,582,803.00	43,407,272.81	2,039,990,075.81

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>林婉文</u>	<u>张南南</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

平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]311 号文《关于准予平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》作为管理人向社会公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,026,438,000.00 元，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_H07 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2025 年 3 月 26 日正式生效，本基金募集期间为 2025 年 3 月 17

日至 2025 年 3 月 21 日，基金合同生效日的基金份额总额为 2,026,582,803.00 份，其中认购资金利息折合 144,803.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）审核同意，本基金 2,026,582,803.00 份基金份额于 2025 年 4 月 7 日在深交所挂牌交易。本基金上市交易后，所有的基金份额均可进行交易，不存在未上市交易的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证）、衍生工具（股指期货、国债期货、股票期权）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券）、资产支持证券、信用衍生品、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、现金等，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于中证 A500 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权合约的投资比例遵循国家相关法律法规。如果法律法规或中国证监会允许基金变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准为：标的指数收益率，即中证 A500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编

报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 6 月 30 日的财务状况以及自 2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）起至 2025 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 2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）起至 2025 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。

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

（1）本基金收益分配方式采用现金分红；

（2）每一基金份额享有同等分配权；

（3）在符合以下有关基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准：

a：本基金可每季度最后一个交易日对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金累计报酬率超过业绩比较基准同期累计报酬率或者基金可供分配利润金额大于 0 元时，基金管理人可进行收益分配，累计报酬率计算方式详见招募说明书；若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

b：当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

（4）在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每季度进行 1 次收益分配；

（5）在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，在履行适当程序后基金管理人可调整基金收益的分配原则；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充

通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入。

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

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

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，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。

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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	515,806.69
等于：本金	515,768.65
加：应计利息	38.04
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	13,731,261.34
等于：本金	13,730,990.55
加：应计利息	270.79
合计	14,247,068.03

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 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,995,150,496.41	-	2,029,640,084.18	34,489,587.77
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		1,995,150,496.41	-	2,029,640,084.18	34,489,587.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	82,142.72
合计	82,142.72

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	63,340.21
应退退补款	3,480,241.64
可退替代款	805.14
其他	56,247.15
现金差额	24,543.33
合计	3,625,177.47

注：1. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，替代价格与实际买入成本(实际卖出金额)或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2. 可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	2,026,582,803.00	2,026,582,803.00
本期申购	996,000,000.00	996,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,026,000,000.00	-1,026,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	1,996,582,803.00	1,996,582,803.00
-----	------------------	------------------

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,138,419.43	34,489,587.77	35,628,007.20
本期基金份额交易产生的变动数	-1,737,827.35	9,517,092.96	7,779,265.61
其中：基金申购款	-8,083,179.44	2,228,165.16	-5,855,014.28
基金赎回款	6,345,352.09	7,288,927.80	13,634,279.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-599,407.92	44,006,680.73	43,407,272.81

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年3月26日（基金合同生效日）至2025年6月30日
活期存款利息收入	44,889.53
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	42,712.72
结算备付金利息收入	-
其他	6,102.25
合计	93,704.50

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
	2025年3月26日（基金合同生效日）至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,946,518.62
股票投资收益——赎回差价收入	-13,610,137.05

股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-20,556,655.67

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 2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	798,488,463.77
减：卖出股票成本总额	804,102,534.78
减：交易费用	1,332,447.61
买卖股票差价收入	-6,946,518.62

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月26日（基金合同生效日）至2025年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,012,365,720.11
减：现金支付赎回款总额	582,193,951.11
减：赎回股票成本总额	443,781,906.05
减：交易费用	-
赎回差价收入	-13,610,137.05

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

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
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	21,609,557.25
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	21,609,557.25

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	34,489,587.77
股票投资	34,489,587.77
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	34,489,587.77

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,118,711.22
合计	1,118,711.22

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,163.67
信息披露费	34,519.39
证券出借违约金	-
银行费用	690.00
其他	47,514.43

合计	106,887.49
----	------------

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司（“方正证券”）	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”）	基金管理人的最终控股母公司
中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“平安中证 A500ETF 联接”）	本基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
平安证券	3,631,888,204.69	100.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年3月26日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
平安证券	700,334.09	100.00	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

2、该类佣金协议的服务范围仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

3、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年3月26日（基金合同生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	765,007.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	233,225.73
应支付基金管理人的净管理费	531,782.06

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0.15%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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	255,002.59

注：支付基金托管行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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×0.05%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
方正证券	12,944,919.00	0.6484
平安人寿	798,468,332.00	39.9917
平安中证A500ETF联接	676,054,800.00	33.8606

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025 年 3 月 26 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
农业银行-活期	515, 806. 69	44, 889. 53

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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

为了更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人的最终控股母公司平安集团发行的股票中国平安、基金管理人关联方平安银行发行的股票平安银行、本基金托管行发行的股票农业银行。

(1)于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 954, 214. 00 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为 49, 928, 293. 61 人民币元，估值总额为 52, 939, 792. 72 人民币元，占基金资产净值的比例为 2. 60%。

(2)于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 859, 700. 00 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 9, 775, 965. 20 元，估值总额为人民币 10, 376, 579. 00 元，占基金资产净值的比例 0. 51%。

(3)于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 2, 831, 800. 00 股农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 15, 155, 491. 06 元，估值总额为人民币 16, 650, 984. 00 元，占基金资产净值的比例为 0. 82%。

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（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6. 4. 12. 1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6. 4. 12. 1. 1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16. 42	16. 42	94	1, 543. 48	1, 543. 48	-
001388	信通	2025 年 6 月	1 个月内（含）	新股未上	16. 42	16. 42	843	13, 842. 06	13, 842. 06	-

	电子	24 日		市						
001390	古麒绒材	2025 年 5 月 21 日	6 个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
301590	优优绿能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-
301595	太力科技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
603014	威高血净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-
603049	中策橡胶	2025 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定	46.50	42.85	724	33,666.00	31,023.40	-

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、

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要

求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日内可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日内可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合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 2025 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	14,247,068.03	-	-	-	14,247,068.03
交易性金融资产	-	-	-	2,029,640,084.18	2,029,640,084.18
其他资产	-	-	-	82,142.72	82,142.72
资产总计	14,247,068.03	-	-	2,029,722,226.90	2,043,969,294.93
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	265,531.22	265,531.22
应付托管费	-	-	-	88,510.43	88,510.43
其他负债	-	-	-	3,625,177.47	3,625,177.47
负债总计	-	-	-	3,979,219.12	3,979,219.12
利率敏感度缺口	14,247,068.03	-	-	2,025,743,007.78	2,039,990,075.81

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本报告期末，本基金未持有交易性债券资产投资和交易性资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	2,029,640,084.18	99.49
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	2,029,640,084.18	99.49

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（2025 年 6 月 30 日）
	沪深 300 指数上升 5%	102,727,070.86
	沪深 300 指数下降 5%	-102,727,070.86

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的

最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日
第一层次	2,029,567,864.84
第二层次	15,385.54
第三层次	56,833.80
合计	2,029,640,084.18

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
----	----	----	--------------

1	权益投资	2,029,640,084.18	99.30
	其中：股票	2,029,640,084.18	99.30
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	14,247,068.03	0.70
8	其他各项资产	82,142.72	0.00
9	合计	2,043,969,294.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	11,060,800.00	0.54
B	采矿业	102,754,767.50	5.04
C	制造业	1,177,069,466.90	57.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	62,683,630.00	3.07
E	建筑业	38,653,937.00	1.89
F	批发和零售业	14,349,727.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	69,980,424.00	3.43
H	住宿和餐饮业	1,741,077.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	135,366,084.48	6.64
J	金融业	329,423,433.16	16.15
K	房地产业	21,295,546.00	1.04
L	租赁和商务服务业	22,620,261.80	1.11
M	科学研究和技术服务业	22,612,795.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	4,457,437.00	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,344,258.00	0.07
Q	卫生和社会工作	7,740,434.00	0.38
R	文化、体育和娱乐	6,413,786.00	0.31

	业		
S	综合	-	-
	合计	2,029,567,864.84	99.49

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	72,219.34	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	72,219.34	0.00

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	55,700	78,510,264.00	3.85
2	300750	宁德时代	234,200	59,069,924.00	2.90
3	601318	中国平安	954,214	52,939,792.72	2.60

4	600036	招商银行	1,097,400	50,425,530.00	2.47
5	601166	兴业银行	1,473,500	34,391,490.00	1.69
6	600900	长江电力	1,084,600	32,689,844.00	1.60
7	000333	美的集团	436,112	31,487,286.40	1.54
8	601899	紫金矿业	1,459,900	28,468,050.00	1.40
9	002594	比亚迪	80,300	26,652,373.00	1.31
10	300059	东方财富	1,120,888	25,926,139.44	1.27
11	600030	中信证券	865,300	23,899,586.00	1.17
12	601398	工商银行	3,106,600	23,579,094.00	1.16
13	600276	恒瑞医药	396,020	20,553,438.00	1.01
14	000858	五粮液	172,100	20,462,690.00	1.00
15	601328	交通银行	2,365,100	18,920,800.00	0.93
16	000651	格力电器	397,300	17,846,716.00	0.87
17	601288	农业银行	2,831,800	16,650,984.00	0.82
18	600887	伊利股份	560,900	15,637,892.00	0.77
19	002475	立讯精密	449,815	15,604,082.35	0.76
20	688981	中芯国际	176,292	15,543,665.64	0.76
21	600919	江苏银行	1,301,100	15,535,134.00	0.76
22	603259	药明康德	221,600	15,412,280.00	0.76
23	601816	京沪高铁	2,601,100	14,956,325.00	0.73
24	600000	浦发银行	1,041,000	14,449,080.00	0.71
25	000725	京东方A	3,257,600	12,997,824.00	0.64
26	002371	北方华创	28,400	12,558,764.00	0.62
27	300760	迈瑞医疗	53,800	12,091,550.00	0.59
28	601088	中国神华	292,500	11,857,950.00	0.58
29	688041	海光信息	82,417	11,644,697.93	0.57
30	300308	中际旭创	78,800	11,493,768.00	0.56
31	601601	中国太保	303,400	11,380,534.00	0.56
32	300502	新易盛	87,980	11,175,219.60	0.55
33	688256	寒武纪	18,514	11,136,171.00	0.55
34	300124	汇川技术	167,200	10,796,104.00	0.53
35	601728	中国电信	1,376,700	10,669,425.00	0.52
36	601668	中国建筑	1,832,000	10,570,640.00	0.52
37	002352	顺丰控股	213,700	10,420,012.00	0.51
38	000001	平安银行	859,700	10,376,579.00	0.51
39	002714	牧原股份	242,000	10,166,420.00	0.50
40	002230	科大讯飞	204,900	9,810,612.00	0.48
41	601127	赛力斯	72,500	9,738,200.00	0.48
42	603501	豪威集团	75,500	9,637,575.00	0.47
43	600031	三一重工	526,300	9,447,085.00	0.46
44	000063	中兴通讯	285,700	9,282,393.00	0.46
45	603019	中科曙光	129,700	9,130,880.00	0.45
46	002415	海康威视	327,500	9,081,575.00	0.45

47	600309	万华化学	166,900	9,055,994.00	0.44
48	600941	中国移动	80,000	9,004,000.00	0.44
49	300274	阳光电源	128,800	8,728,776.00	0.43
50	601857	中国石油	1,005,700	8,598,735.00	0.42
51	601919	中远海控	558,900	8,405,856.00	0.41
52	688008	澜起科技	101,590	8,330,380.00	0.41
53	600690	海尔智家	332,700	8,244,306.00	0.40
54	600660	福耀玻璃	142,000	8,095,420.00	0.40
55	601012	隆基绿能	538,100	8,082,262.00	0.40
56	600406	国电南瑞	355,900	7,975,719.00	0.39
57	601766	中国中车	1,077,700	7,587,008.00	0.37
58	603986	兆易创新	58,900	7,452,617.00	0.37
59	600050	中国联通	1,385,200	7,396,968.00	0.36
60	000568	泸州老窖	65,200	7,393,680.00	0.36
61	000338	潍柴动力	480,300	7,387,014.00	0.36
62	600028	中国石化	1,292,400	7,289,136.00	0.36
63	000100	TCL 科技	1,666,900	7,217,677.00	0.35
64	300476	胜宏科技	53,500	7,189,330.00	0.35
65	601988	中国银行	1,270,200	7,138,524.00	0.35
66	601006	大秦铁路	1,073,100	7,082,460.00	0.35
67	688012	中微公司	38,833	7,079,255.90	0.35
68	601985	中国核电	729,100	6,795,212.00	0.33
69	601225	陕西煤业	343,400	6,607,016.00	0.32
70	600104	上汽集团	410,700	6,591,735.00	0.32
71	002027	分众传媒	895,000	6,533,500.00	0.32
72	600150	中国船舶	198,100	6,446,174.00	0.32
73	600418	江淮汽车	154,800	6,205,932.00	0.30
74	601628	中国人寿	147,800	6,087,882.00	0.30
75	605499	东鹏饮料	18,500	5,809,925.00	0.28
76	603288	海天味业	148,100	5,762,571.00	0.28
77	688111	金山办公	20,556	5,756,707.80	0.28
78	600760	中航沈飞	97,600	5,721,312.00	0.28
79	000425	徐工机械	728,700	5,661,999.00	0.28
80	000625	长安汽车	440,700	5,623,332.00	0.28
81	000792	盐湖股份	328,100	5,603,948.00	0.27
82	688271	联影医疗	43,783	5,592,840.42	0.27
83	600111	北方稀土	224,400	5,587,560.00	0.27
84	600938	中国海油	212,000	5,535,320.00	0.27
85	600905	三峡能源	1,266,500	5,395,290.00	0.26
86	601658	邮储银行	977,200	5,345,284.00	0.26
87	600436	片仔癀	26,700	5,340,267.00	0.26
88	600089	特变电工	447,400	5,337,482.00	0.26
89	002625	光启技术	133,500	5,337,330.00	0.26

90	601888	中国中免	86,700	5,286,099.00	0.26
91	603993	洛阳钼业	623,300	5,248,186.00	0.26
92	002050	三花智控	198,700	5,241,706.00	0.26
93	300033	同花顺	19,100	5,214,491.00	0.26
94	300015	爱尔眼科	413,900	5,165,472.00	0.25
95	600048	保利发展	637,600	5,164,560.00	0.25
96	600019	宝钢股份	778,200	5,128,338.00	0.25
97	600547	山东黄金	160,200	5,115,186.00	0.25
98	601390	中国中铁	909,700	5,103,417.00	0.25
99	002463	沪电股份	119,500	5,088,310.00	0.25
100	002241	歌尔股份	216,800	5,055,776.00	0.25
101	600415	小商品城	243,600	5,037,648.00	0.25
102	300014	亿纬锂能	108,800	4,984,128.00	0.24
103	601600	中国铝业	703,900	4,955,456.00	0.24
104	601989	中国重工	1,012,600	4,698,464.00	0.23
105	000977	浪潮信息	91,300	4,645,344.00	0.23
106	600585	海螺水泥	213,000	4,573,110.00	0.22
107	002384	东山精密	121,000	4,570,170.00	0.22
108	600893	航发动力	118,400	4,563,136.00	0.22
109	002179	中航光电	112,600	4,544,536.00	0.22
110	600570	恒生电子	134,200	4,501,068.00	0.22
111	603799	华友钴业	120,970	4,478,309.40	0.22
112	000538	云南白药	79,200	4,418,568.00	0.22
113	600584	长电科技	126,900	4,275,261.00	0.21
114	000938	紫光股份	177,600	4,260,624.00	0.21
115	000988	华工科技	89,000	4,183,890.00	0.21
116	601727	上海电气	561,200	4,147,268.00	0.20
117	002028	思源电气	55,200	4,024,632.00	0.20
118	600438	通威股份	238,900	4,001,575.00	0.20
119	300408	三环集团	119,200	3,981,280.00	0.20
120	002049	紫光国微	60,100	3,958,186.00	0.19
121	300433	蓝思科技	176,800	3,942,640.00	0.19
122	000002	万科A	604,000	3,877,680.00	0.19
123	600795	国电电力	790,500	3,826,020.00	0.19
124	600489	中金黄金	258,400	3,780,392.00	0.19
125	601669	中国电建	761,900	3,710,453.00	0.18
126	600988	赤峰黄金	147,500	3,669,800.00	0.18
127	601689	拓普集团	77,000	3,638,250.00	0.18
128	300339	润和软件	70,600	3,588,598.00	0.18
129	002422	科伦药业	99,300	3,566,856.00	0.17
130	002456	欧菲光	295,500	3,501,675.00	0.17
131	600009	上海机场	110,000	3,494,700.00	0.17
132	600160	巨化股份	120,000	3,441,600.00	0.17

133	601100	恒立液压	47,500	3,420,000.00	0.17
134	002460	赣锋锂业	100,000	3,377,000.00	0.17
135	000768	中航西飞	123,300	3,371,022.00	0.17
136	300394	天孚通信	41,480	3,311,763.20	0.16
137	601186	中国铁建	408,700	3,273,687.00	0.16
138	600183	生益科技	107,900	3,253,185.00	0.16
139	002252	上海莱士	472,200	3,244,014.00	0.16
140	688036	传音控股	40,540	3,231,038.00	0.16
141	600839	四川长虹	328,400	3,192,048.00	0.16
142	000157	中联重科	439,400	3,176,862.00	0.16
143	601360	三六零	310,700	3,169,140.00	0.16
144	600989	宝丰能源	195,200	3,150,528.00	0.15
145	600886	国投电力	213,100	3,141,094.00	0.15
146	000963	华东医药	77,500	3,127,900.00	0.15
147	002074	国轩高科	95,652	3,104,863.92	0.15
148	600115	中国东航	759,000	3,058,770.00	0.15
149	601058	赛轮轮胎	232,600	3,051,712.00	0.15
150	300442	润泽科技	61,000	3,021,330.00	0.15
151	000408	藏格矿业	69,800	2,978,366.00	0.15
152	000807	云铝股份	184,737	2,952,097.26	0.14
153	600066	宇通客车	118,100	2,935,966.00	0.14
154	002466	天齐锂业	91,400	2,928,456.00	0.14
155	002517	恺英网络	150,100	2,898,431.00	0.14
156	002001	新 和 成	135,900	2,890,593.00	0.14
157	002340	格林美	454,800	2,887,980.00	0.14
158	688169	石头科技	18,382	2,877,702.10	0.14
159	000661	长春高新	28,900	2,866,302.00	0.14
160	600426	华鲁恒升	132,100	2,862,607.00	0.14
161	002195	岩山科技	503,400	2,834,142.00	0.14
162	600029	南方航空	479,500	2,829,050.00	0.14
163	600196	复星医药	112,700	2,827,643.00	0.14
164	001979	招商蛇口	322,100	2,824,817.00	0.14
165	002558	巨人网络	119,900	2,823,645.00	0.14
166	000975	山金国际	147,800	2,799,332.00	0.14
167	601800	中国交建	314,500	2,795,905.00	0.14
168	300661	圣邦股份	38,390	2,793,640.30	0.14
169	002236	大华股份	175,900	2,793,292.00	0.14
170	600011	华能国际	390,400	2,787,456.00	0.14
171	301236	软通动力	50,800	2,775,712.00	0.14
172	600674	川投能源	172,900	2,773,316.00	0.14
173	002156	通富微电	107,600	2,756,712.00	0.14
174	688126	沪硅产业	146,442	2,741,394.24	0.13
175	600487	亨通光电	174,800	2,674,440.00	0.13

176	600346	恒力石化	186,900	2,665,194.00	0.13
177	300207	欣旺达	131,300	2,633,878.00	0.13
178	601111	中国国航	333,000	2,627,370.00	0.13
179	300251	光线传媒	129,600	2,626,992.00	0.13
180	300418	昆仑万维	78,000	2,623,140.00	0.13
181	002648	卫星化学	149,800	2,596,034.00	0.13
182	600745	闻泰科技	77,200	2,588,516.00	0.13
183	600372	中航机载	214,100	2,582,046.00	0.13
184	688608	恒玄科技	7,400	2,575,052.00	0.13
185	600460	士兰微	103,100	2,558,942.00	0.13
186	601868	中国能建	1,146,900	2,557,587.00	0.13
187	688213	思特威	25,000	2,555,500.00	0.13
188	003816	中国广核	697,600	2,539,264.00	0.12
189	002916	深南电路	23,540	2,537,847.40	0.12
190	000066	中国长城	171,300	2,535,240.00	0.12
191	688777	中控技术	56,009	2,515,364.19	0.12
192	002920	德赛西威	24,504	2,502,593.52	0.12
193	600096	云天化	113,500	2,493,595.00	0.12
194	601117	中国化学	324,100	2,485,847.00	0.12
195	688120	华海清科	14,695	2,479,046.50	0.12
196	600741	华域汽车	140,200	2,474,530.00	0.12
197	601319	中国人保	283,700	2,471,027.00	0.12
198	002273	水晶光电	123,000	2,456,310.00	0.12
199	002465	海格通信	175,900	2,452,046.00	0.12
200	601168	西部矿业	147,300	2,449,599.00	0.12
201	600879	航天电子	233,700	2,446,839.00	0.12
202	600588	用友网络	182,000	2,433,340.00	0.12
203	600256	广汇能源	404,200	2,433,284.00	0.12
204	300347	泰格医药	45,600	2,431,392.00	0.12
205	600176	中国巨石	212,500	2,422,500.00	0.12
206	601021	春秋航空	43,400	2,415,210.00	0.12
207	300450	先导智能	96,800	2,405,480.00	0.12
208	002601	龙佰集团	148,100	2,400,701.00	0.12
209	000831	中国稀土	66,100	2,387,532.00	0.12
210	688235	百济神州	10,210	2,385,464.40	0.12
211	000786	北新建材	90,000	2,383,200.00	0.12
212	601633	长城汽车	110,800	2,379,984.00	0.12
213	300782	卓胜微	33,300	2,376,621.00	0.12
214	002555	三七互娱	137,200	2,372,188.00	0.12
215	600219	南山铝业	617,700	2,365,791.00	0.12
216	600352	浙江龙盛	231,600	2,353,056.00	0.12
217	300896	爱美客	13,400	2,342,454.00	0.11
218	002294	信立泰	49,300	2,333,369.00	0.11

219	000933	神火股份	139,900	2,327,936.00	0.11
220	300017	网宿科技	216,600	2,321,952.00	0.11
221	600885	宏发股份	103,780	2,315,331.80	0.11
222	600482	中国动力	99,800	2,302,386.00	0.11
223	302132	中航成飞	26,100	2,295,234.00	0.11
224	002185	华天科技	227,200	2,294,720.00	0.11
225	600039	四川路桥	231,300	2,289,870.00	0.11
226	000630	铜陵有色	679,700	2,270,198.00	0.11
227	688002	睿创微纳	32,267	2,249,655.24	0.11
228	002493	荣盛石化	269,100	2,228,148.00	0.11
229	688617	惠泰医疗	7,484	2,222,748.00	0.11
230	688396	华润微	46,931	2,213,265.96	0.11
231	002129	TCL 中环	287,100	2,204,928.00	0.11
232	600085	同仁堂	61,000	2,199,660.00	0.11
233	001965	招商公路	182,200	2,186,400.00	0.11
234	601877	正泰电器	95,700	2,169,519.00	0.11
235	600362	江西铜业	91,700	2,148,531.00	0.11
236	300866	安克创新	18,900	2,147,040.00	0.11
237	002709	天赐材料	118,400	2,145,408.00	0.11
238	688506	百利天恒	7,200	2,132,064.00	0.10
239	002130	沃尔核材	89,400	2,129,508.00	0.10
240	688099	晶晨股份	29,981	2,128,950.81	0.10
241	002281	光迅科技	42,900	2,115,828.00	0.10
242	300454	深信服	22,400	2,109,632.00	0.10
243	002085	万丰奥威	132,400	2,103,836.00	0.10
244	002131	利欧股份	598,500	2,094,750.00	0.10
245	000423	东阿阿胶	40,000	2,092,000.00	0.10
246	002595	豪迈科技	35,300	2,090,466.00	0.10
247	688122	西部超导	40,163	2,083,656.44	0.10
248	300122	智飞生物	106,100	2,078,499.00	0.10
249	002532	天山铝业	248,500	2,065,035.00	0.10
250	300058	蓝色光标	314,480	2,062,988.80	0.10
251	300223	北京君正	29,800	2,062,160.00	0.10
252	002738	中矿资源	64,000	2,058,240.00	0.10
253	300002	神州泰岳	174,400	2,057,920.00	0.10
254	603129	春风动力	9,500	2,056,750.00	0.10
255	603392	万泰生物	33,600	2,049,600.00	0.10
256	002180	纳思达	88,300	2,025,602.00	0.10
257	600161	天坛生物	105,400	2,022,626.00	0.10
258	300474	景嘉微	27,700	2,022,100.00	0.10
259	002138	顺络电子	71,800	2,019,016.00	0.10
260	002472	双环传动	59,900	2,006,051.00	0.10
261	002078	太阳纸业	148,500	1,998,810.00	0.10

262	603596	伯特利	37,740	1,988,520.60	0.10
263	300832	新产业	35,000	1,985,200.00	0.10
264	002436	兴森科技	149,900	1,984,676.00	0.10
265	002938	鹏鼎控股	61,500	1,969,845.00	0.10
266	002410	广联达	146,300	1,961,883.00	0.10
267	600233	圆通速递	152,100	1,960,569.00	0.10
268	002128	电投能源	99,000	1,958,220.00	0.10
269	000301	东方盛虹	233,700	1,946,721.00	0.10
270	600862	中航高科	74,400	1,940,352.00	0.10
271	300346	南大光电	61,140	1,934,469.60	0.09
272	600143	金发科技	186,900	1,926,939.00	0.09
273	600188	兖矿能源	157,700	1,919,209.00	0.09
274	300136	信维通信	85,600	1,917,440.00	0.09
275	300759	康龙化成	78,100	1,916,574.00	0.09
276	300024	机器人	111,500	1,915,570.00	0.09
277	002065	东华软件	199,200	1,912,320.00	0.09
278	000034	神州数码	50,700	1,908,348.00	0.09
279	300054	鼎龙股份	66,500	1,907,220.00	0.09
280	002353	杰瑞股份	54,300	1,900,500.00	0.09
281	688047	龙芯中科	14,240	1,899,473.60	0.09
282	002223	鱼跃医疗	53,300	1,897,480.00	0.09
283	688072	拓荆科技	12,327	1,894,783.17	0.09
284	603606	东方电缆	36,500	1,887,415.00	0.09
285	300395	菲利华	36,900	1,885,590.00	0.09
286	002202	金风科技	183,700	1,882,925.00	0.09
287	601618	中国中冶	630,600	1,879,188.00	0.09
288	300496	中科创达	32,600	1,865,372.00	0.09
289	688578	艾力斯	19,900	1,851,496.00	0.09
290	688223	晶科能源	355,456	1,844,816.64	0.09
291	601615	明阳智能	160,500	1,844,145.00	0.09
292	000999	华润三九	58,890	1,842,079.20	0.09
293	002624	完美世界	120,500	1,827,985.00	0.09
294	300383	光环新网	127,700	1,826,110.00	0.09
295	002008	大族激光	74,700	1,820,439.00	0.09
296	600845	宝信软件	76,900	1,816,378.00	0.09
297	002271	东方雨虹	168,900	1,812,297.00	0.09
298	601872	招商轮船	287,800	1,801,628.00	0.09
299	002405	四维图新	210,300	1,795,962.00	0.09
300	600515	海南机场	505,200	1,788,408.00	0.09
301	603659	璞泰来	95,000	1,784,100.00	0.09
302	688266	泽璟制药	16,500	1,773,915.00	0.09
303	600549	厦门钨业	84,700	1,771,924.00	0.09
304	600895	张江高科	68,700	1,765,590.00	0.09

305	002459	晶澳科技	176,500	1,761,470.00	0.09
306	300604	长川科技	39,100	1,755,981.00	0.09
307	300459	汤姆猫	313,200	1,753,920.00	0.09
308	603087	甘李药业	32,000	1,752,960.00	0.09
309	000426	兴业银锡	110,700	1,749,060.00	0.09
310	300012	华测检测	149,500	1,747,655.00	0.09
311	603605	珀莱雅	21,000	1,738,590.00	0.09
312	002155	湖南黄金	97,170	1,734,484.50	0.09
313	000733	振华科技	34,400	1,721,720.00	0.08
314	300627	华测导航	48,740	1,705,900.00	0.08
315	605117	德业股份	32,260	1,698,811.60	0.08
316	688599	天合光能	116,610	1,694,343.30	0.08
317	605589	圣泉集团	60,400	1,676,100.00	0.08
318	300253	卫宁健康	156,700	1,661,020.00	0.08
319	601216	君正集团	299,600	1,653,792.00	0.08
320	300699	光威复材	51,800	1,640,506.00	0.08
321	600332	白云山	62,200	1,639,592.00	0.08
322	600392	盛和资源	123,700	1,629,129.00	0.08
323	000617	中油资本	223,000	1,627,900.00	0.08
324	300037	新宙邦	46,200	1,626,240.00	0.08
325	688180	君实生物	47,819	1,624,889.62	0.08
326	002444	巨星科技	63,400	1,617,334.00	0.08
327	000932	华菱钢铁	366,100	1,610,840.00	0.08
328	600153	建发股份	154,800	1,605,276.00	0.08
329	000519	中兵红箭	73,300	1,604,537.00	0.08
330	300003	乐普医疗	116,100	1,599,858.00	0.08
331	601233	桐昆股份	150,200	1,592,120.00	0.08
332	000878	云南铜业	124,900	1,588,728.00	0.08
333	601799	星宇股份	12,700	1,587,500.00	0.08
334	002389	航天彩虹	61,700	1,579,520.00	0.08
335	300073	当升科技	36,000	1,579,320.00	0.08
336	300001	特锐德	65,600	1,572,432.00	0.08
337	300316	晶盛机电	57,700	1,566,555.00	0.08
338	300142	沃森生物	142,400	1,566,400.00	0.08
339	300628	亿联网络	45,000	1,564,200.00	0.08
340	002821	凯莱英	17,700	1,562,025.00	0.08
341	002414	高德红外	152,100	1,559,025.00	0.08
342	600803	新奥股份	82,100	1,551,690.00	0.08
343	603979	金诚信	33,200	1,541,808.00	0.08
344	600699	均胜电子	87,600	1,527,744.00	0.07
345	002812	恩捷股份	51,800	1,517,222.00	0.07
346	300568	星源材质	119,600	1,516,528.00	0.07
347	002007	华兰生物	96,700	1,515,289.00	0.07

348	600177	雅戈尔	206,200	1,505,260.00	0.07
349	600118	中国卫星	52,500	1,499,925.00	0.07
350	603260	合盛硅业	31,600	1,497,840.00	0.07
351	600521	华海药业	80,200	1,494,126.00	0.07
352	601238	广汽集团	197,200	1,477,028.00	0.07
353	002152	广电运通	109,800	1,475,712.00	0.07
354	600398	海澜之家	211,600	1,472,736.00	0.07
355	000738	航发控制	70,400	1,460,800.00	0.07
356	300315	掌趣科技	240,000	1,456,800.00	0.07
357	300413	芒果超媒	66,700	1,455,394.00	0.07
358	600704	物产中大	275,600	1,452,412.00	0.07
359	000623	吉林敖东	84,800	1,437,360.00	0.07
360	600497	驰宏锌锗	271,200	1,434,648.00	0.07
361	600316	洪都航空	38,000	1,432,600.00	0.07
362	002044	美年健康	277,700	1,427,378.00	0.07
363	000009	中国宝安	160,700	1,427,016.00	0.07
364	600141	兴发集团	68,900	1,414,517.00	0.07
365	600765	中航重机	83,700	1,412,856.00	0.07
366	002318	久立特材	60,200	1,408,078.00	0.07
367	600038	中直股份	36,200	1,404,922.00	0.07
368	600018	上港集团	246,000	1,404,660.00	0.07
369	601567	三星医疗	62,400	1,399,008.00	0.07
370	002409	雅克科技	25,200	1,378,188.00	0.07
371	300919	中伟股份	41,800	1,374,384.00	0.07
372	000400	许继电气	63,000	1,371,510.00	0.07
373	601677	明泰铝业	109,800	1,363,716.00	0.07
374	300757	罗博特科	9,000	1,349,730.00	0.07
375	002607	中公教育	439,300	1,344,258.00	0.07
376	688188	柏楚电子	10,148	1,336,085.68	0.07
377	300724	捷佳伟创	24,600	1,335,780.00	0.07
378	000960	锡业股份	87,300	1,335,690.00	0.07
379	600637	东方明珠	178,500	1,333,395.00	0.07
380	300088	长信科技	222,600	1,326,696.00	0.07
381	601607	上海医药	74,000	1,323,120.00	0.06
382	600498	烽火通信	62,700	1,318,581.00	0.06
383	603939	益丰药房	53,800	1,316,486.00	0.06
384	002245	蔚蓝锂芯	101,800	1,306,094.00	0.06
385	600563	法拉电子	11,900	1,298,171.00	0.06
386	300558	贝达药业	22,400	1,298,080.00	0.06
387	300182	捷成股份	235,300	1,296,503.00	0.06
388	600529	山东药玻	58,500	1,295,190.00	0.06
389	000039	中集集团	164,300	1,291,398.00	0.06
390	002407	多氟多	105,870	1,290,555.30	0.06

391	002739	万达电影	112,700	1,288,161.00	0.06
392	002841	视源股份	37,200	1,287,120.00	0.06
393	600026	中远海能	123,600	1,276,788.00	0.06
394	300068	南都电源	79,100	1,259,272.00	0.06
395	601018	宁波港	342,300	1,252,818.00	0.06
396	002025	航天电器	24,300	1,249,263.00	0.06
397	301358	湖南裕能	40,000	1,247,600.00	0.06
398	600486	扬农化工	21,500	1,247,000.00	0.06
399	300285	国瓷材料	71,300	1,237,055.00	0.06
400	000887	中鼎股份	70,000	1,231,300.00	0.06
401	300763	锦浪科技	21,200	1,216,668.00	0.06
402	688303	大全能源	56,780	1,210,549.60	0.06
403	300144	宋城演艺	140,600	1,202,130.00	0.06
404	603806	福斯特	92,400	1,197,504.00	0.06
405	600820	隧道股份	194,500	1,186,450.00	0.06
406	600008	首创环保	392,200	1,184,444.00	0.06
407	603486	科沃斯	20,300	1,182,069.00	0.06
408	688009	中国通号	228,516	1,174,572.24	0.06
409	002064	华峰化学	177,000	1,169,970.00	0.06
410	002497	雅化集团	102,300	1,166,220.00	0.06
411	300296	利亚德	190,700	1,163,270.00	0.06
412	600998	九州通	225,000	1,156,500.00	0.06
413	603568	伟明环保	60,600	1,156,248.00	0.06
414	002312	川发龙蟒	100,700	1,156,036.00	0.06
415	600516	方大炭素	248,200	1,151,648.00	0.06
416	600763	通策医疗	27,800	1,147,584.00	0.06
417	600166	福田汽车	419,100	1,135,761.00	0.06
418	600170	上海建工	471,500	1,126,885.00	0.06
419	600208	衢州发展	379,700	1,123,912.00	0.06
420	601179	中国西电	181,600	1,115,024.00	0.05
421	603816	顾家家居	43,600	1,112,672.00	0.05
422	600312	平高电气	71,800	1,105,002.00	0.05
423	300676	华大基因	22,200	1,104,894.00	0.05
424	000683	博源化工	230,100	1,102,179.00	0.05
425	605358	立昂微	47,200	1,099,760.00	0.05
426	002176	江特电机	150,100	1,089,726.00	0.05
427	601155	新城控股	79,500	1,087,560.00	0.05
428	002244	滨江集团	111,000	1,082,250.00	0.05
429	601000	唐山港	263,800	1,071,028.00	0.05
430	002432	九安医疗	29,200	1,063,756.00	0.05
431	000818	航锦科技	47,100	1,059,750.00	0.05
432	000708	中信特钢	90,000	1,058,400.00	0.05
433	603613	国联股份	44,600	1,056,574.00	0.05

434	000629	钒钛股份	412,100	1,054,976.00	0.05
435	300567	精测电子	17,400	1,054,614.00	0.05
436	600323	瀚蓝环境	43,300	1,054,355.00	0.05
437	603885	吉祥航空	78,200	1,053,354.00	0.05
438	000830	鲁西化工	102,000	1,050,600.00	0.05
439	002439	启明星辰	64,900	1,037,751.00	0.05
440	002603	以岭药业	73,500	1,036,350.00	0.05
441	600535	天士力	65,700	1,028,205.00	0.05
442	603000	人民网	49,400	998,374.00	0.05
443	600499	科达制造	101,800	997,640.00	0.05
444	300390	天华新能	51,800	987,826.00	0.05
445	002145	中核钛白	238,000	987,700.00	0.05
446	688005	容百科技	44,221	987,012.72	0.05
447	000563	陕国投A	272,800	973,896.00	0.05
448	600511	国药股份	33,200	968,112.00	0.05
449	600859	王府井	69,500	965,355.00	0.05
450	600655	豫园股份	172,900	959,595.00	0.05
451	000547	航天发展	114,200	959,280.00	0.05
452	600325	华发股份	195,400	951,598.00	0.05
453	601966	玲珑轮胎	64,600	947,682.00	0.05
454	600004	白云机场	103,900	945,490.00	0.05
455	603899	晨光股份	32,500	942,175.00	0.05
456	600131	国网信通	53,100	939,870.00	0.05
457	300529	健帆生物	42,700	921,039.00	0.05
458	603833	欧派家居	16,300	920,135.00	0.05
459	002756	永兴材料	28,700	911,225.00	0.04
460	600754	锦江酒店	40,500	908,820.00	0.04
461	000998	隆平高科	90,800	894,380.00	0.04
462	300601	康泰生物	58,800	893,172.00	0.04
463	300070	碧水源	194,000	873,000.00	0.04
464	300751	迈为股份	12,500	869,500.00	0.04
465	002120	韵达股份	129,700	868,990.00	0.04
466	601866	中远海发	351,800	868,946.00	0.04
467	600667	太极实业	130,200	856,716.00	0.04
468	300438	鹏辉能源	31,000	855,910.00	0.04
469	002544	普天科技	36,300	851,235.00	0.04
470	600867	通化东宝	103,600	849,520.00	0.04
471	600258	首旅酒店	58,900	832,257.00	0.04
472	000032	深桑达A	40,400	817,292.00	0.04
473	300457	赢合科技	34,800	800,400.00	0.04
474	300573	兴齐眼药	15,420	798,601.80	0.04
475	002508	老板电器	41,800	794,618.00	0.04
476	000069	华侨城A	351,800	791,550.00	0.04

477	000967	盈峰环境	111,300	773,535.00	0.04
478	300118	东方日升	80,700	773,106.00	0.04
479	002292	奥飞娱乐	79,300	770,796.00	0.04
480	002831	裕同科技	32,900	770,518.00	0.04
481	600129	太极集团	34,300	730,933.00	0.04
482	002572	索菲亚	50,700	710,307.00	0.03
483	002266	浙富控股	229,600	707,168.00	0.03
484	601636	旗滨集团	140,900	705,909.00	0.03
485	603650	彤程新材	21,300	684,795.00	0.03
486	688063	派能科技	15,043	678,138.44	0.03
487	000035	中国天楹	155,400	666,666.00	0.03
488	600864	哈投股份	111,000	662,670.00	0.03
489	300769	德方纳米	20,000	660,400.00	0.03
490	688390	固德威	14,959	649,968.55	0.03
491	600315	上海家化	29,600	623,672.00	0.03
492	002091	江苏国泰	85,200	619,404.00	0.03
493	002372	伟星新材	57,000	590,520.00	0.03
494	001914	招商积余	38,100	471,297.00	0.02
495	600007	中国国贸	17,800	366,324.00	0.02
496	600335	国机汽车	53,800	347,010.00	0.02
497	301381	赛维时代	10,300	205,485.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603049	中策橡胶	724	31,023.40	0.00
2	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
3	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
4	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
5	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
6	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	144,630,387.75	7.09
2	601318	中国平安	75,222,227.06	3.69
3	600036	招商银行	72,895,978.28	3.57
4	300750	宁德时代	67,405,384.46	3.30
5	601166	兴业银行	47,543,599.70	2.33
6	600900	长江电力	47,296,291.05	2.32
7	601899	紫金矿业	39,226,798.00	1.92
8	000333	美的集团	37,184,402.50	1.82

9	600030	中信证券	34,538,221.35	1.69
10	002594	比亚迪	33,269,745.00	1.63
11	601398	工商银行	32,984,856.00	1.62
12	600276	恒瑞医药	31,016,709.84	1.52
13	300059	东方财富	29,727,584.04	1.46
14	601328	交通银行	26,698,805.00	1.31
15	688981	中芯国际	26,511,153.32	1.30
16	000858	五粮液	26,409,510.00	1.29
17	600887	伊利股份	25,034,958.00	1.23
18	688041	海光信息	23,010,511.56	1.13
19	601288	农业银行	22,998,962.00	1.13
20	601816	京沪高铁	22,782,190.10	1.12

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	56,572,050.28	2.77
2	601318	中国平安	25,998,225.00	1.27
3	600036	招商银行	25,901,967.10	1.27
4	600900	长江电力	16,639,630.00	0.82
5	601166	兴业银行	15,454,819.00	0.76
6	601899	紫金矿业	13,572,830.00	0.67
7	601398	工商银行	11,767,610.00	0.58
8	600030	中信证券	11,756,586.60	0.58
9	688041	海光信息	11,440,845.12	0.56
10	688981	中芯国际	11,151,228.15	0.55
11	600276	恒瑞医药	10,710,914.36	0.53
12	601988	中国银行	9,173,795.00	0.45
13	600887	伊利股份	9,005,257.85	0.44
14	601328	交通银行	8,935,909.75	0.44
15	601288	农业银行	8,350,339.00	0.41
16	601816	京沪高铁	7,936,295.00	0.39
17	300750	宁德时代	7,713,375.00	0.38
18	600919	江苏银行	7,543,194.00	0.37
19	600000	浦发银行	6,648,841.70	0.33
20	688008	澜起科技	6,601,669.05	0.32

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	2,833,926,069.28
卖出股票收入（成交）总额	798,488,463.77

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，兴业银行股份有限公司、招商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规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	82,142.72
8	其他	-
9	合计	82,142.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	603049	中策橡胶	31,023.40	0.00	新股锁定
2	001388	信通电子	13,842.06	0.00	新股未上市
2	001388	信通电子	1,543.48	0.00	新股锁定
3	301590	优优绿能	10,182.04	0.00	新股锁定
4	603014	威高血净	6,699.40	0.00	新股锁定
5	301595	太力科技	5,703.60	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 （户）	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
3,340	597,779.28	1,777,194,808.00	89.01	219,387,995.00	10.99

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例（%）
----	---------	-----------

平安中证 A500ETF 联接	676,054,800.00	33.86
-----------------	----------------	-------

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	500,040,666.00	25.04
2	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	298,427,666.00	14.95
3	中国人寿保险股份有限公司	210,547,404.00	10.55
4	杨再贵	32,000,000.00	1.60
5	利安人寿保险股份有限公司—利安禧年金保险（分红型）	29,602,029.00	1.48
6	紫金信托有限责任公司	20,001,361.00	1.00
7	华泰证券股份有限公司	14,999,911.00	0.75
8	方正证券股份有限公司	12,944,919.00	0.65
9	张洋	5,000,388.00	0.25
10	国泰海通证券股份有限公司	3,952,707.00	0.20
11	中国农业银行股份有限公司—平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	676,054,800.00	33.86

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2025 年 3 月 26 日）	2,026,582,803.00
--------------------------	------------------

基金份额总额	
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	996,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,026,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,996,582,803.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

一、基金管理人的重大人事变动

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。

二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

2025 年 2 月，中国农业银行总行决定陈振华任托管业务部副总裁。

2025 年 3 月，中国农业银行总行决定常佳任托管业务部副总裁。

2025 年 4 月，中国农业银行总行决定李亚红任托管业务部高级专家。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，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 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等

情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
平安证券	6	3,631,888,204.69	100.00	700,334.09	100.00	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- （1）财务状况良好
- （2）经营行为规范
- （3）合规风控能力较高

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

10.7.2 基金租用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 (%)
平安证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 11 日
2	平安中证 A500 交易型开放式指数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 11 日
3	平安中证 A500 交易型开放式指数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 11 日
4	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 11 日
5	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 11 日
6	关于平安中证 A500 交易型开放式指	中国证监会规定报刊及	2025 年 03 月 11 日

	数证券投资基金上网发售的提示性公告	网站	
7	平安基金管理有限公司关于新增平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金网下现金认购代办券商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 14 日
8	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 27 日
9	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 31 日
10	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 01 日
11	平安基金管理有限公司平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 01 日
12	平安基金管理有限公司关于平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 03 日
13	平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 07 日
14	关于平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购、赎回单位的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 07 日
15	平安基金管理有限公司关于新增华泰证券股份有限公司为平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 11 日
16	平安基金管理有限公司关于新增国泰海通证券股份有限公司为平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 04 月 16 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国海证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 27 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增光大证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 27 日
19	关于新增光大证券股份有限公司为平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 06 月 27 日
20	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	2025 年 03 月 26 日-2025 年 06 月 30 日	0.00	500,040,666.00	0.00	500,040,666.00	25.04
	2	2025 年 03 月 26 日-2025 年 06 月 23 日	0.00	500,040,666.00	201,613,000.00	298,427,666.00	14.95
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2025 年 05 月 16 日-2025 年 06 月 30 日	0.00	676,232,600.00	177,800.00	676,054,800.00	33.86
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

（1）投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

平安基金管理有限公司

2025 年 08 月 28 日