

平安中证 500 交易型开放式指数证券投资
基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 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，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62

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	62
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	62
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	63
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	63
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末上市基金前十名持有人	64
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
§ 9 开放式基金份额变动	65
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	66
10.8 其他重大事件	70
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	71
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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	71
§ 12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	72

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 500ETF
场内简称	中证 500ETF 平安
基金主代码	510590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 23 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	122,386,121.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正
	联系电话	0755-22626828
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95511-3
传真	0755-23997878	0755-82080387
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路	广东省深圳市罗湖区深南东路

	5033 号平安金融中心 34 层	5047 号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座
邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,619,730.85
本期利润	18,466,442.12
加权平均基金份额本期利润	0.1790
本期加权平均净值利润率	2.80%
本期基金份额净值增长率	3.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	31,119,873.38
期末可供分配基金份额利润	0.2543
期末基金资产净值	764,594,511.99
期末基金份额净值	6.2474
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.64%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

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

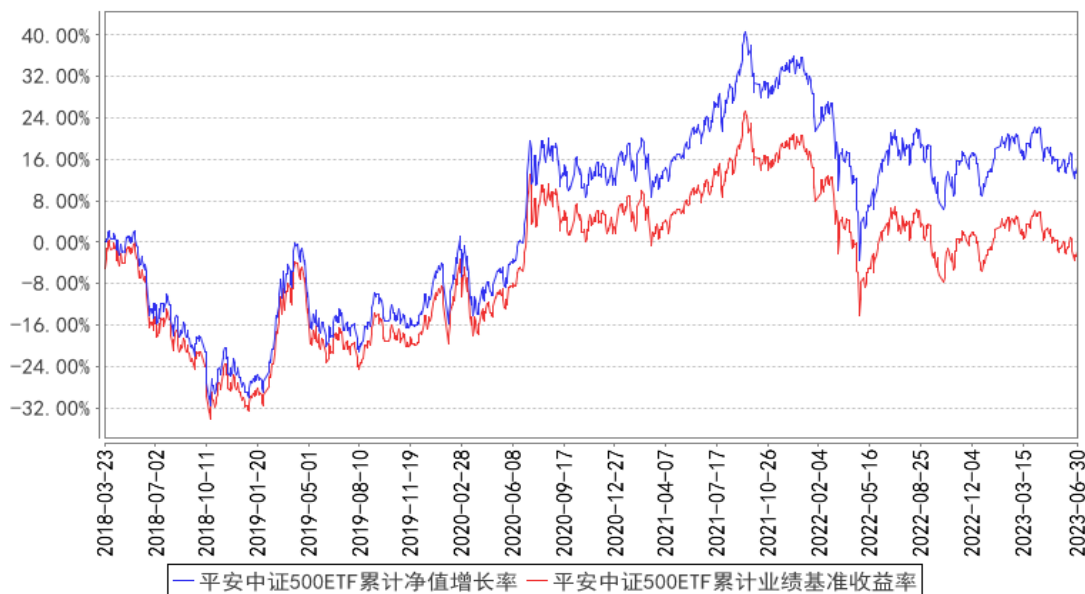
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.14%	0.94%	-0.81%	0.93%	0.67%	0.01%
过去三个月	-4.21%	0.83%	-5.38%	0.83%	1.17%	0.00%
过去六个月	3.49%	0.79%	2.29%	0.79%	1.20%	0.00%
过去一年	-4.76%	0.95%	-7.06%	0.96%	2.30%	-0.01%
过去三年	12.88%	1.18%	2.29%	1.19%	10.59%	-0.01%
自基金合同生效起至今	14.64%	1.35%	-1.68%	1.37%	16.32%	-0.02%

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

平安中证500ETF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 2018 年 03 月 23 日正式生效；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，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（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。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 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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		
成钧	ETF 指数投资中心投资执行总经理，平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 23 日	-	12 年	成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心投资执行总经理。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 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、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、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、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

王仁增	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2021 年 7 月 8 日	-	9 年	<p>王仁增先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任财通基金管理有限公司产品经理、华安基金管理有限公司高级产品经理。2021 年 6 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、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、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证消费电子主题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 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、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 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、平安创业板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 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、平安沪深 300 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联接基金、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、平安上海金交易</p>
-----	-------------------------------	----------------	---	-----	--

					型开放式证券投资基金、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 500 指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈

作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。报告期内，本基金的日均偏离度为 0.01%，年化跟踪误差 0.13%，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 6.2474 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.49%，业绩比较基准收益率为 2.29%。

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 2023 年下半年，市场对于政策面的预期更加积极。但在基本面上，投资者可能需要更多的耐心。无论是宏观经济还是微观企业盈利，当前经济修复的内生动能还不够强、需求依然偏弱，随着稳增长政策发力，有望推动基本面持续改善。在交易层面，市场交易量持续低位震荡表达了投资者对于当前市场保持较为谨慎的情绪。但随着政策推进，情绪面不会长期处在较低位置。从中长期角度看，当前 A 股市场估值较为合理，我们对 A 股市场前景保持相对乐观。

作为一只以紧密跟踪标的指数为目标的基金，本基金始终秉持持有人利益至上，严格按照基金合同的要求，做好投资组合管理。

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，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室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的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,620,219.85	2,896,496.37
结算备付金		1,830,512.29	2,493,407.65
存出保证金		2,433,305.34	1,684,268.41
交易性金融资产	6.4.7.2	745,655,994.61	580,150,793.56
其中：股票投资		745,497,966.05	580,150,793.56
基金投资		-	-
债券投资		158,028.56	-
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	11,995,060.82	-1,463.01
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,902,049.46	5,002,925.02
应收股利		28,986.70	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	121,492.81	14,737.87
资产总计		765,587,621.88	592,241,165.87
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		59,244.69	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		311,831.28	255,552.28
应付托管费		62,366.26	51,110.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.67	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	559,666.99	427,858.69
负债合计		993,109.89	734,521.42
净 资 产：			
实收基金	6.4.7.10	733,474,638.61	587,242,524.63
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	31,119,873.38	4,264,119.82
净资产合计		764,594,511.99	591,506,644.45
负债和净资产总计		765,587,621.88	592,241,165.87

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 6.2474 元，基金份额总额 122,386,121.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022
-----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 6 月 30 日	年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,719,174.39	-165,274,306.81
1. 利息收入		752,446.29	817,763.18
其中：存款利息收入	6.4.7.13	74,698.92	91,158.20
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		11,686.02	50,889.50
证券出借利息收入		666,061.35	675,715.48
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,251,573.56	-31,018,638.55
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-12,448,939.50	-36,164,226.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	127.50	31,078.81
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-93,886.49	-2,492,759.37
股利收益	6.4.7.19	8,291,124.93	7,607,268.92
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	23,086,172.97	-136,465,717.08
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	1,132,128.69	1,392,285.64
减：二、营业总支出		2,252,732.27	3,004,484.13
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,637,074.00	2,219,197.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	327,414.80	443,839.48
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		1,385.63	0.28
8. 其他费用	6.4.7.23	286,857.84	341,447.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		18,466,442.12	-168,278,790.94

减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		18,466,442.12	-168,278,790.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		18,466,442.12	-168,278,790.94

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	587,242,524.63	-	4,264,119.82	591,506,644.45
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	587,242,524.63	-	4,264,119.82	591,506,644.45
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	146,232,113.98	-	26,855,753.56	173,087,867.54
(一)、综合收益总额	-	-	18,466,442.12	18,466,442.12
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值	146,232,113.98	-	8,389,311.44	154,621,425.42

变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	203,766,060.43	-	13,039,610.70	216,805,671.13
2 .基金赎 回款	-57,533,946.45	-	-4,650,299.26	-62,184,245.71
(三)、 本期向 基金份 额持有 人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	733,474,638.61	-	31,119,873.38	764,594,511.99
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	1,052,308,591.67	-	245,983,494.81	1,298,292,086.48
加:会计 政策变 更	-	-	-	-
前期差 错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本 期初 净 资 产(基 金 净 值)	1,052,308,591.67	-	245,983,494.81	1,298,292,086.48
三、本 期 增 减 变 动 额(减 少以“-” 号填列)	-513,011,022.42	-	-194,991,259.14	-708,002,281.56
(一)、 综合收 益总额	-	-	-168,278,790.94	-168,278,790.94
(二)、 本期基 金份 额交 易产 生的 基金 净值 变动 数 (净值 减少 以 “-” 号 填列)	-513,011,022.42	-	-26,712,468.20	-539,723,490.62
其中:1. 基金申 购款	50,342,203.14	-	3,528,679.61	53,870,882.75
2 .基金 赎回 款	-563,353,225.56	-	-30,241,147.81	-593,594,373.37
(三)、 本期向 基金份 额持有 人分配 利润产 生的基 金净值 变动(净 值减少 以“-” 号填列)	-	-	-	-
(四)、 其他综	-	-	-	-

合收益 结转留 存收益				
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	539,297,569.25	-	50,992,235.67	590,289,804.92

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 500 交易型开放式指数证券投资基金（原名为平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2018]112 号《关于准予平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由平安基金管理有限公司（原平安大华基金管理有限公司，已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记）依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,648,533,409.00 元（含募集股票市值），业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0175 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 2,648,875,604.00 份，其中认购资金利息折合 342,195.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）自律监管决定书[2018]41 号审核同意，本基金 441,986,121.00 份基金份额于 2018 年 5 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏离度和跟

跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股；此外，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以在履行适当程序后，参与融资和转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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%。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、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

本基金本报告期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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

(2) 增值税

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。

（3）城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

（4）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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

（5）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	1,620,219.85
等于：本金	1,617,205.88
加：应计利息	3,013.97
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,620,219.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	781,796,546.25	-	745,497,966.05	-36,298,580.20
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	109,000.00	131.16	48,897.40
	银行间市场	-	-	-
	合计	109,000.00	131.16	48,897.40
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	781,905,546.25	131.16	745,655,994.61	-36,249,682.80
----	----------------	--------	----------------	----------------

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	15,577,320.00	-	-	
其中：股指期货投资	15,577,320.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	15,577,320.00	-	-	

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2309	IC2309	12.00	14,328,000.00	-61,120.00
IC2312	IC2312	1.00	1,184,840.00	-3,360.00
合计				-64,480.00
减：可抵销期货暂收款				-64,480.00
净额				0.00

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	11,995,060.82	-
银行间市场	-	-
合计	11,995,060.82	-

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 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	4,982.94
待摊费用	75,616.24
现金差额	40,893.63
合计	121,492.81

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	218,557.40
其中：交易所市场	218,557.40
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	217,587.09
应退退补款	123,313.40
可退替代款	209.10
合计	559,666.99

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	97,986,121.00	587,242,524.63
本期申购	34,000,000.00	203,766,060.43
本期赎回（以“-”号填列）	-9,600,000.00	-57,533,946.45
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	122,386,121.00	733,474,638.61

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	136,600,121.14	-132,336,001.32	4,264,119.82
本期利润	-4,619,730.85	23,086,172.97	18,466,442.12
本期基金份额交易产生的变动数	34,038,052.38	-25,648,740.94	8,389,311.44
其中：基金申购款	47,327,085.15	-34,287,474.45	13,039,610.70
基金赎回款	-13,289,032.77	8,638,733.51	-4,650,299.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	166,018,442.67	-134,898,569.29	31,119,873.38

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	49,780.72

定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	24,398.76
其他	519.44
合计	74,698.92

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-12,103,320.09
股票投资收益——赎回差价收入	-345,619.41
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	-12,448,939.50

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	126,372,843.42
减：卖出股票成本总额	138,085,035.25
减：交易费用	391,128.26
买卖股票差价收入	-12,103,320.09

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 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	62,184,245.71
减：现金支付赎回款总额	30,379,882.71
减：赎回股票成本总额	32,149,982.41
减：交易费用	-
赎回差价收入	-345,619.41

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	127.50
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	127.50

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-93,886.49

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	8,291,124.93
其中：证券出借权益补偿收入	579,440.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,291,124.93

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	22,752,812.97
股票投资	22,703,915.57
债券投资	48,897.40
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	333,360.00
权证投资	-
期货投资	333,360.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	23,086,172.97

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,132,128.69
合计	1,132,128.69

注：替代损益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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	98,224.42
其他	99,373.27
合计	286,857.84

6.4.7.24 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无须作披露的分部报告。

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
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东

三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“平安 500ETF 联接基金”)	本基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例(%)
方正证券	4,800,431.71	1.45	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
方正证券	3,462.51	1.45	3,462.51	1.58

关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 (%)
-	-	-	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,637,074.00	2,219,197.29
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6 月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	327,414.80	443,839.48

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	1,319,600.00	1,275.41	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	65,700.00	8.21	-	-

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:股)	出借期限(单位:天)	费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	2023042000003568	普洛药业	2023-04-20	254,492.00	12,200	14	1.00	98.97	-	-
平安证券	2023050800005266	辽港股份	2023-05-08	52,752.00	31,400	14	2.30	47.18	-	-
平安证券	2023050900004697	达安基因	2023-05-09	61,800.00	5,000	14	3.00	72.10	-	-
平安证券	2023051000004767	华电国际	2023-05-10	12,100.00	2,000	14	2.30	10.82	-	-
平安证券	2023052200050006	辽港股份	2023-05-22	50,554.00	31,400	14	2.80	55.05	-	-
平安证券	202305240001	华电国际	2023-05-24	6,000.00	1,000	14	2.70	6.30	-	-

	9156									
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
方正证券	615,049.00	0.5025	878,912.00	0.8970
平安 500ETF 联接基金	93,817,399.00	76.6569	68,577,532.00	69.9870
平安人寿	22,668,019.00	18.5217	22,668,019.00	23.1339

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	1,620,219.85	49,780.72	10,703,228.07	54,691.10

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 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
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	951	11,297.88	19,990.02	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	50.00	30.71	714	35,700.00	21,926.94	-

注：根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023 年 6 月 28 日	重大事项停牌	6.97	2023 年 07 月 03 日	7.40	77,600	481,079.79	540,872.00	-
000540	*ST 中天	2023 年 5 月 19 日	股票退市	0.11	-	-	327,600	791,939.16	36,036.00	-

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000012	南玻A	2023年7月10日	5.96	15,500	92,380.00
2	000021	深科技	2023年7月13日	19.99	10,100	201,899.00
3	000027	深圳能源	2023年7月10日	6.59	18,800	123,892.00
4	000039	中集集团	2023年7月10日	6.89	20,700	142,623.00
5	000060	中金岭南	2023年7月13日	4.75	28,100	133,475.00
6	000066	中国长城	2023年7月10日	13.83	18,500	255,855.00
7	000089	深圳机场	2023年7月14日	6.95	11,000	76,450.00
8	000401	冀东水泥	2023年7月12日	7.37	8,000	58,960.00
9	000519	中兵红箭	2023年7月11日	18.09	11,500	208,035.00
10	000559	万向钱潮	2023年7月5日-2023年7月12日	5.45	20,000	109,000.00
11	000563	陕国投A	2023年7月5日	3.05	22,600	68,930.00
12	000629	钒钛股份	2023年7月3日-2023年7月13日	3.91	37,600	147,016.00
13	000750	国海证券	2023年7月13日	3.35	17,800	59,630.00
14	000807	云铝股份	2023年7月11日	12.73	17,400	221,502.00
15	000830	鲁西化工	2023年7月3日	10.56	14,900	157,344.00
16	000831	中国稀土	2023年7月11日	29.60	11,000	325,600.00
17	000883	湖北能源	2023年7月10日	4.56	21,700	98,952.00
18	000930	中粮科技	2023年7月5日	8.10	10,100	81,810.00
19	000960	锡业股份	2023年7月10日	15.55	11,200	174,160.00
20	000988	华工科	2023年7月13日	38.01	10,200	387,702.00

		技				0
21	002030	达安基因	2023 年 7 月 10 日	9.97	11,000	109,670.00
22	002065	东华软件	2023 年 7 月 13 日	7.06	24,200	170,852.00
23	002081	金螳螂	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 12 日	4.51	16,600	74,866.00
24	002092	中泰化学	2023 年 7 月 4 日	6.45	22,500	145,125.00
25	002128	电投能源	2023 年 7 月 11 日	13.22	4,100	54,202.00
26	002131	利欧股份	2023 年 7 月 11 日-2023 年 7 月 14 日	2.30	92,900	213,670.00
27	002152	广电运通	2023 年 7 月 11 日	11.72	13,000	152,360.00
28	002155	湖南黄金	2023 年 7 月 13 日	12.20	17,600	214,720.00
29	002156	通富微电	2023 年 7 月 10 日	22.60	10,100	228,260.00
30	002183	怡亚通	2023 年 7 月 3 日	5.10	19,700	100,470.00
31	002185	华天科技	2023 年 7 月 3 日	9.20	27,800	255,760.00
32	002195	二三四五	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 14 日	2.89	62,000	179,180.00
33	002221	东华能源	2023 年 7 月 11 日-2023 年 7 月 14 日	8.65	11,900	102,935.00
34	002244	滨江集团	2023 年 7 月 13 日	8.82	13,400	118,188.00
35	002249	大洋电机	2023 年 7 月 14 日	5.70	19,100	108,870.00
36	002281	光迅科技	2023 年 7 月 11 日	37.09	4,000	148,360.00
37	002368	太极股份	2023 年 7 月 11 日	41.17	10,500	432,285.00
38	002372	伟星新材	2023 年 7 月 3 日	20.54	13,800	283,452.00
39	002373	千方科技	2023 年 7 月 10 日	13.64	12,300	167,772.00
40	002407	多氟多	2023 年 7 月 11 日	19.86	16,000	317,760.00
41	002408	齐翔腾达	2023 年 7 月 14 日	6.37	19,100	121,667.00
42	002422	科伦药	2023 年 7 月 10 日	29.68	2,000	59,360.00

		业				
43	002429	兆驰股份	2023 年 7 月 10 日	5.50	17,200	94,600.00
44	002463	沪电股份	2023 年 7 月 10 日	20.94	12,000	251,280.00
45	002497	雅化集团	2023 年 7 月 4 日	17.78	12,500	222,250.00
46	002506	协鑫集成	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 10 日	2.93	31,500	92,295.00
47	002532	天山铝业	2023 年 7 月 11 日-2023 年 7 月 12 日	5.99	18,200	109,018.00
48	002624	完美世界	2023 年 7 月 13 日	16.89	14,600	246,594.00
49	002625	光启技术	2023 年 7 月 13 日	15.26	15,000	228,900.00
50	002670	国盛金控	2023 年 7 月 14 日	8.78	12,700	111,506.00
51	002739	万达电影	2023 年 7 月 14 日	12.54	14,100	176,814.00
52	002745	木林森	2023 年 7 月 4 日	9.20	10,200	93,840.00
53	002939	长城证券	2023 年 7 月 4 日	8.13	16,600	134,958.00
54	002958	青农商行	2023 年 7 月 14 日	2.72	42,000	114,240.00
55	003035	南网能源	2023 年 7 月 4 日	7.12	16,400	116,768.00
56	300009	安科生物	2023 年 7 月 13 日	10.00	5,000	50,000.00
57	300012	华测检测	2023 年 7 月 10 日	19.50	18,500	360,750.00
58	300017	网宿科技	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	7.11	26,300	186,993.00
59	300024	机器人	2023 年 7 月 13 日	16.67	24,100	401,747.00
60	300026	红日药业	2023 年 7 月 10 日	5.42	23,600	127,912.00
61	300058	蓝色光标	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 12 日	9.67	25,100	242,717.00
62	300070	碧水源	2023 年 7 月 4 日	5.36	23,500	125,960.00
63	300115	长盈精密	2023 年 7 月 3 日	11.91	14,500	172,695.00
64	300118	东方日升	2023 年 7 月 11 日	25.63	10,000	256,300.00

65	300136	信维通信	2023 年 7 月 13 日	20.08	15,000	301,200.00
66	300182	捷成股份	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 11 日	6.31	23,000	145,130.00
67	300251	光线传媒	2023 年 7 月 14 日	8.09	12,800	103,552.00
68	300253	卫宁健康	2023 年 7 月 4 日	10.82	20,000	216,400.00
69	300296	利亚德	2023 年 7 月 10 日	6.53	22,800	148,884.00
70	300383	光环新网	2023 年 7 月 13 日	10.75	16,700	179,525.00
71	300390	天华新能	2023 年 7 月 14 日	35.80	12,600	451,080.00
72	600021	上海电力	2023 年 7 月 11 日	10.77	12,400	133,548.00
73	600027	华电国际	2023 年 7 月 13 日	6.69	31,000	207,390.00
74	600056	中国医药	2023 年 7 月 4 日-2023 年 7 月 11 日	12.98	18,000	233,640.00
75	600096	云天化	2023 年 7 月 12 日	17.07	17,500	298,725.00
76	600126	杭钢股份	2023 年 7 月 3 日	4.34	14,600	63,364.00
77	600155	华创云信	2023 年 7 月 11 日	6.22	12,700	78,994.00
78	600161	天坛生物	2023 年 7 月 4 日	27.15	3,000	81,450.00
79	600167	联美控股	2023 年 7 月 5 日	6.97	10,300	71,791.00
80	600170	上海建工	2023 年 7 月 13 日	2.69	16,000	43,040.00
81	600171	上海贝岭	2023 年 7 月 13 日	18.25	12,100	220,825.00
82	600177	雅戈尔	2023 年 7 月 14 日	6.31	23,400	147,654.00
83	600297	广汇汽车	2023 年 7 月 4 日	2.08	51,600	107,328.00
84	600339	中油工程	2023 年 7 月 4 日	4.07	18,700	76,109.00
85	600352	浙江龙盛	2023 年 7 月 3 日	9.35	21,200	198,220.00
86	600372	中航电子	2023 年 7 月 13 日	15.18	24,200	367,356.00

87	600373	中文传媒	2023 年 7 月 13 日	13.32	13,900	185,148.00
88	600392	盛和资源	2023 年 7 月 13 日	12.87	3,600	46,332.00
89	600409	三友化工	2023 年 7 月 10 日	5.45	13,400	73,030.00
90	600482	中国动力	2023 年 7 月 11 日	23.44	27,700	649,288.00
91	600487	亨通光电	2023 年 7 月 10 日	14.66	22,100	323,986.00
92	600499	科达制造	2023 年 7 月 10 日	11.36	15,200	172,672.00
93	600500	中化国际	2023 年 7 月 10 日	5.56	16,000	88,960.00
94	600507	方大特钢	2023 年 7 月 14 日	4.63	1,200	5,556.00
95	600516	方大炭素	2023 年 7 月 13 日	6.20	30,400	188,480.00
96	600535	天士力	2023 年 7 月 13 日	14.51	2,000	29,020.00
97	600536	中国软件	2023 年 7 月 3 日	46.88	10,300	482,864.00
98	600546	山煤国际	2023 年 7 月 11 日	14.47	1,000	14,470.00
99	600556	天下秀	2023 年 7 月 4 日	7.09	10,300	73,027.00
100	600580	卧龙电驱	2023 年 7 月 14 日	14.61	1,900	27,759.00
101	600655	豫园股份	2023 年 7 月 10 日	6.86	21,600	148,176.00
102	600667	太极实业	2023 年 7 月 13 日	7.26	14,800	107,448.00
103	600673	东阳光	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 13 日	7.21	17,200	124,012.00
104	600705	中航产融	2023 年 7 月 4 日	3.83	80,000	306,400.00
105	600718	东软集团	2023 年 7 月 13 日	10.66	17,800	189,748.00
106	600739	辽宁成大	2023 年 7 月 3 日	13.15	11,600	152,540.00
107	600765	中航重机	2023 年 7 月 13 日	26.51	11,100	294,261.00
108	600782	新钢股份	2023 年 7 月 3 日	3.71	21,300	79,023.00
109	600839	四川长虹	2023 年 7 月 13 日-2023 年 7 月 13 日	5.05	39,900	201,495.00

110	600863	内蒙华电	2023 年 7 月 4 日	4.15	15,000	62,250.00
111	600873	梅花生物	2023 年 7 月 3 日	8.93	17,000	151,810.00
112	600879	航天电子	2023 年 7 月 13 日	8.49	29,900	253,851.00
113	600901	江苏金租	2023 年 7 月 11 日	4.13	23,660	97,715.80
114	600928	西安银行	2023 年 7 月 13 日	3.52	14,900	52,448.00
115	600959	江苏有线	2023 年 7 月 10 日	3.38	33,300	112,554.00
116	600985	淮北矿业	2023 年 7 月 11 日	11.52	3,000	34,560.00
117	600998	九州通	2023 年 7 月 10 日	10.38	15,645	162,395.10
118	601000	唐山港	2023 年 7 月 3 日	3.53	27,700	97,781.00
119	601016	节能风电	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 11 日	3.67	42,400	155,608.00
120	601058	赛轮轮胎	2023 年 7 月 4 日	11.39	26,500	301,835.00
121	601106	中国一重	2023 年 7 月 10 日	3.36	30,400	102,144.00
122	601118	海南橡胶	2023 年 7 月 10 日	4.48	19,100	85,568.00
123	601162	天风证券	2023 年 7 月 13 日-2023 年 7 月 14 日	2.98	63,000	187,740.00
124	601179	中国西电	2023 年 7 月 10 日-2023 年 7 月 12 日	5.41	23,000	124,430.00
125	601456	国联证券	2023 年 7 月 14 日	9.10	18,400	167,440.00
126	601555	东吴证券	2023 年 7 月 11 日	6.94	49,800	345,612.00
127	601568	北元集团	2023 年 7 月 11 日	5.27	13,000	68,510.00
128	601611	中国核建	2023 年 7 月 5 日	8.45	10,400	87,880.00
129	601636	旗滨集团	2023 年 7 月 10 日	8.62	18,100	156,022.00
130	601696	中银证券	2023 年 7 月 13 日	10.66	13,300	141,778.00
131	601718	际华集团	2023 年 7 月 12 日-2023 年 7 月 13 日	2.97	5,900	17,523.00
132	601778	晶科科技	2023 年 7 月 5 日-2023 年	4.94	30,800	152,152.00

		技	7 月 11 日			0
133	601866	中远海发	2023 年 7 月 10 日	2.47	44,400	109,668.00
134	601928	凤凰传媒	2023 年 7 月 11 日	11.40	19,700	224,580.00
135	601992	金隅集团	2023 年 7 月 10 日	2.18	47,300	103,114.00
136	603077	和邦生物	2023 年 7 月 3 日-2023 年 7 月 4 日	2.43	67,000	162,810.00
137	603885	吉祥航空	2023 年 7 月 4 日	15.43	14,000	216,020.00
138	688538	和辉光电	2023 年 7 月 3 日	2.54	11,700	29,718.00
139	688777	中控技术	2023 年 7 月 5 日-2023 年 7 月 11 日	62.78	9,350	586,993.00
合计	-	-	-	-	2,755,455	23,194,545.90

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、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。本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小。

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）

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.02%（上年末：无）。

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，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	1,620,219.85	-	-	-	1,620,219.85
结算备付金	1,830,512.29	-	-	-	1,830,512.29
存出保证金	106,379.34	-	-	2,326,926.00	2,433,305.34
交易性金融资产	158,028.56	-	-	-745,497,966.05	745,655,994.61
买入返售金融资产	11,995,060.82	-	-	-	11,995,060.82
应收股利	-	-	-	28,986.70	28,986.70
应收清算款	-	-	-	-1,902,049.46	1,902,049.46
其他资产	-	-	-	121,492.81	121,492.81
资产总计	15,710,200.86	-	-	-749,877,421.02	765,587,621.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	311,831.28	311,831.28
应付托管费	-	-	-	62,366.26	62,366.26
应付清算款	-	-	-	59,244.69	59,244.69
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	559,666.99	559,666.99
负债总计	-	-	-	993,109.89	993,109.89
利率敏感度缺口	15,710,200.86	-	-	-748,884,311.13	764,594,511.99
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,896,496.37	-	-	-	2,896,496.37
结算备付金	2,493,407.65	-	-	-	2,493,407.65
存出保证金	86,431.61	-	-	1,597,836.80	1,684,268.41
交易性金融资产	-	-	-	-580,150,793.56	580,150,793.56
买入返售金融资产	-1,463.01	-	-	-	-1,463.01
应收清算款	-	-	-	5,002,925.02	5,002,925.02
其他资产	-	-	-	14,737.87	14,737.87
资产总计	5,474,872.62	-	-	-586,766,293.25	592,241,165.87
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	255,552.28	255,552.28
应付托管费	-	-	-	51,110.45	51,110.45
其他负债	-	-	-	427,858.69	427,858.69
负债总计	-	-	-	734,521.42	734,521.42
利率敏感度缺口	5,474,872.62	-	-	-586,031,771.83	591,506,644.45

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：于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为：0.02%（上年末：无），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例（%）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
交易性金融资产—股票投资	745,497,966.05	97.50	580,150,793.56	98.08
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	745,497,966.05	97.50	580,150,793.56	98.08

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		
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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月）	

			31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	29,857,722.11	27,235,563.65
	沪深 300 指数下降 5%	-29,857,722.11	-27,235,563.65

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	745,034,998.25	576,862,189.36
第二层次	576,908.00	2,206,782.00
第三层次	44,088.36	1,081,822.20
合计	745,655,994.61	580,150,793.56

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	745,497,966.05	97.38
	其中：股票	745,497,966.05	97.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	158,028.56	0.02
	其中：债券	158,028.56	0.02
	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	11,995,060.82	1.57
	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	3,450,732.14	0.45
8	其他各项资产	4,485,834.31	0.59
9	合计	765,587,621.88	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 23,194,545.90 元，占净值比例 3.03%。

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	5,216,884.00	0.68
B	采矿业	27,486,997.92	3.59
C	制造业	467,316,395.03	61.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	25,755,742.49	3.37
E	建筑业	8,289,929.00	1.08
F	批发和零售业	23,588,987.80	3.09
G	交通运输、仓储和邮政业	11,206,823.82	1.47
H	住宿和餐饮业	1,392,521.80	0.18
I	信息传输、软件和	61,197,861.57	8.00

	信息技术服务业		
J	金融业	63,886,080.09	8.36
K	房地产业	10,159,854.00	1.33
L	租赁和商务服务业	9,199,665.22	1.20
M	科学研究和技术服务业	8,372,996.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	4,142,296.69	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,732,487.00	0.49
R	文化、体育和娱乐业	10,543,546.80	1.38
S	综合	3,928,772.46	0.51
	合计	745,417,841.69	97.49

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	24,098.34	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	19,990.02	0.00
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	36,036.00	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐	-	-

	业		
S	综合	-	-
	合计	80,124.36	0.01

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	300308	中际旭创	70,700	10,424,715.00	1.36
2	688256	寒武纪	22,997	4,323,436.00	0.57
3	000988	华工科技	110,225	4,189,652.25	0.55
4	002340	格林美	562,900	3,889,639.00	0.51
5	002384	东山精密	150,000	3,885,000.00	0.51
6	002422	科伦药业	129,700	3,849,496.00	0.50
7	600372	中航电子	245,500	3,726,690.00	0.49
8	300418	昆仑万维	91,710	3,694,078.80	0.48
9	300012	华测检测	184,200	3,591,900.00	0.47
10	600157	永泰能源	2,437,000	3,460,540.00	0.45
11	300724	捷佳伟创	30,600	3,437,910.00	0.45
12	600079	人福医药	125,300	3,375,582.00	0.44
13	600489	中金黄金	319,100	3,296,303.00	0.43
14	300003	乐普医疗	144,500	3,267,145.00	0.43
15	688777	中控技术	51,977	3,263,116.06	0.43
16	002738	中矿资源	62,440	3,180,693.60	0.42
17	600487	亨通光电	216,100	3,168,026.00	0.41
18	002028	思源电气	67,100	3,134,912.00	0.41
19	600536	中国软件	65,898	3,089,298.24	0.40
20	002463	沪电股份	146,100	3,059,334.00	0.40
21	601058	赛轮轮胎	268,400	3,057,076.00	0.40
22	601555	东吴证券	439,640	3,051,101.60	0.40
23	600765	中航重机	112,960	2,994,569.60	0.39
24	300037	新宙邦	57,320	2,974,334.80	0.39
25	000066	中国长城	212,000	2,931,960.00	0.38
26	600885	宏发股份	91,452	2,912,746.20	0.38
27	000807	云铝股份	228,500	2,908,805.00	0.38
28	600482	中国动力	118,500	2,777,640.00	0.36
29	000009	中国宝安	226,578	2,734,796.46	0.36
30	688099	晶晨股份	32,334	2,726,402.88	0.36
31	000423	东阿阿胶	50,300	2,688,535.00	0.35
32	300146	汤臣倍健	112,100	2,688,158.00	0.35

33	600352	浙江龙盛	285,800	2,672,230.00	0.35
34	300058	蓝色光标	272,966	2,639,581.22	0.35
35	002966	苏州银行	401,780	2,631,659.00	0.34
36	002156	通富微电	116,304	2,628,470.40	0.34
37	002185	华天科技	280,800	2,583,360.00	0.34
38	601108	财通证券	355,900	2,576,716.00	0.34
39	600415	小商品城	300,900	2,566,677.00	0.34
40	002625	光启技术	165,500	2,525,530.00	0.33
41	002624	完美世界	148,950	2,515,765.50	0.33
42	300144	宋城演艺	200,900	2,491,160.00	0.33
43	600027	华电国际	372,000	2,488,680.00	0.33
44	600109	国金证券	286,200	2,481,354.00	0.32
45	000783	长江证券	424,800	2,463,840.00	0.32
46	600988	赤峰黄金	182,400	2,455,104.00	0.32
47	600161	天坛生物	90,400	2,454,360.00	0.32
48	601233	桐昆股份	184,800	2,448,600.00	0.32
49	601077	渝农商行	679,400	2,439,046.00	0.32
50	002008	大族激光	92,300	2,418,260.00	0.32
51	300568	星源材质	140,600	2,416,914.00	0.32
52	600418	江淮汽车	191,600	2,412,244.00	0.32
53	300285	国瓷材料	87,996	2,411,090.40	0.32
54	600298	安琪酵母	66,500	2,407,965.00	0.31
55	600096	云天化	140,900	2,405,163.00	0.31
56	002385	大北农	362,600	2,393,160.00	0.31
57	002223	鱼跃医疗	65,798	2,368,070.02	0.31
58	002407	多氟多	117,540	2,334,344.40	0.31
59	000630	铜陵有色	807,300	2,333,097.00	0.31
60	603444	吉比特	4,747	2,331,299.17	0.30
61	603882	金域医学	30,800	2,325,400.00	0.30
62	600862	中航高科	91,600	2,318,396.00	0.30
63	300390	天华新能	64,220	2,299,076.00	0.30
64	002409	雅克科技	31,300	2,281,144.00	0.30
65	300024	机器人	136,200	2,270,454.00	0.30
66	601162	天风证券	760,500	2,266,290.00	0.30
67	603688	石英股份	19,900	2,265,416.00	0.30
68	002497	雅化集团	126,400	2,247,392.00	0.29
69	300474	景嘉微	24,950	2,245,250.50	0.29
70	000933	神火股份	172,600	2,243,800.00	0.29
71	300395	菲利华	45,400	2,233,680.00	0.29
72	300073	当升科技	44,200	2,224,586.00	0.29
73	002240	盛新锂能	69,800	2,224,526.00	0.29
74	600705	中航产融	580,700	2,224,081.00	0.29
75	300604	长川科技	46,800	2,222,532.00	0.29

76	601168	西部矿业	208,800	2,194,488.00	0.29
77	605358	立昂微	59,300	2,178,089.00	0.28
78	002439	启明星辰	72,900	2,169,504.00	0.28
79	000932	华菱钢铁	454,020	2,165,675.40	0.28
80	600066	宇通客车	145,800	2,149,092.00	0.28
81	603596	伯特利	27,100	2,147,946.00	0.28
82	000975	银泰黄金	182,632	2,136,794.40	0.28
83	300136	信维通信	106,300	2,134,504.00	0.28
84	002600	领益智造	308,900	2,134,499.00	0.28
85	600060	海信视像	86,100	2,130,975.00	0.28
86	002138	顺络电子	88,303	2,111,324.73	0.28
87	002797	第一创业	368,200	2,106,104.00	0.28
88	002568	百润股份	57,580	2,093,033.00	0.27
89	002465	海格通信	201,900	2,087,646.00	0.27
90	603816	顾家家居	54,200	2,067,730.00	0.27
91	002850	科达利	15,600	2,063,100.00	0.27
92	600563	法拉电子	14,990	2,058,127.00	0.27
93	601128	常熟银行	300,600	2,050,092.00	0.27
94	603939	益丰药房	55,340	2,047,580.00	0.27
95	000021	深科技	102,400	2,046,976.00	0.27
96	600839	四川长虹	405,200	2,046,260.00	0.27
97	600160	巨化股份	148,130	2,041,231.40	0.27
98	300253	卫宁健康	188,500	2,039,570.00	0.27
99	000591	太阳能	300,200	2,035,356.00	0.27
100	300832	新产业	34,300	2,023,700.00	0.26
101	600879	航天电子	238,300	2,023,167.00	0.26
102	600873	梅花生物	225,900	2,017,287.00	0.26
103	688567	孚能科技	93,300	2,014,347.00	0.26
104	000683	远兴能源	277,800	1,997,382.00	0.26
105	688521	芯原股份	27,600	1,984,992.00	0.26
106	601990	南京证券	242,500	1,983,650.00	0.26
107	600392	盛和资源	153,910	1,980,821.70	0.26
108	002368	太极股份	47,996	1,975,995.32	0.26
109	002078	太阳纸业	184,700	1,974,443.00	0.26
110	300699	光威复材	63,776	1,967,489.60	0.26
111	600497	驰宏锌锗	391,300	1,964,326.00	0.26
112	300866	安克创新	22,400	1,960,000.00	0.26
113	688169	石头科技	6,100	1,956,148.00	0.26
114	601696	中银证券	182,700	1,947,582.00	0.25
115	603589	口子窖	39,300	1,939,455.00	0.25
116	000729	燕京啤酒	154,300	1,924,121.00	0.25
117	300118	东方日升	75,000	1,922,250.00	0.25
118	600177	雅戈尔	304,400	1,920,764.00	0.25

119	600516	方大炭素	308,840	1,914,808.00	0.25
120	002025	航天电器	30,000	1,914,000.00	0.25
121	000831	中国稀土	64,600	1,912,160.00	0.25
122	002294	信立泰	61,100	1,905,709.00	0.25
123	300017	网宿科技	266,800	1,896,948.00	0.25
124	600141	兴发集团	85,360	1,896,699.20	0.25
125	688390	固德威	11,348	1,893,527.28	0.25
126	600642	申能股份	268,801	1,878,918.99	0.25
127	000728	国元证券	287,500	1,874,500.00	0.25
128	002673	西部证券	294,400	1,869,440.00	0.24
129	002430	杭氧股份	54,000	1,855,440.00	0.24
130	600699	均胜电子	104,980	1,851,847.20	0.24
131	000629	钒钛股份	470,900	1,841,219.00	0.24
132	002532	天山铝业	306,200	1,834,138.00	0.24
133	600170	上海建工	681,200	1,832,428.00	0.24
134	600325	华发股份	185,600	1,828,160.00	0.24
135	600118	中国卫星	64,700	1,825,187.00	0.24
136	002273	水晶光电	152,309	1,818,569.46	0.24
137	002195	二三四五	626,708	1,811,186.12	0.24
138	002268	电科网安	64,800	1,805,976.00	0.24
139	600153	建发股份	165,200	1,802,332.00	0.24
140	601966	玲珑轮胎	81,100	1,802,042.00	0.24
141	002739	万达电影	143,400	1,798,236.00	0.24
142	002372	伟星新材	87,440	1,796,017.60	0.23
143	600486	扬农化工	20,513	1,793,246.46	0.23
144	600521	华海药业	97,200	1,789,452.00	0.23
145	600166	福田汽车	526,000	1,788,400.00	0.23
146	000400	许继电气	77,490	1,786,144.50	0.23
147	600143	金发科技	204,000	1,780,920.00	0.23
148	300595	欧普康视	58,800	1,775,172.00	0.23
149	000998	隆平高科	115,500	1,772,925.00	0.23
150	600549	厦门钨业	93,100	1,771,693.00	0.23
151	688002	睿创微纳	39,540	1,771,392.00	0.23
152	603000	人民网	60,600	1,769,520.00	0.23
153	600399	抚顺特钢	173,100	1,765,620.00	0.23
154	600637	东方明珠	224,400	1,754,808.00	0.23
155	000738	航发控制	71,800	1,751,920.00	0.23
156	688072	拓荆科技	4,100	1,746,477.00	0.23
157	689009	九号公司	47,231	1,740,462.35	0.23
158	002065	东华软件	245,800	1,735,348.00	0.23
159	002444	巨星科技	79,100	1,730,708.00	0.23
160	688220	翱捷科技	22,946	1,729,898.94	0.23
161	300487	蓝晓科技	27,650	1,725,913.00	0.23

162	600859	王府井	87,100	1,723,709.00	0.23
163	688536	思瑞浦	7,900	1,722,200.00	0.23
164	600481	双良节能	122,900	1,718,142.00	0.22
165	601577	长沙银行	220,300	1,709,528.00	0.22
166	000997	新大陆	90,300	1,706,670.00	0.22
167	601198	东兴证券	212,800	1,706,656.00	0.22
168	002131	利欧股份	739,700	1,701,310.00	0.22
169	600499	科达制造	149,600	1,699,456.00	0.22
170	002353	杰瑞股份	67,484	1,695,872.92	0.22
171	300438	鹏辉能源	35,300	1,695,812.00	0.22
172	300383	光环新网	157,400	1,692,050.00	0.22
173	600704	物产中大	342,150	1,690,221.00	0.22
174	000960	锡业股份	108,200	1,682,510.00	0.22
175	300682	朗新科技	71,900	1,673,832.00	0.22
176	600271	航天信息	121,600	1,664,704.00	0.22
177	300001	特锐德	79,975	1,661,880.50	0.22
178	600021	上海电力	154,300	1,661,811.00	0.22
179	000519	中兵红箭	91,500	1,655,235.00	0.22
180	601997	贵阳银行	320,700	1,654,812.00	0.22
181	002373	千方科技	121,037	1,650,944.68	0.22
182	603077	和邦生物	677,500	1,646,325.00	0.22
183	688009	中国通号	283,300	1,643,140.00	0.21
184	300676	华大基因	27,300	1,637,727.00	0.21
185	000703	恒逸石化	241,100	1,634,658.00	0.21
186	000623	吉林敖东	101,800	1,632,872.00	0.21
187	300088	长信科技	269,600	1,625,688.00	0.21
188	002507	涪陵榨菜	88,690	1,623,913.90	0.21
189	002056	横店东磁	89,100	1,622,511.00	0.21
190	688516	奥特维	8,600	1,620,240.00	0.21
191	600380	健康元	126,572	1,608,730.12	0.21
192	600511	国药股份	41,300	1,604,505.00	0.21
193	600867	通化东宝	153,200	1,599,408.00	0.21
194	002152	广电运通	136,200	1,596,264.00	0.21
195	000513	丽珠集团	40,986	1,594,765.26	0.21
196	600998	九州通	153,225	1,590,475.50	0.21
197	600498	烽火通信	78,000	1,588,860.00	0.21
198	002281	光迅科技	42,800	1,587,452.00	0.21
199	600529	山东药玻	58,200	1,584,204.00	0.21
200	600546	山煤国际	108,700	1,572,889.00	0.21
201	002299	圣农发展	81,800	1,566,470.00	0.20
202	600348	华阳股份	197,950	1,565,784.50	0.20
203	002203	海亮股份	130,307	1,564,987.07	0.20
204	688301	奕瑞科技	5,540	1,564,662.20	0.20

205	601016	节能风电	425,750	1,562,502.50	0.20
206	000636	风华高科	101,514	1,557,224.76	0.20
207	603338	浙江鼎力	27,776	1,555,733.76	0.20
208	603517	绝味食品	41,800	1,552,870.00	0.20
209	600739	辽宁成大	117,500	1,545,125.00	0.20
210	603712	七一二	50,955	1,539,350.55	0.20
211	002595	豪迈科技	43,600	1,531,668.00	0.20
212	002192	融捷股份	22,800	1,523,724.00	0.20
213	601636	旗滨集团	176,400	1,520,568.00	0.20
214	603737	三棵树	23,220	1,519,052.40	0.20
215	002080	中材科技	73,500	1,508,220.00	0.20
216	002531	天顺风能	98,500	1,500,155.00	0.20
217	002506	协鑫集成	511,700	1,499,281.00	0.20
218	603927	中科软	38,827	1,497,169.12	0.20
219	603885	吉祥航空	97,020	1,497,018.60	0.20
220	002432	九安医疗	42,400	1,492,904.00	0.20
221	600580	卧龙电驱	102,000	1,490,220.00	0.19
222	600863	内蒙华电	358,300	1,486,945.00	0.19
223	688772	珠海冠宇	73,600	1,483,040.00	0.19
224	600970	中材国际	115,900	1,477,725.00	0.19
225	688385	复旦微电	29,379	1,471,887.90	0.19
226	600655	豫园股份	214,200	1,469,412.00	0.19
227	002092	中泰化学	227,600	1,468,020.00	0.19
228	300182	捷成股份	231,500	1,460,765.00	0.19
229	000878	云南铜业	131,800	1,456,390.00	0.19
230	002683	广东宏大	49,400	1,454,336.00	0.19
231	600820	隧道股份	240,900	1,447,809.00	0.19
232	300296	利亚德	221,700	1,447,701.00	0.19
233	300212	易华录	43,512	1,445,903.76	0.19
234	600909	华安证券	308,970	1,442,889.90	0.19
235	600528	中铁工业	146,033	1,442,806.04	0.19
236	002939	长城证券	176,800	1,437,384.00	0.19
237	002926	华西证券	172,500	1,433,475.00	0.19
238	600535	天士力	98,700	1,432,137.00	0.19
239	300748	金力永磁	47,200	1,412,224.00	0.18
240	300244	迪安诊断	54,900	1,407,087.00	0.18
241	603233	大参林	50,140	1,404,421.40	0.18
242	000893	亚钾国际	61,200	1,403,928.00	0.18
243	000547	航天发展	140,300	1,403,000.00	0.18
244	600329	达仁堂	31,200	1,400,568.00	0.18
245	000750	国海证券	416,740	1,396,079.00	0.18
246	600258	首旅酒店	73,484	1,392,521.80	0.18
247	603160	汇顶科技	30,100	1,392,125.00	0.18

248	600008	首创环保	483,250	1,391,760.00	0.18
249	000039	中集集团	201,530	1,388,541.70	0.18
250	002557	洽洽食品	33,300	1,383,615.00	0.18
251	600416	湘电股份	72,400	1,382,116.00	0.18
252	603156	养元饮品	55,400	1,368,380.00	0.18
253	000970	中科三环	106,665	1,367,445.30	0.18
254	002429	兆驰股份	248,500	1,366,750.00	0.18
255	000060	中金岭南	287,500	1,365,625.00	0.18
256	603456	九洲药业	49,400	1,352,572.00	0.18
257	601991	大唐发电	408,200	1,351,142.00	0.18
258	603893	瑞芯微	18,500	1,347,725.00	0.18
259	688200	华峰测控	8,800	1,346,400.00	0.18
260	000830	鲁西化工	126,300	1,333,728.00	0.17
261	603658	安图生物	25,700	1,329,461.00	0.17
262	600369	西南证券	363,800	1,327,870.00	0.17
263	600390	五矿资本	246,300	1,325,094.00	0.17
264	600435	北方导航	114,900	1,320,201.00	0.17
265	002508	老板电器	52,100	1,317,609.00	0.17
266	002500	山西证券	236,070	1,317,270.60	0.17
267	300558	贝达药业	27,400	1,316,022.00	0.17
268	600398	海澜之家	189,200	1,301,696.00	0.17
269	002128	电投能源	98,400	1,300,848.00	0.17
270	002936	郑州银行	562,563	1,293,894.90	0.17
271	601880	辽港股份	826,100	1,288,716.00	0.17
272	600038	中直股份	32,300	1,286,186.00	0.17
273	300009	安科生物	128,328	1,283,280.00	0.17
274	601717	郑煤机	102,576	1,277,071.20	0.17
275	300070	碧水源	238,100	1,276,216.00	0.17
276	002153	石基信息	89,846	1,257,844.00	0.16
277	600985	淮北矿业	108,852	1,253,975.04	0.16
278	600848	上海临港	104,900	1,253,555.00	0.16
279	300026	红日药业	230,000	1,246,600.00	0.16
280	603858	步长制药	60,500	1,245,695.00	0.16
281	000050	深天马 A	135,000	1,239,300.00	0.16
282	300529	健帆生物	53,100	1,230,858.00	0.16
283	601179	中国西电	225,455	1,219,711.55	0.16
284	002572	索菲亚	69,800	1,215,916.00	0.16
285	603127	昭衍新药	29,620	1,211,458.00	0.16
286	002244	滨江集团	136,900	1,207,458.00	0.16
287	300373	扬杰科技	29,700	1,204,929.00	0.16
288	688188	柏楚电子	6,340	1,195,470.40	0.16
289	688779	长远锂科	106,000	1,194,620.00	0.16
290	600673	东阳光	165,600	1,193,976.00	0.16

291	601456	国联证券	130,500	1,187,550.00	0.16
292	601958	金钼股份	106,500	1,187,475.00	0.16
293	002408	齐翔腾达	186,340	1,186,985.80	0.16
294	003035	南网能源	166,600	1,186,192.00	0.16
295	002266	浙富控股	286,800	1,184,484.00	0.15
296	600895	张江高科	85,000	1,183,200.00	0.15
297	600827	百联股份	88,100	1,177,897.00	0.15
298	002019	亿帆医药	80,600	1,176,760.00	0.15
299	603267	鸿远电子	18,000	1,175,400.00	0.15
300	600667	太极实业	161,200	1,170,312.00	0.15
301	000155	川能动力	81,200	1,169,280.00	0.15
302	600566	济川药业	40,200	1,167,408.00	0.15
303	600171	上海贝岭	63,600	1,160,700.00	0.15
304	002958	青农商行	426,400	1,159,808.00	0.15
305	688538	和辉光电	456,380	1,159,205.20	0.15
306	600208	新湖中宝	467,300	1,158,904.00	0.15
307	300357	我武生物	34,415	1,157,376.45	0.15
308	688116	天奈科技	25,200	1,152,900.00	0.15
309	600378	昊华科技	30,500	1,148,020.00	0.15
310	601666	平煤股份	152,200	1,147,588.00	0.15
311	601000	唐山港	324,220	1,144,496.60	0.15
312	000739	普洛药业	64,481	1,143,892.94	0.15
313	600282	南钢股份	338,100	1,139,397.00	0.15
314	000887	中鼎股份	86,900	1,137,521.00	0.15
315	002670	国盛金控	129,403	1,136,158.34	0.15
316	600755	厦门国贸	146,200	1,131,588.00	0.15
317	002155	湖南黄金	92,300	1,126,060.00	0.15
318	300115	长盈精密	94,240	1,122,398.40	0.15
319	300677	英科医疗	50,600	1,113,200.00	0.15
320	600959	江苏有线	328,501	1,110,333.38	0.15
321	600316	洪都航空	47,200	1,106,840.00	0.14
322	300888	稳健医疗	26,060	1,085,920.20	0.14
323	601231	环旭电子	72,300	1,081,608.00	0.14
324	600315	上海家化	37,226	1,079,926.26	0.14
325	600582	天地科技	185,000	1,078,550.00	0.14
326	002030	达安基因	108,108	1,077,836.76	0.14
327	601866	中远海发	434,746	1,073,822.62	0.14
328	002487	大金重工	34,800	1,073,232.00	0.14
329	603218	日月股份	56,500	1,072,935.00	0.14
330	600131	国网信通	53,000	1,070,070.00	0.14
331	000778	新兴铸管	262,200	1,069,776.00	0.14
332	000598	兴蓉环境	196,800	1,068,624.00	0.14
333	600517	国网英大	187,300	1,067,610.00	0.14

334	603026	胜华新材	18,000	1,066,500.00	0.14
335	600056	中国医药	82,140	1,066,177.20	0.14
336	300363	博腾股份	35,900	1,062,281.00	0.14
337	300251	光线传媒	130,500	1,055,745.00	0.14
338	000987	越秀资本	165,085	1,048,289.75	0.14
339	002221	东华能源	121,100	1,047,515.00	0.14
340	002249	大洋电机	182,800	1,041,960.00	0.14
341	600598	北大荒	78,100	1,041,073.00	0.14
342	688082	盛美上海	9,400	1,037,760.00	0.14
343	601106	中国一重	308,300	1,035,888.00	0.14
344	601005	重庆钢铁	735,400	1,029,560.00	0.13
345	000709	河钢股份	454,600	1,027,396.00	0.13
346	000027	深圳能源	155,780	1,026,590.20	0.13
347	002326	永太科技	67,100	1,025,959.00	0.13
348	600906	财达证券	142,000	1,022,400.00	0.13
349	002518	科士达	25,500	1,020,255.00	0.13
350	002183	怡亚通	199,511	1,017,506.10	0.13
351	002831	裕同科技	41,680	1,016,575.20	0.13
352	600718	东软集团	95,179	1,014,608.14	0.13
353	000883	湖北能源	220,700	1,006,392.00	0.13
354	601992	金隅集团	457,800	998,004.00	0.13
355	002511	中顺洁柔	89,457	997,445.55	0.13
356	002690	美亚光电	38,590	993,692.50	0.13
357	600373	中文传媒	74,100	987,012.00	0.13
358	601665	齐鲁银行	251,500	985,880.00	0.13
359	300776	帝尔激光	15,120	981,288.00	0.13
360	603568	伟明环保	55,919	979,141.69	0.13
361	000825	太钢不锈	251,600	973,692.00	0.13
362	601778	晶科科技	196,400	970,216.00	0.13
363	002985	北摩高科	21,965	969,095.80	0.13
364	603883	老百姓	32,382	966,602.70	0.13
365	600663	陆家嘴	97,500	962,325.00	0.13
366	600967	内蒙一机	94,900	958,490.00	0.13
367	601928	凤凰传媒	83,800	955,320.00	0.12
368	600297	广汇汽车	458,100	952,848.00	0.12
369	603228	景旺电子	36,943	947,587.95	0.12
370	600737	中粮糖业	117,457	945,528.85	0.12
371	603225	新凤鸣	83,820	926,211.00	0.12
372	600801	华新水泥	74,980	926,003.00	0.12
373	600155	华创云信	148,700	924,914.00	0.12
374	002791	坚朗五金	14,200	918,882.00	0.12
375	300861	美畅股份	21,100	915,107.00	0.12
376	601098	中南传媒	78,793	913,998.80	0.12

377	603529	爱玛科技	28,300	911,826.00	0.12
378	688281	华秦科技	4,500	911,250.00	0.12
379	300482	万孚生物	34,100	908,083.00	0.12
380	002745	木林森	98,600	907,120.00	0.12
381	688208	道通科技	29,900	906,269.00	0.12
382	002468	申通快递	83,700	905,634.00	0.12
383	600871	石化油服	457,100	905,058.00	0.12
384	688778	厦钨新能	18,240	902,880.00	0.12
385	001227	兰州银行	313,100	895,466.00	0.12
386	000012	南玻 A	149,902	893,415.92	0.12
387	002032	苏泊尔	17,800	890,000.00	0.12
388	603866	桃李面包	87,934	889,892.08	0.12
389	000156	华数传媒	101,300	881,310.00	0.12
390	600500	中化国际	157,020	873,031.20	0.11
391	000581	威孚高科	54,899	864,659.25	0.11
392	000401	冀东水泥	116,300	857,131.00	0.11
393	002867	周大生	48,150	856,107.00	0.11
394	301029	怡合达	19,080	852,494.40	0.11
395	688690	纳微科技	21,900	850,815.00	0.11
396	601611	中国核建	100,480	849,056.00	0.11
397	002250	联化科技	80,800	845,168.00	0.11
398	688276	百克生物	13,500	845,100.00	0.11
399	600556	天下秀	119,000	843,710.00	0.11
400	002010	传化智联	157,700	838,964.00	0.11
401	000785	居然之家	220,200	838,962.00	0.11
402	601118	海南橡胶	186,700	836,416.00	0.11
403	600022	山东钢铁	585,400	831,268.00	0.11
404	688029	南微医学	10,160	828,649.60	0.11
405	000930	中粮科技	101,600	822,960.00	0.11
406	688520	神州细胞	14,500	822,730.00	0.11
407	002423	中粮资本	102,400	819,200.00	0.11
408	300850	新强联	21,800	814,884.00	0.11
409	601598	中国外运	172,900	805,714.00	0.11
410	600259	广晟有色	22,157	800,753.98	0.10
411	601608	中信重工	190,100	800,321.00	0.10
412	600782	新钢股份	215,300	798,763.00	0.10
413	600062	华润双鹤	45,720	796,442.40	0.10
414	002505	鹏都农牧	421,000	795,690.00	0.10
415	688006	杭可科技	26,000	792,220.00	0.10
416	000559	万向钱潮	145,100	790,795.00	0.10
417	002081	金螳螂	174,500	786,995.00	0.10
418	600597	光明乳业	75,500	785,200.00	0.10
419	603826	坤彩科技	15,600	780,000.00	0.10

420	000089	深圳机场	112,000	778,400.00	0.10
421	300618	寒锐钴业	23,800	771,358.00	0.10
422	000958	电投产融	176,600	764,678.00	0.10
423	600707	彩虹股份	160,500	763,980.00	0.10
424	600339	中油工程	186,600	759,462.00	0.10
425	603638	艾迪精密	36,760	754,315.20	0.10
426	600901	江苏金租	182,600	754,138.00	0.10
427	601187	厦门银行	149,000	747,980.00	0.10
428	600095	湘财股份	95,300	743,340.00	0.10
429	000937	冀中能源	116,400	742,632.00	0.10
430	600409	三友化工	135,700	739,565.00	0.10
431	000537	广宇发展	62,800	732,876.00	0.10
432	000898	鞍钢股份	262,500	729,750.00	0.10
433	688052	纳芯微	4,600	728,502.00	0.10
434	600507	方大特钢	156,939	726,627.57	0.10
435	002761	浙江建投	47,800	725,604.00	0.09
436	601718	际华集团	241,144	716,197.68	0.09
437	603707	健友股份	53,031	715,918.50	0.09
438	688107	安路科技	12,900	714,531.00	0.09
439	000415	渤海租赁	339,100	712,110.00	0.09
440	001914	招商积余	46,800	704,340.00	0.09
441	600167	联美控股	100,890	703,203.30	0.09
442	000967	盈峰环境	139,100	702,455.00	0.09
443	600808	马钢股份	272,366	699,980.62	0.09
444	000563	陕国投 A	228,640	697,352.00	0.09
445	601568	北元集团	130,620	688,367.40	0.09
446	688234	天岳先进	9,300	687,642.00	0.09
447	600968	海油发展	221,900	681,233.00	0.09
448	601156	东航物流	52,100	677,300.00	0.09
449	002705	新宝股份	36,900	665,307.00	0.09
450	002925	盈趣科技	34,150	662,510.00	0.09
451	600195	中牧股份	56,247	656,964.96	0.09
452	300257	开山股份	43,300	656,861.00	0.09
453	600764	中国海防	24,100	656,002.00	0.09
454	603650	彤程新材	19,800	649,440.00	0.08
455	600126	杭钢股份	147,527	640,267.18	0.08
456	300442	润泽科技	20,800	639,808.00	0.08
457	603379	三美股份	26,720	628,187.20	0.08
458	002608	江苏国信	82,800	626,796.00	0.08
459	000959	首钢股份	178,700	625,450.00	0.08
460	000402	金融街	136,100	615,172.00	0.08
461	688185	康希诺	7,449	607,093.50	0.08
462	002653	海思科	25,500	601,800.00	0.08

463	601828	美凯龙	122,310	585,864.90	0.08
464	002110	三钢闽光	138,800	585,736.00	0.08
465	603786	科博达	8,700	571,590.00	0.07
466	001203	大中矿业	49,700	552,167.00	0.07
467	002563	森马服饰	88,000	547,360.00	0.07
468	688289	圣湘生物	32,387	545,397.08	0.07
469	601298	青岛港	77,600	540,872.00	0.07
470	688819	天能股份	14,665	540,258.60	0.07
471	601228	广州港	165,700	535,211.00	0.07
472	600377	宁沪高速	54,300	533,769.00	0.07
473	600928	西安银行	150,000	528,000.00	0.07
474	600927	永安期货	32,000	520,320.00	0.07
475	603056	德邦股份	33,700	519,654.00	0.07
476	600623	华谊集团	83,300	518,959.00	0.07
477	000031	大悦城	140,400	513,864.00	0.07
478	603317	天味食品	34,491	503,913.51	0.07
479	601869	长飞光纤	13,300	492,233.00	0.06
480	002399	海普瑞	42,620	488,851.40	0.06
481	601139	深圳燃气	66,150	482,233.50	0.06
482	601136	首创证券	33,100	469,027.00	0.06
483	600350	山东高速	73,400	467,558.00	0.06
484	000869	张裕 A	15,100	462,966.00	0.06
485	601969	海南矿业	66,700	438,886.00	0.06
486	001872	招商港口	25,400	438,658.00	0.06
487	000553	安道麦 A	50,400	425,376.00	0.06
488	600995	南网储能	38,400	422,784.00	0.06
489	002945	华林证券	29,500	403,560.00	0.05
490	688105	诺唯赞	13,000	396,370.00	0.05
491	601158	重庆水务	63,600	353,616.00	0.05
492	688248	南网科技	9,100	349,349.00	0.05
493	600299	安迪苏	43,800	349,086.00	0.05
494	603868	飞科电器	5,200	328,068.00	0.04
495	688295	中复神鹰	8,800	322,784.00	0.04
496	603355	莱克电气	12,480	317,116.80	0.04
497	600032	浙江新能	24,900	312,744.00	0.04
498	600956	新天绿能	33,900	295,608.00	0.04
499	300741	华宝股份	13,400	287,028.00	0.04
500	002901	大博医疗	6,300	195,804.00	0.03

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	000540	*ST 中天	327,600	36,036.00	0.00
2	301246	宏源药业	714	21,926.94	0.00

3	001287	中电港	951	19,990.02	0.00
4	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002463	沪电股份	3,065,103.00	0.52
2	000066	中国长城	2,804,006.00	0.47
3	600372	中航电子	2,791,261.54	0.47
4	000423	东阿阿胶	2,536,367.00	0.43
5	300308	中际旭创	2,331,891.00	0.39
6	000933	神火股份	2,305,125.00	0.39
7	002240	盛新锂能	2,297,059.00	0.39
8	002008	大族激光	2,272,012.00	0.38
9	603882	金域医学	2,199,553.86	0.37
10	300395	菲利华	2,106,173.00	0.36
11	002600	领益智造	1,975,271.00	0.33
12	688169	石头科技	1,932,516.41	0.33
13	688536	思瑞浦	1,923,574.83	0.33
14	300418	昆仑万维	1,919,754.00	0.32
15	688220	翱捷科技	1,842,821.03	0.31
16	300118	东方日升	1,754,551.00	0.30
17	688072	拓荆科技	1,727,478.22	0.29
18	300487	蓝晓科技	1,725,494.00	0.29
19	601966	玲珑轮胎	1,716,746.00	0.29
20	002432	九安医疗	1,680,491.00	0.28

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	603345	安井食品	3,427,296.00	0.58
2	688122	西部超导	3,264,318.68	0.55
3	000999	华润三九	3,242,168.12	0.55
4	603605	珀莱雅	3,213,045.44	0.54
5	601607	上海医药	2,863,433.00	0.48
6	002603	以岭药业	2,828,690.00	0.48
7	601699	潞安环能	2,571,165.00	0.43
8	603606	东方电缆	2,473,221.00	0.42
9	300168	万达信息	2,328,496.00	0.39
10	688063	派能科技	2,225,003.08	0.38

11	601872	招商轮船	2,111,636.00	0.36
12	603613	国联股份	1,997,612.50	0.34
13	600026	中远海能	1,771,556.00	0.30
14	002212	天融信	1,518,298.00	0.26
15	601333	广深铁路	1,370,675.00	0.23
16	300418	昆仑万维	1,309,542.00	0.22
17	600201	生物股份	1,265,550.10	0.21
18	002396	星网锐捷	1,252,882.00	0.21
19	600728	佳都科技	1,243,312.00	0.21
20	688088	虹软科技	1,116,899.85	0.19

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	205,641,276.68
卖出股票收入（成交）总额	126,372,843.42

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	158,028.56	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	158,028.56	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	118030	睿创转债	1,090	158,028.56	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金以套期保值为目的开展股指期货投资，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	2,433,305.34
2	应收清算款	1,902,049.46
3	应收股利	28,986.70
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	4,982.94
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	40,893.63
9	合计	4,485,834.31

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

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	000988	华工科技	387,702.00	0.05	转融通流通受限
2	600372	中航电子	367,356.00	0.05	转融通流通受限
3	300012	华测检测	360,750.00	0.05	转融通流通受限
4	002422	科伦药业	59,360.00	0.01	转融通流通受限

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	000540	*ST 中天	36,036.00	0.00	股票退市
2	301246	宏源药业	21,926.94	0.00	新股锁定
3	001287	中电港	19,990.02	0.00	新股锁定
4	001367	海森药业	2,171.40	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
750	163,181.49	119,731,107.00	97.83	2,655,014.00	2.17

8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
平安 500ETF 联接基金	93,817,399.00	76.66

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	22,430,219.00	18.33

	份有限公司—分红一个险分红		
2	广发证券股份有限公司	635,673.00	0.52
3	方正证券股份有限公司	615,049.00	0.50
4	招商证券股份有限公司	575,529.00	0.47
5	大杨集团有限责任公司	500,572.00	0.41
6	国泰君安证券股份有限公司	450,738.00	0.37
7	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—银保账户	237,800.00	0.19
8	黎旭晖	236,286.00	0.19
9	谷元明	180,000.00	0.15
10	华泰证券股份有限公司	167,559.00	0.14
11	平安银行股份有限公司—平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	93,817,399.00	76.66

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年3月23日） 基金份额总额	2,648,875,604.00
本报告期期初基金份额总额	97,986,121.00
本报告期基金总申购份额	34,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	9,600,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	122,386,121.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、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，本基金管理人及其相关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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受到稽查或处罚等情况。

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 (%)	
中信证券	3	143,849,956.01	43.47	103,760.87	43.47	-
天风证券	2	48,357,231.37	14.61	34,881.41	14.61	-

东吴证券	2	44,411,392.05	13.42	32,034.79	13.42	-
西南证券	1	40,166,215.03	12.14	28,972.42	12.14	-
光大证券	2	31,843,485.70	9.62	22,969.32	9.62	-
华泰证券	2	8,270,999.48	2.50	5,966.55	2.50	-
方正证券	2	4,800,431.71	1.45	3,462.51	1.45	-
开源证券	2	3,314,686.58	1.00	2,391.05	1.00	-
恒泰证券	2	2,898,614.47	0.88	2,119.67	0.89	-
东北证券	3	1,064,807.94	0.32	767.99	0.32	-
西部证券	1	1,027,434.29	0.31	741.10	0.31	-
中信建投 证券	2	381,364.90	0.12	275.06	0.12	-
国盛证券	1	202,669.80	0.06	146.20	0.06	-
华创证券	2	159,133.00	0.05	114.82	0.05	-
国信证券	2	105,349.70	0.03	75.95	0.03	-
东兴证券	2	35,789.00	0.01	25.81	0.01	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	退租
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	退租
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中国国际	1	-	-	-	-	-

金融股份有限公司						
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2 本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议。

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(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	5,000,000.00	5.32	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	16,500,000.00	17.55	-	-
恒泰证券	-	-	41,000,000.00	43.62	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
西部证	-	-	5,500,000.00	5.85	-	-

券						
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	26,000,000.00	27.66	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-

证券						
万联证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
英大证 券	-	-	-	-	-	-
中国国 际金融 股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中银国 际证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安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	2023 年 01 月 05 日
2	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 14 日
3	平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 19 日
4	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 20 日
5	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 31 日
6	平安基金管理有限公司关于旗下部分上交所上市基金变更扩位简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 31 日
7	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 03 日
8	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 22 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增万联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	2023 年 05 月 23 日
10	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增中国中金财富证券有限公司为申	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 23 日

	购赎回代办机构的公告		
11	平安基金管理有限公司关于旗下平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金调整停牌股票估值方法的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 06 月 10 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	2023/01/01--2023/04/25	22,430,219.00	0.00	0.00	22,430,219.00	18.33
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2023/01/01--2023/06/30	68,577,532.00	67,001,867.00	41,762,000.00	93,817,399.00	76.66

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

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

平安基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日