

平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资
基金
2019 年第 3 季度报告

2019 年 9 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2019 年 10 月 25 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	平安沪深 300ETF
场内简称	平安 300
交易代码	510390
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 25 日
报告期末基金份额总额	1,268,749,992.00 份
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	沪深 300 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。
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2019年7月1日—2019年9月30日）
1. 本期已实现收益	67,103,169.55
2. 本期利润	51,579,048.79
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0384
4. 期末基金资产净值	5,020,736,270.10
5. 期末基金份额净值	3.9572

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. 所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

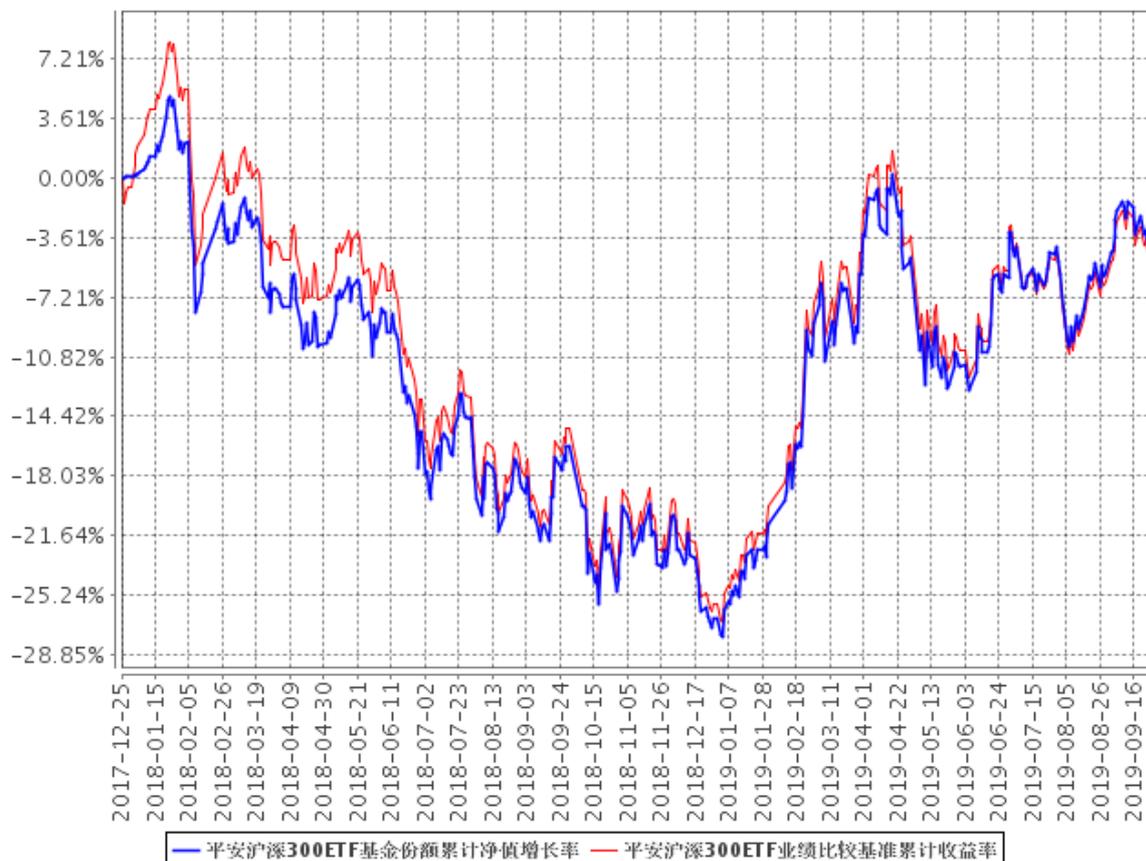
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率 ①	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	0.73%	0.96%	-0.29%	0.96%	1.02%	0.00%

沪深 300 指数收益率

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

平安沪深300ETF基金份额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



1、本基金基金合同于 2017 年 12 月 25 日正式生效，截至报告期末已满一年；

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

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
成钧	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、ETF 指数中心指数投资总监	2017 年 12 月 25 日	-	9	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 指数中心指数投资总监。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、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 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、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基金经理。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》及其各项实施细则、《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，没有损害基金持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金投资策略和运作分析

(1) 投资策略

作为一只投资于沪深 300 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。

(2) 运作分析

报告期内，本基金的日均偏离度为 0.02%，年化跟踪误差 0.47%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2%的投资目标。

4.5 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 3.9572 元；本报告期基金份额净值增长率为 0.73%，业绩比较基准收益率为-0.29%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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量不满 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,006,752,285.95	99.57
	其中：股票	5,006,752,285.95	99.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	14,755,335.26	0.29
8	其他资产	7,117,113.89	0.14
9	合计	5,028,624,735.10	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	79,720,693.76	1.59
B	采矿业	150,714,011.55	3.00
C	制造业	2,077,202,717.84	41.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	113,970,520.82	2.27
E	建筑业	141,597,747.66	2.82

F	批发和零售业	64,179,586.12	1.28
G	交通运输、仓储和邮政业	145,145,624.89	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	190,543,427.55	3.80
J	金融业	1,699,696,030.59	33.85
K	房地产业	207,729,845.84	4.14
L	租赁和商务服务业	71,026,639.08	1.41
M	科学研究和技术服务业	5,045,940.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	5,223,735.00	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	28,880,134.79	0.58
R	文化、体育和娱乐业	25,877,663.32	0.52
S	综合	-	-
	合计	5,006,554,318.81	99.72

5.2.2 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	53,036.38	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	144,930.76	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	197,967.14	0.00

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	4,372,586	380,589,885.44	7.58
2	600519	贵州茅台	203,502	234,027,300.00	4.66
3	600036	招商银行	4,167,003	144,803,354.25	2.88
4	000651	格力电器	1,948,816	111,667,156.80	2.22
5	601166	兴业银行	5,868,979	102,883,201.87	2.05
6	000858	五粮液	784,600	101,841,080.00	2.03
7	600276	恒瑞医药	1,250,138	100,861,133.84	2.01
8	000333	美的集团	1,964,098	100,365,407.80	2.00
9	600030	中信证券	3,174,800	71,369,504.00	1.42
10	600887	伊利股份	2,459,082	70,133,018.64	1.40

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	688368	晶丰明源	2,557	144,930.76	0.00
2	300790	宇瞳光学	671	31,094.14	0.00
3	603786	科博达	816	21,942.24	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1912	沪深 300 指数	13	14,890,200.00	-503,256.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-503,256.00
股指期货投资本期收益(元)					2,355,267.96
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-1,975,566.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

5.10.3 本期国债期货投资评价

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1

本组合投资的前十名证券之一招商银行，因未依法履行其他职责，全国银行间同业拆借中心于 2019 年 7 月 8 日依据相关法规给予内部通报批评处分决定。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为有效跟踪标的指数，控制跟踪偏离和跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成分股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

5.11.2

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股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	1,649,263.39
2	应收证券清算款	4,377,659.39
3	应收股利	-
4	应收利息	40,717.58
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	96,842.41
8	其他	952,631.12
9	合计	7,117,113.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688368	晶丰明源	144,930.76	0.00	新股未上市
2	603786	科博达	21,942.24	0.00	新股未上市

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	1,366,849,992.00
报告期期间基金总申购份额	54,900,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	153,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	1,268,749,992.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况**7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况**

无。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2019/07/01--2019/09/30	323,184,215.00	0.00	0.00	323,184,215.00	25.47%
	2	2019/07/01--2019/09/30	598,489,491.00	0.00	12,489,400.00	586,000,091.00	46.19%
产品特有风险							
<p>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。</p>							

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会批准平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金设立的文件
- (2) 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (4) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程
- (5) 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 3 季度报告原文

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2019 年 10 月 25 日