

平安中证 500 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2025 年 3 月 29 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21

§ 8 投资组合报告 .....	51
8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	52
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	65
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	67
8.12 投资组合报告附注 .....	67
§ 9 基金份额持有人信息 .....	68
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	68
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	68
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	69
9.4 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 .....	69
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	69
§ 10 开放式基金份额变动 .....	69
§ 11 重大事件揭示 .....	70
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
11.4 基金投资策略的改变 .....	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	70
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	70
11.8 其他重大事件 .....	73
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	74
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
§ 13 备查文件目录 .....	75
13.1 备查文件目录 .....	75
13.2 存放地点 .....	75
13.3 查阅方式 .....	75

§ 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	119,186,121.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易 所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 5 月 4 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波	潘琦
	联系电话	0755-88622632	0755-22168257
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	广东省深圳市罗湖区深南东路

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年	2022 年
本期已实现收益	-73,578,470.58	-36,009,779.91	-26,393,284.28
本期利润	22,545,193.71	-70,793,266.30	-215,641,580.20
加权平均基金份额本期利润	0.1522	-0.5288	-1.9042
本期加权平均净值利润率	2.80%	-8.70%	-29.71%
本期基金份额净值增长率	6.52%	-6.15%	-18.36%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
期末可供分配利润	-9,817,170.01	-72,283,990.82	4,264,119.82
期末可供	-0.0824	-0.3280	0.0435

分配基金份额利润			
期末基金资产净值	704,479,485.70	1,248,516,350.29	591,506,644.45
期末基金份额净值	5.9108	5.6651	6.0366
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末	2022 年末
基金份额累计净值增长率	10.73%	3.96%	10.78%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-0.36%	2.00%	-0.30%	2.03%	-0.06%	-0.03%
过去六个月	15.57%	1.97%	15.84%	2.01%	-0.27%	-0.04%
过去一年	6.52%	1.79%	5.46%	1.82%	1.06%	-0.03%
过去三年	-18.39%	1.39%	-22.20%	1.40%	3.81%	-0.01%
过去五年	22.49%	1.36%	8.70%	1.37%	13.79%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.73%	1.39%	-6.15%	1.41%	16.88%	-0.02%

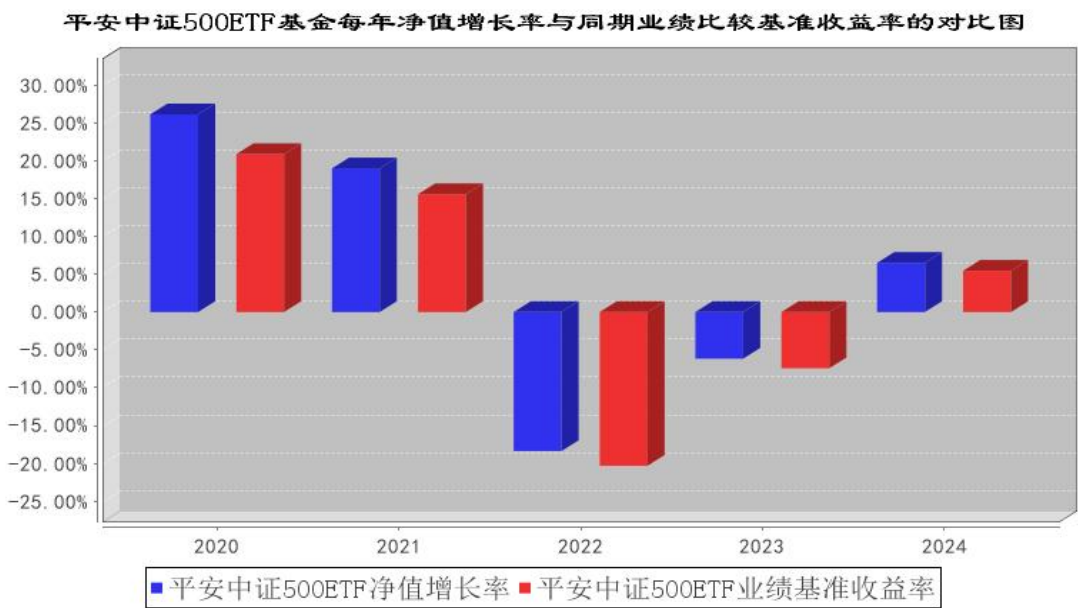
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金基金合同于 2018 年 03 月 23 日正式生效；

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

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于 2018 年 03 月 23 日正式生效。



3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分 红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总 额	年度利润分配合计	备注
2024 年	1.1000	15,926,473.31	-	15,926,473.31	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	1.1000	15,926,473.31	-	15,926,473.31	-

§ 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 2024 年 12 月 31 日，平安基金共管理 215 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6371 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 12 月 29 日	-	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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安MSCI中国A股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证2000增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证2000交易型开放式指数证券投资基金、平安中证A50交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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。
王 仁 增	平安中证500交易型开放式指数证券	2021年7月8日	2024年7月16日	10年	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

	投资基金 基金经理 助理				有限公司，曾担任 ETF 指数投资中心高级研究员、基金经理助理、基金经理。
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	2024 年 1 月 3 日	14 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，曾任 ETF 指数投资中心投资执行总经理、基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽

核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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 5.9108 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.52%，业绩比较基准收益率为 5.46%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

自 2024 年 9 月底货币财政“组合拳”以来，A 股市场的流动性出现了反转性的变化，市场交易思维也从存量博弈转向增量进取的节奏。展望 2025 年上半年，对于 A 股市场可以更加积极乐观一些。

从国内经济上看，25 年会是财政持续扩张的一年。当前处于经济体制转型的拐点，政策方向在于启动新一轮化债后改善地方财政支出结构、打通流动性拐点，支持稳楼市、促消费、修复居民资产负债表，持续推动经济良性循环。中央财政的持续发力程度将是市场交易的长期最重要变量。

从市场上看，由科技浪潮引领的投资主线行情有望贯穿全年，看好由主线带动整体市场价格中枢的上移，从而带来更好的赚钱效应。但是节奏上需要进行把握，25 年会存在现实与预期的碰撞，政策指引下的持续上行方向是明确的，但是市场的过热情绪、预期定价往往会与现实节奏出现偏离，从而引起市场的波动。在投资策略上更加注重核心卫星的方法，核心配置策略用来交易政策导向下的经济复苏预期，而卫星交易策略把握市场题材带来的市场波动。

作为指数投资管理人，我们继续坚持做好工具化产品运营，与投资者同行。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，由研究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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》等法律法规及本基金合同的规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70039114_H19 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的

	<p>财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	吴翠蓉	黄拥璇
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2025 年 3 月 24 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	13,727,103.33	16,827,613.08
结算备付金		6,348,464.41	4,362,891.75
存出保证金		92,033.28	2,277,142.70
交易性金融资产	7.4.7.2	684,144,641.43	1,226,696,084.28
其中：股票投资		684,144,641.43	1,226,696,084.28



基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,770,559.19	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	3,306.59	90,929.07
资产总计		706,086,108.23	1,250,254,660.88
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		960,465.62	1.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		310,109.14	576,131.00
应付托管费		62,021.83	115,226.23
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	7.4.7.9	274,025.94	1,046,951.49
负债合计		1,606,622.53	1,738,310.59
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	714,296,655.71	1,320,800,341.11
未分配利润	7.4.7.12	-9,817,170.01	-72,283,990.82
净资产合计		704,479,485.70	1,248,516,350.29
负债和净资产总计		706,086,108.23	1,250,254,660.88

注： 报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.9108 元，基金份额总额 119,186,121.00

份。

7.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		27,979,486.47	-65,314,010.68
1. 利息收入		219,222.61	1,527,420.98
其中：存款利息收入	7.4.7.13	219,222.61	173,987.96
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		-	37,168.57
其他利息收入		-	1,316,264.45
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-69,299,457.50	-33,774,560.49
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-85,991,790.26	-44,445,213.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	-	54,210.99
资产支持证券投 资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-210,438.15	-1,113,744.43
股利收益	7.4.7.19	15,648,972.29	11,730,186.25
其他投资收益		1,253,798.62	-
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填列）	7.4.7.20	96,123,664.29	-34,783,486.39
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	936,057.07	1,716,615.22
减：二、营业总支出		5,434,292.76	5,479,255.62
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	4,043,562.14	4,031,252.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	808,712.42	806,250.58
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		862. 96	1, 385. 68
8. 其他费用	7. 4. 7. 23	581, 155. 24	640, 366. 64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22, 545, 193. 71	-70, 793, 266. 30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22, 545, 193. 71	-70, 793, 266. 30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22, 545, 193. 71	-70, 793, 266. 30

7.3 净资产变动表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	1, 320, 800, 341. 11	-	-72, 283, 990. 82	1, 248, 516, 350. 29
二、本期期初净资产	1, 320, 800, 341. 11	-	-72, 283, 990. 82	1, 248, 516, 350. 29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-606, 503, 685. 40	-	62, 466, 820. 81	-544, 036, 864. 59
（一）、综合收益总额	-	-	22, 545, 193. 71	22, 545, 193. 71
（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）	-606, 503, 685. 40	-	55, 848, 100. 41	-550, 655, 584. 99
其中：1. 基金申购款	143, 834, 866. 00	-	-13, 496, 840. 56	130, 338, 025. 44
2. 基金赎回款	-750, 338, 551. 40	-	69, 344, 940. 97	-680, 993, 610. 43
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净	-	-	-15, 926, 473. 31	-15, 926, 473. 31

资产变动（净资产减少以“-”号填列）				
四、本期期末净资产	714,296,655.71	-	-9,817,170.01	704,479,485.70
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	587,242,524.63	-	4,264,119.82	591,506,644.45
二、本期期初净资产	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）	733,557,816.48	-	-76,548,110.64	657,009,705.84
（一）、综合收益总额	-	-	-70,793,266.30	-70,793,266.30
（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）	733,557,816.48	-	-5,754,844.34	727,802,972.14
其中：1. 基金申购款	1,078,761,495.42	-	-11,566,714.05	1,067,194,781.37
2. 基金赎回款	-345,203,678.94	-	5,811,869.71	-339,391,809.23
（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	1,320,800,341.11	-	-72,283,990.82	1,248,516,350.29

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风  
基金管理人负责人

林婉文  
主管会计工作负责人

张南南  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

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

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》，平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等）、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以在履行适当程序后，参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。

本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

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

##### 7.4.4.2 记账本位币

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

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### （1）金融资产分类

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

###### （2）金融负债分类

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

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资



产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用直接计入投资收益。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产为债务工具投资的，在持有期

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配；基金管理人根据基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法参见招募说明书；

（2）本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

（3）本基金的收益分配采取现金分红的方式；

（4）《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（5）每一基金份额享有同等分配权；

（6）法律法规或监管机关另有规定的，从其规定；

（7）在对持有人利益无实质性不利的影响下，基金管理人、登记结算机构可对基金收益分配原则进行调整，并及时公告。

#### 7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；

(2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

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

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要说明的重要会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

##### (2) 增值税及附加

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	13,727,103.33	16,827,613.08
等于：本金	13,723,091.25	16,822,172.53
加：应计利息	4,012.08	5,440.55
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	13,727,103.33	16,827,613.08

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		682,204,799.30	-	684,144,641.43	1,939,842.13
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		682,204,799.30	-	684,144,641.43	1,939,842.13
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,320,780,946.44	-	1,226,696,084.28	-94,084,862.16
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		1,320,780,946.44	-	1,226,696,084.28	-94,084,862.16

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	—	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	—	—	—	
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	
货币衍生工具	—	—	—	
权益衍生工具	13,094,000.00	—	—	
其	13,094,000.00	—	—	

中：股指期货投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,094,000.00	-	-	-

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

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

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。
----

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	90,929.07
待摊费用	-	-
现金差额	3,306.59	-
合计	3,306.59	90,929.07

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	53,914.11	775,300.75
其中：交易所市场	53,914.11	775,300.75
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	125,836.45	271,650.74
应退退补款	94,275.38	-
合计	274,025.94	1,046,951.49

注：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。

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	220,386,121.00	1,320,800,341.11
本期申购	24,000,000.00	143,834,866.00
本期赎回（以“-”号填列）	-125,200,000.00	-750,338,551.40
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	119,186,121.00	714,296,655.71

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。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末无其他综合收益。

7.4.7.12 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	269,660,117.42	-341,944,108.24	-72,283,990.82
本期期初	269,660,117.42	-341,944,108.24	-72,283,990.82
本期利润	-73,578,470.58	96,123,664.29	22,545,193.71
本期基金份额交易产生的变动数	-96,440,400.25	152,288,500.66	55,848,100.41
其中：基金申购款	18,782,716.80	-32,279,557.36	-13,496,840.56
基金赎回款	-115,223,117.05	184,568,058.02	69,344,940.97
本期已分配利润	-15,926,473.31	-	-15,926,473.31
本期末	83,714,773.28	-93,531,943.29	-9,817,170.01

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
活期存款利息收入	129,311.57	127,653.68
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	84,319.83	44,749.22
其他	5,591.21	1,585.06
合计	219,222.61	173,987.96

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-60,272,202.86	-37,891,510.44
股票投资收益——赎回	-25,719,587.40	-6,553,702.86

差价收入		
股票投资收益——申购 差价收入	-	-
股票投资收益——证券 出借差价收入	-	-
合计	-85,991,790.26	-44,445,213.30

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	580,243,970.10	516,639,013.00
减：卖出股票成本总额	639,697,980.64	553,083,285.49
减：交易费用	818,192.32	1,447,237.95
买卖股票差价收入	-60,272,202.86	-37,891,510.44

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	680,993,610.43	339,391,809.23
减：现金支付赎回款总额	358,949,195.43	176,867,498.23
减：赎回股票成本总额	347,764,002.40	169,078,013.86
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-25,719,587.40	-6,553,702.86

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益——证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
债券投资收益——利息收入	-	140.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	54,070.95
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	-	54,210.99

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	163,221.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	109,000.00
减：应计利息总额	-	144.06
减：交易费用	-	6.54
买卖债券差价收入	-	54,070.95

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-210,438.15	-1,113,744.43

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	15,648,972.29	11,730,186.25
其中：证券出借权益补偿收入	964,797.23	783,281.25
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	15,648,972.29	11,730,186.25

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
------	---	--

1. 交易性金融资产	96,024,704.29	-35,082,366.39
股票投资	96,024,704.29	-35,082,366.39
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	98,960.00	298,880.00
权证投资	-	-
期货投资	98,960.00	298,880.00
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	96,123,664.29	-34,783,486.39

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	936,057.07	1,716,615.22
合计	936,057.07	1,716,615.22

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。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	48,000.00	78,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	242,613.67	241,875.16
其他	170,541.57	200,491.48
合计	581,155.24	640,366.64

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
方正证券	-	-	5,102,508.71	0.36

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

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

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
方正证券	3,684.81	0.36	-	-

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

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,043,562.14	4,031,252.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,201.71	12,255.78
应支付基金管理人的净管理费	4,011,360.43	4,018,996.94

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	808,712.42	806,250.58

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

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	-	-

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
--



关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日						
关联方名称	交易金额	费率区间（%）	加权平均费率（%）	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	790,707.00	1.00~3.00	1.51	464.26	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	328,545.00	0.2757	1,082,868.00	0.4914
平安 500ETF 联接基金	88,750,799.00	74.4640	191,187,899.00	86.7513
平安人寿	22,668,019.00	19.0190	22,668,019.00	10.2856

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	13,727,103.33	129,311.57	16,827,613.08	127,653.68

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益 登记日	除息日		每 10 份 基金份 额分红 数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发 放 总 额	本期利润分配 合计	备注
		场内	场外					
1	2024 年 06 月 21 日	2024 年 6 月 24 日	-	1.1000	15,926,473.31	-	15,926,473.31	-
合计	-	-	-	1.1000	15,926,473.31	-	15,926,473.31	-

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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
301552	科力装 备	2024 年 7 月 15 日	6 个月	新股锁 定	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301556	托普云 农	2024 年 10 月 10 日	6 个月	新股锁 定	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301571	国科天 成	2024 年 8 月 14 日	6 个月	新股锁 定	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301603	乔锋智 能	2024 年 7 月 3 日	6 个月	新股锁 定	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-
301606	绿联科 技	2024 年 7 月 17 日	6 个月	新股锁 定	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-
301608	博实结	2024 年 7 月 25 日	6 个月	新股锁 定	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301611	珂玛科	2024 年	6 个月	新股锁	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-

	技	8月7日		定						
603207	小方制药	2024年8月19日	6个月	新股锁定	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股锁定	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603310	巍华新材	2024年8月7日	6个月	新股锁定	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-
603391	力聚热能	2024年7月24日	6个月	新股锁定	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
688721	龙图光罩	2024年7月30日	6个月	新股锁定	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
688726	拉普拉斯	2024年10月22日	6个月	新股锁定	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
400174	中天3	2023年08月30日	重大事项停牌	0.11	-	-	327,600	791,939.16	36,036.00	-

注：截止 2024 年 12 月 31 日，本基金合计持有中天 3（在深圳证券交易所退市时的股票简称为\*ST 中天，证券代码为 000540）327,600 股。根据中天金融集团股份有限公司（以下简称“公司”）于 2023 年 6 月 29 日发布的《中天金融集团股份有限公司关于股票终止上市暨摘牌的公告》，深圳证券交易所宣布，自 2023 年 6 月 30 日上午 9 时起，该公司股份的上市地位将按照除牌程序予以取消。根据公司于 2023 年 8 月 28 日发布的《中天金融集团股份有限公司股票转让公告》，公司可在全国中小企业股份转让系统有限责任公司依托原证券公司代办股份转让系统设立并代为管理的两网公司及退市公司板块（以下简称“退市板块”）转让仅限于原在深圳证券交易所（以下简称“深交所”）挂牌交易的流通股份。开始转让日为 2023 年 8 月 30 日。根据公司于同日发布的《中天金融集团股份有限公司关于公司股票挂牌当日即暂停转让的公告》，因公司正在进行重整事项，经向

全国股转公司申请，公司股票自 2023 年 8 月 30 日起暂停转让。为维护基金持有人利益，根据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、中国证券业协会基金估值工作小组《关于停牌股票估值的参考方法》的规定，依据中天金融集团股份有限公司公开披露的信息，平安基金管理有限公司与基金托管人协商一致，将本基金所持有\*ST 中天(000540.SZ)按每股 0.11 元人民币估值。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易

所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。本基金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）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：同）。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	13,727,103.33	-	-	-	13,727,103.33
结算备付金	6,348,464.41	-	-	-	6,348,464.41
存出保证金	92,033.28	-	-	-	92,033.28
交易性金融资产	-	-	-	684,144,641.43	684,144,641.43
应收清算款	-	-	-	1,770,559.19	1,770,559.19
其他资产	-	-	-	3,306.59	3,306.59
资产总计	20,167,601.02	-	-	685,918,507.21	706,086,108.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	310,109.14	310,109.14
应付托管费	-	-	-	62,021.83	62,021.83
应付清算款	-	-	-	960,465.62	960,465.62
其他负债	-	-	-	274,025.94	274,025.94
负债总计	-	-	-	1,606,622.53	1,606,622.53
利率敏感度缺口	20,167,601.02	-	-	684,311,884.68	704,479,485.70
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	16,827,613.08	-	-	-	16,827,613.08
结算备付金	4,362,891.75	-	-	-	4,362,891.75
存出保证金	327,886.70	-	-	1,949,256.00	2,277,142.70
交易性金融资产	-	-	-	1,226,696,084.28	1,226,696,084.28
其他资产	-	-	-	90,929.07	90,929.07
资产总计	21,518,391.53	-	-	1,228,736,269.35	1,250,254,660.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	576,131.00	576,131.00
应付托管费	-	-	-	115,226.23	115,226.23
应付清算款	-	-	-	1.87	1.87
其他负债	-	-	-	1,046,951.49	1,046,951.49
负债总计	-	-	-	1,738,310.59	1,738,310.59
利率敏感度缺口	21,518,391.53	-	-	1,226,997,958.76	1,248,516,350.29

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基

金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023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	684,144,641.43	97.11	1,226,696,084.28	98.25
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	684,144,641.43	97.11	1,226,696,084.28	98.25

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
	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（2024 年 12 月 31 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升	41,636,160.40	51,795,483.09



	5%		
	沪深 300 指数下降	-41,636,160.40	-51,795,483.09
	5%		

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	683,920,448.32	1,226,451,602.53
第二层次	-	-
第三层次	224,193.11	244,481.75
合计	684,144,641.43	1,226,696,084.28

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	0.00	244,481.75	244,481.75
当期购买	0.00	78,935.70	78,935.70
当期出售/结算	0.00	0.00	0.00
转入第三层次	0.00	0.00	0.00
转出第三层次	0.00	208,445.75	208,445.75
当期利得或损失总额	0.00	109,221.41	109,221.41
其中：计入损益的利得或损失	0.00	109,221.41	109,221.41
计入其他综合收益的利得或损失	0.00	0.00	0.00
期末余额	0.00	224,193.11	224,193.11
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	0.00	109,221.41	109,221.41
项目	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,081,822.20	1,081,822.20
当期购买	-	136,996.06	136,996.06
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	131,040.00	131,040.00
转出第三层次	-	1,081,822.20	1,081,822.20
当期利得或损失总额	-	-23,554.31	-23,554.31
其中：计入损益的利得或损失	-	-23,554.31	-23,554.31
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	244,481.75	244,481.75
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-23,554.31	-23,554.31

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	188,157.11	亚式期权模型	预期波动率	0.2665-4.2559	负相关
退市股票	36,036.00	收益法	未来现金流	0.11	正相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	208,445.75	亚式期权模型	预期波动率	0.5141-2.1988	负相关
退市股票	36,036.00	收益法	未来现金流	0.11	正相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。
------------------------------------

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	684,144,641.43	96.89
	其中：股票	684,144,641.43	96.89
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	20,075,567.74	2.84
8	其他各项资产	1,865,899.06	0.26
9	合计	706,086,108.23	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,017,002.00	0.57
B	采矿业	23,749,494.50	3.37
C	制造业	429,108,435.00	60.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,880,922.39	3.11
E	建筑业	6,147,712.20	0.87
F	批发和零售业	16,619,854.66	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	9,391,848.26	1.33
H	住宿和餐饮业	2,205,508.28	0.31
I	信息传输、软件和信息技术服务业	61,416,421.38	8.72
J	金融业	72,489,249.47	10.29
K	房地产业	7,721,078.00	1.10
L	租赁和商务服务业	6,080,984.48	0.86
M	科学研究和技术服务业	4,861,608.00	0.69
N	水利、环境和公共设施管理业	3,367,762.97	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,043,010.80	0.57
R	文化、体育和娱乐业	9,105,631.93	1.29
S	综合	1,686,726.00	0.24
	合计	683,893,250.32	97.08

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	186,883.76	0.03
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	15,766.35	0.00
J	金融业	12,705.00	0.00
K	房地产业	36,036.00	0.01
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	251,391.11	0.04

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002625	光启技术	151,200	7,227,360.00	1.03
2	600418	江淮汽车	175,200	6,570,000.00	0.93
3	000988	华工科技	100,825	4,365,722.50	0.62
4	002384	东山精密	136,800	3,994,560.00	0.57
5	300339	润和软件	79,800	3,992,394.00	0.57
6	600839	四川长虹	370,400	3,574,360.00	0.51
7	002797	第一创业	421,200	3,517,020.00	0.50
8	600487	亨通光电	197,900	3,407,838.00	0.48
9	301236	软通动力	57,300	3,364,083.00	0.48
10	002340	格林美	514,500	3,359,685.00	0.48

11	300207	欣旺达	148,000	3,301,880.00	0.47
12	688777	中控技术	63,472	3,152,654.24	0.45
13	002156	通富微电	106,404	3,144,238.20	0.45
14	601162	天风证券	694,500	3,111,360.00	0.44
15	601555	东吴证券	398,840	3,110,952.00	0.44
16	002273	水晶光电	139,409	3,097,667.98	0.44
17	002966	苏州银行	377,080	3,058,118.80	0.43
18	002185	华天科技	257,100	2,984,931.00	0.42
19	601099	太平洋	683,400	2,911,284.00	0.41
20	601933	永辉超市	454,500	2,881,530.00	0.41
21	600096	云天化	128,700	2,870,010.00	0.41
22	002202	金风科技	276,700	2,858,311.00	0.41
23	000423	东阿阿胶	45,200	2,834,944.00	0.40
24	000066	中国长城	194,100	2,828,037.00	0.40
25	600536	中国软件	59,598	2,782,630.62	0.39
26	600352	浙江龙盛	261,200	2,687,748.00	0.38
27	601168	西部矿业	167,100	2,685,297.00	0.38
28	600079	人福医药	114,400	2,674,672.00	0.38
29	601108	财通证券	325,900	2,662,603.00	0.38
30	600885	宏发股份	82,652	2,629,986.64	0.37
31	600988	赤峰黄金	166,800	2,603,748.00	0.37
32	300017	网宿科技	244,700	2,586,479.00	0.37
33	002738	中矿资源	72,440	2,571,620.00	0.37
34	300476	胜宏科技	60,500	2,546,445.00	0.36
35	002138	顺络电子	80,803	2,543,678.44	0.36
36	601577	长沙银行	279,200	2,482,088.00	0.35
37	300136	信维通信	97,100	2,470,224.00	0.35
38	002078	太阳纸业	166,100	2,469,907.00	0.35
39	002281	光迅科技	47,200	2,462,424.00	0.35
40	300474	景嘉微	26,150	2,444,763.50	0.35
41	002085	万丰奥威	126,300	2,393,385.00	0.34
42	689009	九号公司	50,245	2,386,637.50	0.34
43	002517	恺英网络	172,800	2,351,808.00	0.33
44	300803	指南针	24,500	2,350,775.00	0.33
45	600879	航天电子	261,600	2,343,936.00	0.33
46	300058	蓝色光标	250,766	2,327,108.48	0.33
47	002444	巨星科技	71,600	2,316,260.00	0.33
48	688120	华海清科	14,182	2,311,524.18	0.33
49	603893	瑞芯微	21,000	2,311,260.00	0.33
50	300223	北京君正	33,800	2,305,160.00	0.33
51	601615	明阳智能	182,400	2,300,064.00	0.33
52	688099	晶晨股份	33,436	2,296,384.48	0.33
53	601128	常熟银行	298,880	2,262,521.60	0.32

54	300002	神州泰岳	194,500	2,254,255.00	0.32
55	002353	杰瑞股份	60,884	2,252,099.16	0.32
56	600109	国金证券	257,600	2,248,848.00	0.32
57	000783	长江证券	329,000	2,243,780.00	0.32
58	002195	岩山科技	563,208	2,235,935.76	0.32
59	300024	机器人	124,200	2,229,390.00	0.32
60	603160	汇顶科技	27,600	2,222,904.00	0.32
61	300496	中科创达	37,000	2,203,720.00	0.31
62	000728	国元证券	262,800	2,197,008.00	0.31
63	688617	惠泰医疗	5,865	2,183,715.45	0.31
64	002532	天山铝业	276,800	2,178,416.00	0.31
65	002128	电投能源	111,100	2,175,338.00	0.31
66	002223	鱼跃医疗	59,598	2,174,731.02	0.31
67	600298	安琪酵母	60,300	2,173,815.00	0.31
68	688213	思特威	27,927	2,170,486.44	0.31
69	002673	西部证券	265,800	2,166,270.00	0.31
70	002465	海格通信	196,800	2,160,864.00	0.31
71	603606	东方电缆	41,000	2,154,550.00	0.31
72	688469	芯联集成	419,900	2,154,087.00	0.31
73	601567	三星医疗	70,000	2,153,200.00	0.31
74	688072	拓荆科技	13,900	2,136,013.00	0.30
75	600765	中航重机	103,960	2,128,061.20	0.30
76	688047	龙芯中科	16,000	2,116,480.00	0.30
77	601198	东兴证券	192,200	2,116,122.00	0.30
78	300114	中航电测	29,300	2,103,154.00	0.30
79	600862	中航高科	82,800	2,091,528.00	0.30
80	002008	大族激光	83,400	2,085,000.00	0.30
81	600895	张江高科	77,600	2,079,680.00	0.30
82	300383	光环新网	142,500	2,079,075.00	0.30
83	300012	华测检测	166,800	2,073,324.00	0.29
84	000831	中国稀土	73,600	2,064,480.00	0.29
85	301358	湖南裕能	45,500	2,062,060.00	0.29
86	300866	安克创新	21,060	2,056,298.40	0.29
87	002472	双环传动	67,100	2,054,602.00	0.29
88	600177	雅戈尔	229,100	2,038,990.00	0.29
89	601233	桐昆股份	169,500	2,000,100.00	0.28
90	300699	光威复材	57,676	1,998,473.40	0.28
91	002595	豪迈科技	39,700	1,992,543.00	0.28
92	603605	珀莱雅	23,500	1,990,450.00	0.28
93	600873	梅花生物	197,900	1,984,937.00	0.28
94	300054	鼎龙股份	75,300	1,959,306.00	0.28
95	300037	新宙邦	52,220	1,955,116.80	0.28
96	000400	许继电气	70,790	1,948,848.70	0.28

97	300395	菲利华	51,700	1,944,437.00	0.28
98	688122	西部超导	45,192	1,935,121.44	0.27
99	300604	长川科技	43,600	1,924,068.00	0.27
100	300142	沃森生物	158,600	1,915,888.00	0.27
101	601990	南京证券	219,300	1,899,138.00	0.27
102	000750	国海证券	443,140	1,896,639.20	0.27
103	603596	伯特利	42,220	1,882,589.80	0.27
104	688525	佰维存储	30,209	1,872,051.73	0.27
105	000009	中国宝安	204,578	1,871,888.70	0.27
106	601696	中银证券	167,500	1,869,300.00	0.27
107	002436	兴森科技	167,400	1,859,814.00	0.26
108	688249	晶合集成	79,500	1,855,530.00	0.26
109	002850	科达利	18,900	1,846,152.00	0.26
110	600369	西南证券	395,300	1,846,051.00	0.26
111	600153	建发股份	175,300	1,844,156.00	0.26
112	600549	厦门钨业	95,600	1,842,212.00	0.26
113	600642	申能股份	194,001	1,841,069.49	0.26
114	002261	拓维信息	99,700	1,825,507.00	0.26
115	688521	芯原股份	34,600	1,814,078.00	0.26
116	600143	金发科技	209,100	1,806,624.00	0.26
117	002821	凯莱英	23,600	1,795,724.00	0.25
118	600398	海澜之家	238,100	1,785,750.00	0.25
119	000021	深科技	92,900	1,770,674.00	0.25
120	601216	君正集团	334,700	1,760,522.00	0.25
121	300724	捷佳伟创	27,600	1,744,596.00	0.25
122	601997	贵阳银行	289,900	1,739,400.00	0.25
123	000738	航发控制	78,200	1,739,168.00	0.25
124	000932	华菱钢铁	410,920	1,717,645.60	0.24
125	002294	信立泰	55,200	1,707,336.00	0.24
126	002558	巨人网络	134,200	1,702,998.00	0.24
127	600529	山东药玻	65,800	1,695,666.00	0.24
128	000878	云南铜业	139,000	1,694,410.00	0.24
129	600909	华安证券	279,370	1,692,982.20	0.24
130	600497	驰宏锌锗	302,900	1,687,153.00	0.24
131	600673	东阳光	149,400	1,686,726.00	0.24
132	000729	燕京啤酒	139,700	1,681,988.00	0.24
133	688361	中科飞测	19,200	1,680,960.00	0.24
134	600141	兴发集团	77,360	1,678,712.00	0.24
135	300919	中伟股份	46,400	1,675,968.00	0.24
136	688002	睿创微纳	35,406	1,664,436.06	0.24
137	000997	新大陆	83,100	1,657,845.00	0.24
138	603345	安井食品	20,300	1,654,044.00	0.23
139	002409	雅克科技	28,300	1,639,985.00	0.23



140	000623	吉林敖东	94,900	1,638,923.00	0.23
141	600155	华创云信	220,600	1,632,440.00	0.23
142	603338	浙江鼎力	25,276	1,630,807.52	0.23
143	000034	神州数码	46,400	1,626,320.00	0.23
144	300001	特锐德	73,975	1,623,751.25	0.23
145	000733	振华科技	38,500	1,623,545.00	0.23
146	300073	当升科技	40,200	1,619,256.00	0.23
147	002065	东华软件	222,300	1,613,898.00	0.23
148	002064	华峰化学	196,700	1,609,006.00	0.23
149	601665	齐鲁银行	287,500	1,607,125.00	0.23
150	600563	法拉电子	13,490	1,604,230.80	0.23
151	601456	国联民生	118,400	1,600,768.00	0.23
152	600118	中国卫星	58,600	1,599,780.00	0.23
153	688188	柏楚电子	8,216	1,595,958.00	0.23
154	002318	久立特材	67,900	1,589,539.00	0.23
155	002432	九安医疗	38,900	1,586,342.00	0.23
156	603087	甘李药业	35,800	1,578,780.00	0.22
157	002739	万达电影	129,700	1,574,558.00	0.22
158	600820	隧道股份	218,300	1,569,577.00	0.22
159	600060	海信视像	78,500	1,565,290.00	0.22
160	600704	物产中大	308,950	1,563,287.00	0.22
161	600521	华海药业	87,200	1,558,264.00	0.22
162	600580	卧龙电驱	90,400	1,553,976.00	0.22
163	600637	东方明珠	199,900	1,551,224.00	0.22
164	600312	平高电气	80,700	1,549,440.00	0.22
165	601179	中国西电	203,255	1,542,705.45	0.22
166	002410	广联达	131,100	1,541,736.00	0.22
167	600699	均胜电子	97,780	1,532,212.60	0.22
168	002841	视源股份	41,500	1,531,765.00	0.22
169	600132	重庆啤酒	24,000	1,512,480.00	0.21
170	002984	森麒麟	61,200	1,509,192.00	0.21
171	002385	大北农	342,800	1,484,324.00	0.21
172	300003	乐普医疗	130,600	1,481,004.00	0.21
173	601666	平煤股份	147,200	1,474,944.00	0.21
174	002262	恩华药业	60,500	1,473,175.00	0.21
175	300751	迈为股份	14,000	1,472,100.00	0.21
176	300763	锦浪科技	24,000	1,465,680.00	0.21
177	603568	伟明环保	67,619	1,462,598.97	0.21
178	000683	远兴能源	261,200	1,460,108.00	0.21
179	002568	百润股份	51,980	1,455,959.80	0.21
180	600392	盛和资源	141,510	1,454,722.80	0.21
181	688180	君实生物	53,147	1,452,507.51	0.21
182	603939	益丰药房	60,108	1,450,406.04	0.21

183	300144	宋城演艺	156,100	1,450,169.00	0.21
184	603179	新泉股份	33,800	1,443,260.00	0.20
185	600390	五矿资本	222,900	1,437,705.00	0.20
186	002152	广电运通	123,100	1,435,346.00	0.20
187	600008	首创环保	436,550	1,431,884.00	0.20
188	603129	春风动力	9,100	1,429,337.00	0.20
189	002044	美年健康	310,300	1,424,277.00	0.20
190	000039	中集集团	182,630	1,419,035.10	0.20
191	300529	健帆生物	48,300	1,417,122.00	0.20
192	002407	多氟多	118,040	1,416,480.00	0.20
193	601717	郑煤机	108,376	1,406,720.48	0.20
194	600486	扬农化工	24,307	1,406,646.09	0.20
195	300373	扬杰科技	32,300	1,405,696.00	0.20
196	000513	丽珠集团	36,886	1,401,668.00	0.20
197	603589	口子窖	35,700	1,400,868.00	0.20
198	600863	内蒙华电	323,500	1,400,755.00	0.20
199	002624	完美世界	134,550	1,389,901.50	0.20
200	601000	唐山港	293,720	1,383,421.20	0.20
201	600763	通策医疗	31,037	1,378,042.80	0.20
202	000960	锡业股份	98,000	1,374,940.00	0.20
203	300251	光线传媒	145,400	1,372,576.00	0.19
204	600498	烽火通信	70,480	1,371,540.80	0.19
205	600316	洪都航空	42,700	1,371,524.00	0.19
206	000426	兴业银锡	123,300	1,371,096.00	0.19
207	000703	恒逸石化	218,100	1,369,668.00	0.19
208	600872	中炬高新	62,100	1,367,442.00	0.19
209	600816	建元信托	390,400	1,366,400.00	0.19
210	300558	贝达药业	25,300	1,364,429.00	0.19
211	000723	美锦能源	302,200	1,362,922.00	0.19
212	603979	金诚信	37,200	1,350,360.00	0.19
213	600516	方大炭素	279,440	1,349,695.20	0.19
214	688578	艾力斯	22,500	1,347,750.00	0.19
215	300285	国瓷材料	78,996	1,346,091.84	0.19
216	603816	顾家家居	48,700	1,343,146.00	0.19
217	002500	山西证券	213,570	1,341,219.60	0.19
218	002958	青农商行	440,600	1,339,424.00	0.19
219	002025	航天电器	27,500	1,335,400.00	0.19
220	300390	天华新能	57,620	1,328,141.00	0.19
221	000830	鲁西化工	113,600	1,327,984.00	0.19
222	000629	钒钛股份	460,600	1,326,528.00	0.19
223	002603	以岭药业	82,800	1,325,628.00	0.19
224	002155	湖南黄金	84,000	1,321,320.00	0.19
225	605358	立昂微	53,200	1,317,764.00	0.19

226	000636	风华高科	91,814	1,317,530.90	0.19
227	601966	玲珑轮胎	72,900	1,315,116.00	0.19
228	000921	海信家电	45,500	1,314,950.00	0.19
229	002939	长城证券	160,100	1,312,820.00	0.19
230	688052	纳芯微	10,000	1,303,000.00	0.18
231	000893	亚钾国际	64,500	1,300,320.00	0.18
232	002926	华西证券	156,200	1,298,022.00	0.18
233	002429	兆驰股份	224,300	1,296,454.00	0.18
234	000591	太阳能	271,600	1,292,816.00	0.18
235	600535	天士力	88,900	1,285,494.00	0.18
236	600511	国药股份	37,500	1,283,250.00	0.18
237	600021	上海电力	139,600	1,280,132.00	0.18
238	600998	九州通	250,001	1,280,005.12	0.18
239	002203	海亮股份	118,907	1,278,250.25	0.18
240	600348	华阳股份	178,850	1,268,046.50	0.18
241	002414	高德红外	169,300	1,257,899.00	0.18
242	600325	华发股份	218,300	1,257,408.00	0.18
243	600380	健康元	111,472	1,256,289.44	0.18
244	600038	中直股份	32,500	1,253,200.00	0.18
245	603927	中科软	57,678	1,251,612.60	0.18
246	600970	中材国际	131,000	1,241,880.00	0.18
247	300146	汤臣倍健	103,000	1,241,150.00	0.18
248	600655	豫园股份	192,900	1,240,347.00	0.18
249	600754	锦江酒店	45,800	1,230,188.00	0.17
250	688385	复旦微电	32,012	1,228,940.68	0.17
251	600583	海油工程	224,400	1,227,468.00	0.17
252	002423	中粮资本	91,400	1,223,846.00	0.17
253	000519	中兵红箭	84,500	1,221,025.00	0.17
254	601016	节能风电	385,050	1,220,608.50	0.17
255	300748	金力永磁	68,180	1,219,058.40	0.17
256	000060	中金岭南	259,300	1,216,117.00	0.17
257	300567	精测电子	18,900	1,215,270.00	0.17
258	600859	王府井	78,700	1,212,767.00	0.17
259	002756	永兴材料	32,100	1,210,812.00	0.17
260	002683	广东宏大	45,700	1,210,136.00	0.17
261	603000	人民网	54,800	1,207,792.00	0.17
262	600901	江苏金租	229,700	1,199,034.00	0.17
263	603885	吉祥航空	87,220	1,194,914.00	0.17
264	300487	蓝晓科技	24,850	1,189,569.50	0.17
265	688278	特宝生物	16,200	1,188,594.00	0.17
266	600166	福田汽车	470,900	1,181,959.00	0.17
267	600707	彩虹股份	142,300	1,169,706.00	0.17
268	300212	易华录	49,912	1,167,940.80	0.17

269	000998	隆平高科	104,400	1,166,148.00	0.17
270	600546	山煤国际	98,300	1,162,889.00	0.17
271	603156	养元饮品	50,600	1,155,704.00	0.16
272	002439	启明星辰	73,000	1,154,860.00	0.16
273	600282	南钢股份	244,500	1,146,705.00	0.16
274	300601	康泰生物	66,500	1,140,475.00	0.16
275	601001	晋控煤业	82,900	1,133,243.00	0.16
276	002507	涪陵榨菜	79,990	1,130,258.70	0.16
277	600131	国网信通	59,600	1,127,036.00	0.16
278	688220	翱捷科技	20,826	1,126,478.34	0.16
279	600004	白云机场	117,300	1,126,080.00	0.16
280	000598	兴蓉环境	147,900	1,122,561.00	0.16
281	300677	英科医疗	44,400	1,122,432.00	0.16
282	300765	新诺威	41,900	1,114,121.00	0.16
283	688065	凯赛生物	28,669	1,112,357.20	0.16
284	002373	千方科技	109,637	1,111,719.18	0.16
285	603899	晨光股份	36,700	1,110,175.00	0.16
286	600867	通化东宝	137,400	1,107,444.00	0.16
287	002653	海思科	33,300	1,107,225.00	0.16
288	000563	陕国投 A	310,840	1,106,590.40	0.16
289	601918	新集能源	154,100	1,106,438.00	0.16
290	600737	中粮糖业	108,357	1,106,324.97	0.16
291	000050	深天马 A	121,800	1,099,854.00	0.16
292	600483	福能股份	110,200	1,098,694.00	0.16
293	300070	碧水源	217,000	1,098,020.00	0.16
294	688017	绿的谐波	10,100	1,091,406.00	0.15
295	300118	东方日升	90,400	1,082,992.00	0.15
296	002120	韵达股份	143,700	1,080,624.00	0.15
297	601611	中国核建	119,380	1,079,195.20	0.15
298	688772	珠海冠宇	67,087	1,078,758.96	0.15
299	601231	环旭电子	65,100	1,074,150.00	0.15
300	601155	新城控股	89,600	1,071,616.00	0.15
301	002430	杭氧股份	49,100	1,070,380.00	0.15
302	601098	中南传媒	71,293	1,070,107.93	0.15
303	603486	科沃斯	22,700	1,066,900.00	0.15
304	603529	爱玛科技	26,000	1,066,520.00	0.15
305	600566	济川药业	36,600	1,064,328.00	0.15
306	688005	容百科技	33,709	1,063,518.95	0.15
307	601156	东航物流	63,000	1,062,810.00	0.15
308	002244	滨江集团	123,400	1,062,474.00	0.15
309	301308	江波龙	12,300	1,057,800.00	0.15
310	300676	华大基因	25,100	1,053,447.00	0.15
311	601866	中远海发	403,146	1,052,211.06	0.15

312	000887	中鼎股份	80,100	1,050,912.00	0.15
313	603290	斯达半导	11,700	1,050,894.00	0.15
314	601991	大唐发电	368,600	1,050,510.00	0.15
315	000987	越秀资本	149,185	1,047,278.70	0.15
316	002056	横店东磁	80,600	1,044,576.00	0.15
317	600582	天地科技	168,600	1,041,948.00	0.15
318	600598	北大荒	70,600	1,041,350.00	0.15
319	600416	湘电股份	92,000	1,038,680.00	0.15
320	600435	北方导航	106,200	1,036,512.00	0.15
321	002368	太极股份	43,696	1,034,721.28	0.15
322	603228	景旺电子	37,043	1,031,277.12	0.15
323	000818	航锦科技	53,800	1,027,580.00	0.15
324	002670	国盛金控	78,203	1,023,677.27	0.15
325	300595	欧普康视	53,300	1,010,035.00	0.14
326	300009	安科生物	116,328	1,005,073.92	0.14
327	600271	航天信息	110,200	1,003,922.00	0.14
328	002508	老板电器	46,800	1,002,924.00	0.14
329	002831	裕同科技	36,980	1,002,158.00	0.14
330	002240	盛新锂能	72,700	1,001,806.00	0.14
331	603658	安图生物	22,900	999,356.00	0.14
332	600755	厦门国贸	150,400	998,656.00	0.14
333	000958	电投产融	160,200	998,046.00	0.14
334	601958	金钼股份	98,700	992,922.00	0.14
335	600848	上海临港	97,700	986,770.00	0.14
336	002572	索菲亚	57,300	984,414.00	0.14
337	688363	华熙生物	19,200	979,968.00	0.14
338	300888	稳健医疗	23,260	978,780.80	0.14
339	000883	湖北能源	196,300	977,574.00	0.14
340	000155	川能动力	91,500	977,220.00	0.14
341	600258	首旅酒店	66,484	975,320.28	0.14
342	688114	华大智造	20,762	971,453.98	0.14
343	600685	中船防务	40,800	966,960.00	0.14
344	300573	兴齐眼药	13,800	962,964.00	0.14
345	600995	南网储能	95,100	962,412.00	0.14
346	600129	太极集团	38,700	956,664.00	0.14
347	600378	昊华科技	33,000	954,030.00	0.14
348	002268	电科网安	58,700	953,875.00	0.14
349	603444	吉比特	4,347	951,297.48	0.14
350	000739	普洛药业	57,981	942,771.06	0.13
351	600739	辽宁成大	91,000	941,850.00	0.13
352	603379	三美股份	24,420	937,239.60	0.13
353	600517	国网英大	170,000	936,700.00	0.13
354	003031	中瓷电子	17,840	934,637.60	0.13

355	603298	杭叉集团	52,100	932,069.00	0.13
356	000403	派林生物	43,600	921,268.00	0.13
357	601118	海南橡胶	169,600	917,536.00	0.13
358	000027	深圳能源	141,480	916,790.40	0.13
359	600906	财达证券	128,700	913,770.00	0.13
360	601636	旗滨集团	162,800	913,308.00	0.13
361	000778	新兴铸管	237,300	911,232.00	0.13
362	000785	居然智家	255,200	911,064.00	0.13
363	603712	七一二	46,355	902,531.85	0.13
364	603737	三棵树	21,020	895,452.00	0.13
365	002299	圣农发展	61,600	891,968.00	0.13
366	603728	鸣志电器	16,500	891,000.00	0.13
367	600499	科达制造	114,000	889,200.00	0.13
368	600528	中铁工业	110,033	886,865.98	0.13
369	601399	国机重装	286,000	880,880.00	0.13
370	688234	天岳先进	17,200	880,640.00	0.13
371	601928	凤凰传媒	76,100	878,194.00	0.12
372	600606	绿地控股	418,000	877,800.00	0.12
373	002557	洽洽食品	30,200	877,310.00	0.12
374	600373	中文传媒	69,600	873,480.00	0.12
375	600329	达仁堂	28,300	871,640.00	0.12
376	002080	中材科技	66,600	871,128.00	0.12
377	603858	步长制药	54,800	865,840.00	0.12
378	600977	中国电影	74,400	863,784.00	0.12
379	600968	海油发展	201,500	860,405.00	0.12
380	688536	思瑞浦	9,300	860,250.00	0.12
381	688567	孚能科技	72,919	845,860.40	0.12
382	601598	中国外运	156,400	836,740.00	0.12
383	603650	彤程新材	23,900	835,783.00	0.12
384	600884	杉杉股份	111,600	831,420.00	0.12
385	600959	江苏有线	247,901	830,468.35	0.12
386	600056	中国医药	74,640	828,504.00	0.12
387	000559	万向钱潮	134,300	825,945.00	0.12
388	600062	华润双鹤	41,320	818,136.00	0.12
389	601212	白银有色	293,600	816,208.00	0.12
390	600095	湘财股份	113,300	815,760.00	0.12
391	688297	中无人机	20,162	812,125.36	0.12
392	688387	信科移动	135,515	807,669.40	0.11
393	002266	浙富控股	258,700	807,144.00	0.11
394	600801	华新水泥	66,680	806,828.00	0.11
395	600764	中国海防	28,200	798,624.00	0.11
396	002372	伟星新材	63,140	797,458.20	0.11
397	601106	中国一重	272,000	791,520.00	0.11

398	002019	亿帆医药	73,600	788,992.00	0.11
399	000825	太钢不锈	226,200	787,176.00	0.11
400	301301	川宁生物	66,300	786,318.00	0.11
401	000032	深桑达 A	44,500	784,980.00	0.11
402	002487	大金重工	38,000	778,620.00	0.11
403	600663	陆家嘴	78,900	776,376.00	0.11
404	603688	石英股份	26,800	769,964.00	0.11
405	688778	厦钨新能	16,840	768,577.60	0.11
406	601608	中信重工	181,600	762,720.00	0.11
407	688349	三一重能	24,521	757,208.48	0.11
408	603882	金域医学	27,500	757,075.00	0.11
409	688563	航材股份	13,500	753,840.00	0.11
410	600925	苏能股份	141,000	747,300.00	0.11
411	603456	九洲药业	53,200	727,776.00	0.10
412	600578	京能电力	206,500	726,880.00	0.10
413	688561	奇安信	26,987	724,061.21	0.10
414	600500	中化国际	177,920	715,238.40	0.10
415	603556	海兴电力	19,300	713,907.00	0.10
416	300957	贝泰妮	16,700	712,923.00	0.10
417	001227	兰州银行	288,400	709,464.00	0.10
418	002408	齐翔腾达	140,840	708,425.20	0.10
419	601019	山东出版	62,100	704,835.00	0.10
420	002531	天顺风能	89,100	704,781.00	0.10
421	601965	中国汽研	39,900	703,038.00	0.10
422	688425	铁建重工	158,658	698,095.20	0.10
423	001286	陕西能源	75,100	696,928.00	0.10
424	688390	固德威	16,942	692,927.80	0.10
425	600350	山东高速	67,400	692,872.00	0.10
426	688301	奕瑞科技	7,183	686,479.31	0.10
427	603233	大参林	45,500	685,230.00	0.10
428	688516	奥特维	15,723	680,963.13	0.10
429	600098	广州发展	106,000	680,520.00	0.10
430	600612	老凤祥	12,500	678,375.00	0.10
431	000937	冀中能源	107,200	677,504.00	0.10
432	603225	新凤鸣	60,520	673,587.60	0.10
433	601568	北元集团	157,620	662,004.00	0.09
434	600688	上海石化	218,000	658,360.00	0.09
435	603185	弘元绿能	40,500	658,125.00	0.09
436	600126	杭钢股份	136,327	651,643.06	0.09
437	000967	盈峰环境	127,800	635,166.00	0.09
438	603707	健友股份	47,831	634,717.37	0.09
439	603883	老百姓	37,900	620,423.00	0.09
440	002867	周大生	42,550	618,251.50	0.09

441	600720	中交设计	68,300	605,138.00	0.09
442	601139	深圳燃气	85,550	603,983.00	0.09
443	600339	中油工程	166,000	594,280.00	0.08
444	002563	森马服饰	84,000	589,680.00	0.08
445	002608	江苏国信	75,200	576,784.00	0.08
446	600295	鄂尔多斯	58,800	573,888.00	0.08
447	002153	石基信息	79,946	570,814.44	0.08
448	000537	中绿电	61,500	560,880.00	0.08
449	688032	禾迈股份	4,958	558,469.12	0.08
450	300140	节能环境	92,200	552,278.00	0.08
451	003022	联泓新科	39,800	548,046.00	0.08
452	688248	南网科技	16,900	542,321.00	0.08
453	000401	冀东水泥	103,100	539,213.00	0.08
454	688281	华秦科技	5,785	538,583.50	0.08
455	688331	荣昌生物	17,661	531,772.71	0.08
456	600032	浙江新能	71,600	529,840.00	0.08
457	601228	广州港	154,900	525,111.00	0.07
458	002690	美亚光电	34,990	518,551.80	0.07
459	600299	安迪苏	39,900	500,745.00	0.07
460	603786	科博达	8,100	500,580.00	0.07
461	301165	锐捷网络	6,800	490,960.00	0.07
462	003035	南网能源	117,100	489,478.00	0.07
463	600928	西安银行	135,000	487,350.00	0.07
464	600007	中国国贸	19,900	486,754.00	0.07
465	301267	华夏眼科	25,400	483,616.00	0.07
466	688520	神州细胞	13,300	481,859.00	0.07
467	688172	燕东微	23,928	479,756.40	0.07
468	688475	萤石网络	15,700	473,983.00	0.07
469	600361	创新新材	122,200	471,692.00	0.07
470	000959	首钢股份	152,000	463,600.00	0.07
471	603056	德邦股份	30,500	437,065.00	0.06
472	002945	华林证券	28,100	430,773.00	0.06
473	301498	乖宝宠物	5,200	407,264.00	0.06
474	600927	永安期货	30,700	404,933.00	0.06
475	000539	粤电力 A	88,300	399,999.00	0.06
476	601061	中信金属	53,400	387,684.00	0.06
477	688375	国博电子	7,782	384,119.52	0.05
478	001203	大中矿业	44,000	381,040.00	0.05
479	603826	坤彩科技	19,640	378,070.00	0.05
480	688819	天能股份	13,565	369,239.30	0.05
481	601858	中国科传	15,600	317,928.00	0.05
482	688276	百克生物	12,400	311,364.00	0.04
483	601158	重庆水务	59,900	293,510.00	0.04



484	688153	唯捷创芯	8,600	287,756.00	0.04
485	600956	新天绿能	31,900	240,526.00	0.03
486	603341	龙旗科技	5,100	238,425.00	0.03
487	603868	飞科电器	4,800	199,296.00	0.03
488	688295	中复神鹰	9,900	197,307.00	0.03

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

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	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.01
2	400174	中天 3	327,600	36,036.00	0.01
3	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
4	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
5	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
6	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
7	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
8	601058	赛轮轮胎	900	12,897.00	0.00
9	601077	渝农商行	2,100	12,705.00	0.00
10	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
11	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
12	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
13	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
14	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
15	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
16	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
17	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
18	688779	五矿新能	300	1,596.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300339	润和软件	4,891,013.00	0.39
2	688777	中控技术	3,621,136.72	0.29
3	600487	亨通光电	3,571,636.00	0.29
4	601099	太平洋	3,293,073.00	0.26
5	601567	三星医疗	3,106,145.00	0.25
6	002202	金风科技	2,911,716.00	0.23
7	300476	胜宏科技	2,687,793.00	0.22
8	688617	惠泰医疗	2,640,942.78	0.21
9	002436	兴森科技	2,638,081.00	0.21
10	688525	佰维存储	2,636,786.24	0.21
11	301358	湖南裕能	2,536,755.00	0.20

12	601615	明阳智能	2,493,353.29	0.20
13	002085	万丰奥威	2,468,705.00	0.20
14	603979	金诚信	2,460,851.00	0.20
15	300002	神州泰岳	2,444,518.00	0.20
16	000921	海信家电	2,441,946.00	0.20
17	300496	中科创达	2,441,249.00	0.20
18	688047	龙芯中科	2,437,593.11	0.20
19	688469	芯联集成	2,431,914.06	0.19
20	688213	思特威	2,423,613.67	0.19

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	16,188,091.00	1.30
2	002028	思源电气	8,887,835.00	0.71
3	002463	沪电股份	8,238,546.50	0.66
4	300394	天孚通信	7,867,257.40	0.63
5	002422	科伦药业	7,231,607.00	0.58
6	000975	山金国际	6,470,976.17	0.52
7	688169	石头科技	6,370,189.67	0.51
8	000933	神火股份	6,237,157.00	0.50
9	300418	昆仑万维	6,001,389.90	0.48
10	000630	铜陵有色	5,621,415.00	0.45
11	601058	赛轮轮胎	4,114,626.00	0.33
12	600160	巨化股份	3,980,719.40	0.32
13	601077	渝农商行	3,925,686.00	0.31
14	688072	拓荆科技	3,823,529.84	0.31
15	000988	华工科技	3,814,333.00	0.31
16	600157	永泰能源	3,670,120.00	0.29
17	000423	东阿阿胶	3,602,653.00	0.29
18	002517	恺英网络	3,534,528.00	0.28
19	002966	苏州银行	3,480,096.00	0.28
20	002340	格林美	3,376,849.00	0.27

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	328,931,564.37
卖出股票收入（成交）总额	580,243,970.10

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

（本基金本报告期有股指期货投资，请基金经理填写，括号内容请注意删除）

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	92,033.28
2	应收清算款	1,770,559.19
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	-
8	其他	3,306.59
9	合计	1,865,899.06

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	301611	珂玛科技	45,104.40	0.01	新股锁定
2	400174	中天 3	36,036.00	0.01	停牌
3	688726	拉普拉斯	32,365.74	0.00	新股锁定
4	688721	龙图光罩	15,861.15	0.00	新股锁定
5	301556	托普云农	15,766.35	0.00	新股锁定

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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（%）
881	135,285.04	114,781,708.00	96.30	4,404,413.00	3.70

9.1.2 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	88,750,799.00	74.46

9.2 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	18.82

	份有限公司一分红一个险分红		
2	浙商证券股份有限公司	908,600.00	0.76
3	国泰君安证券股份有限公司	578,890.00	0.49
4	广发证券股份有限公司	512,045.00	0.43
5	大杨集团有限责任公司	500,572.00	0.42
6	陶蕴	373,000.00	0.31
7	谷元明	350,000.00	0.29
8	方正证券股份有限公司	328,545.00	0.28
9	中国平安人寿保险股份有限公司—传统—银保账户	237,800.00	0.20
10	黎旭晖	236,286.00	0.20
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	88,750,799.00	74.46

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

9.4 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

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

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

§ 10 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）	2,648,875,604.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	220,386,121.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	125,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	119,186,121.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2024 年 12 月 9 日，根据工作安排，宋菁女士不再担任平安银行股份有限公司资产托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 48,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	3	366,181,241.	40.37	218,797.39	46.56	-

		72				
国泰君安 证券	2	140,960,897. 96	15.54	28,171.62	6.00	-
东方证券	1	126,075,505. 01	13.90	23,437.94	4.99	-
东吴证券	2	110,041,896. 08	12.13	80,979.22	17.23	-
东北证券	3	100,354,863. 00	11.06	73,850.78	15.72	-
申万宏源 证券	2	53,682,032.4 4	5.92	39,510.56	8.41	-
广发证券	2	3,676,062.77	0.41	683.35	0.15	-
开源证券	2	3,435,437.32	0.38	2,527.92	0.54	-
国信证券	2	2,516,306.00	0.28	1,851.85	0.39	-
长江证券	1	69,953.73	0.01	51.47	0.01	-
西部证券	1	49,440.42	0.01	36.39	0.01	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

- （1）财务状况良好
- （2）经营行为规范
- （3）合规风控能力较高

2、基金管理人根据上述标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议，自2024年7月1日起，按照《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》等相关要求执行。

3、报告期内新增交易单元的情况：新增国泰君安证券交易单元1个。

4、报告期内退租交易单元的情况：减少大通证券交易单元2个，减少东方财富证券交易单元2个，减少东兴证券交易单元2个，减少方正证券交易单元2个，减少平安证券交易单元2个，减少世纪证券交易单元2个，减少银河证券交易单元2个，减少中信建投证券交易单元2个，减少东北证券交易单元1个，减少光大证券交易单元1个，减少广发证券交易单元1个，减少国投证券交易单元1个，减少万联证券交易单元1个，减少中泰证券交易单元1个，减少中信证券交易单元1个。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-



渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 03 日
2	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	2024 年 01 月 03 日
3	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 04 日
4	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	2024 年 01 月 06 日

5	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 06 日
6	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	2024 年 01 月 15 日
7	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 22 日
8	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 30 日
9	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 22 日
10	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 06 月 19 日
11	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	2024 年 06 月 28 日
12	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 07 月 19 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增渤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	2024 年 07 月 22 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华宝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	2024 年 07 月 23 日
15	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 08 月 31 日
16	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 09 月 14 日
17	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 09 月 28 日
18	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 10 月 25 日
19	平安基金管理有限公司关于新增长城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	2024 年 11 月 04 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	2024 年 12 月 20 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		超过 20%的时间区间					(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2024 年 01 月 01 日-2024 年 12 月 31 日	191,187,899.00	136,332,900.00	238,770,000.00	88,750,799.00	74.46
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。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安中证 500 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

13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

13.3 查阅方式

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

平安基金管理有限公司  
2025 年 3 月 29 日