

# 平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2019 年年度报告

2019 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：2020 年 4 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 2020 年 4 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 2019 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	10
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	14
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>15</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	17
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.....	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
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.....	20
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>21</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	21
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.....	21
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.....	21
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>22</b>
6.1 审计报告基本信息.....	22
6.2 审计报告的基本内容.....	22
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>25</b>
7.1 资产负债表.....	25
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	28
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	56
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	56
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.....	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78
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.....	78

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 .....	78
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 .....	78
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 .....	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	79
8.12 投资组合报告附注 .....	79
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>81</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	81
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	81
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	82
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>83</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>84</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4 基金投资策略的改变 .....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
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 .....	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	84
11.8 其他重大事件 .....	88
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>91</b>
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 .....	91
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>92</b>
13.1 备查文件目录 .....	92
13.2 存放地点 .....	92
13.3 查阅方式 .....	92

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金	
基金简称	平安量化先锋混合	
场内简称	-	
基金主代码	005084	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 11 月 1 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	16,183,594.31 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	平安量化先锋混合 A	平安量化先锋混合 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	005084	005085
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	14,297,423.01 份	1,886,171.30 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金利用数量化投资模型指导投资组合的构建，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用数量化投资策略建立投资模型，采用自上而下的资产配置和自下而上的个股选择相结合的方式，切实贯彻数量化的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其长期平均风险和预期收益水平低于股票型基金，高于债券型基金、货币市场基金

### 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	深圳市罗湖区深南东路 5047 号

	路 5033 号平安金融中心 34 层	
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	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
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	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## § 3 主要财务指标、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	2019 年		2018 年		2017 年 11 月 1 日(基金合同 生效日)-2017 年 12 月 31 日	
	平安量化先 锋混合 A	平安量化先 锋混合 C	平安量化先 锋混合 A	平安量化先 锋混合 C	平安量化先 锋混合 A	平安量化先 锋混合 C
本期 已 实 现 收 益	3,051,131.60	549,049.69	-2,740,554.57	-447,202.61	-39,184.14	-74,857.56
本期 利 润	3,845,314.49	716,576.64	-3,580,341.42	-352,409.49	73,308.75	24,332.28
加 权 平 均 基 金 份 额 本 期 利 润	0.2533	0.2720	-0.2232	-0.0879	0.0039	0.0011
本 期 加 权 平 均	26.76%	29.25%	-24.02%	-9.31%	0.39%	0.11%

净值利润率						
本期基金份额净值增长率	31.78%	30.77%	-23.04%	-23.72%	0.40%	0.26%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
期末可供分配利润	261,306.62	229.27	-3,521,034.36	-725,962.05	-38,411.44	-56,003.17
期末可供分配基金份额利润	0.0183	0.0001	-0.2273	-0.2352	-0.0021	-0.0035



期末基金资产净值	14,558,729.63	1,886,400.57	11,972,081.37	2,359,969.83	18,437,465.80	16,060,081.57
期末基金份额净值	1.0183	1.0001	0.7727	0.7648	1.0040	1.0026
3.1.3 累计期末指标	2019 年末		2018 年末		2017 年末	
基金份额累计净值增长率	1.83%	0.01%	-22.73%	-23.52%	0.40%	0.26%

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安量化先锋混合 A

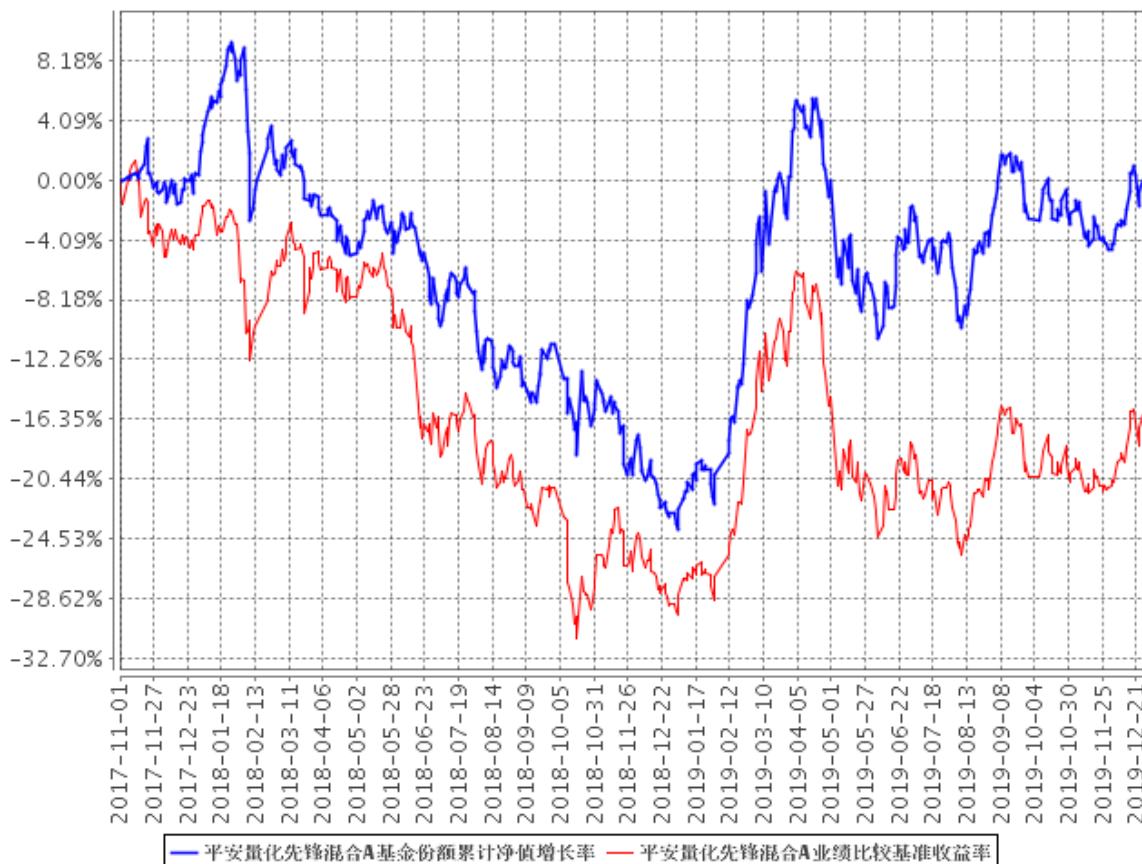
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.58%	0.78%	6.29%	0.88%	-1.71%	-0.10%
过去六个月	6.31%	0.94%	6.12%	1.03%	0.19%	-0.09%
过去一年	31.78%	1.28%	19.27%	1.32%	12.51%	-0.04%
自基金合同生效起至今	1.83%	1.14%	-15.32%	1.23%	17.15%	-0.09%

平安量化先锋混合 C

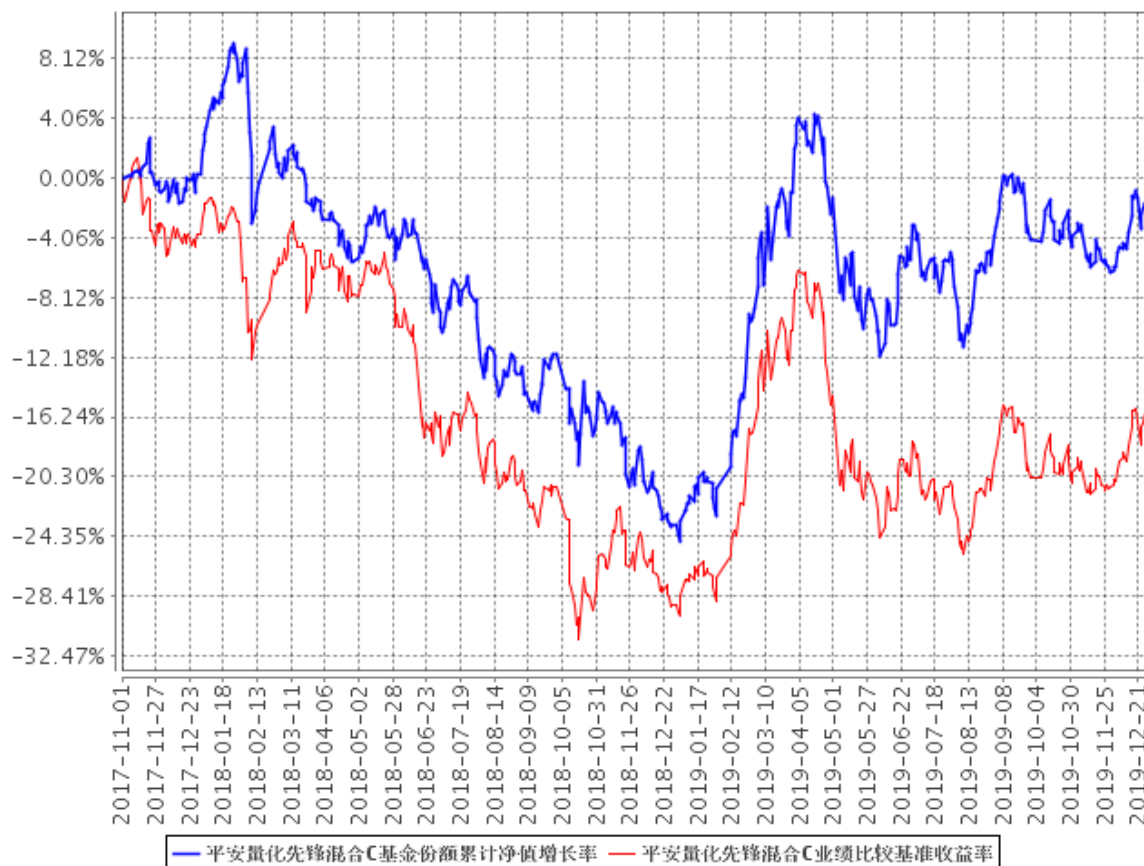
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.37%	0.78%	6.29%	0.88%	-1.92%	-0.10%
过去六个月	5.91%	0.94%	6.12%	1.03%	-0.21%	-0.09%
过去一年	30.77%	1.28%	19.27%	1.32%	11.50%	-0.04%
自基金合同生效起至今	0.01%	1.14%	-15.32%	1.23%	15.33%	-0.09%

### 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

平安量化先锋混合A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



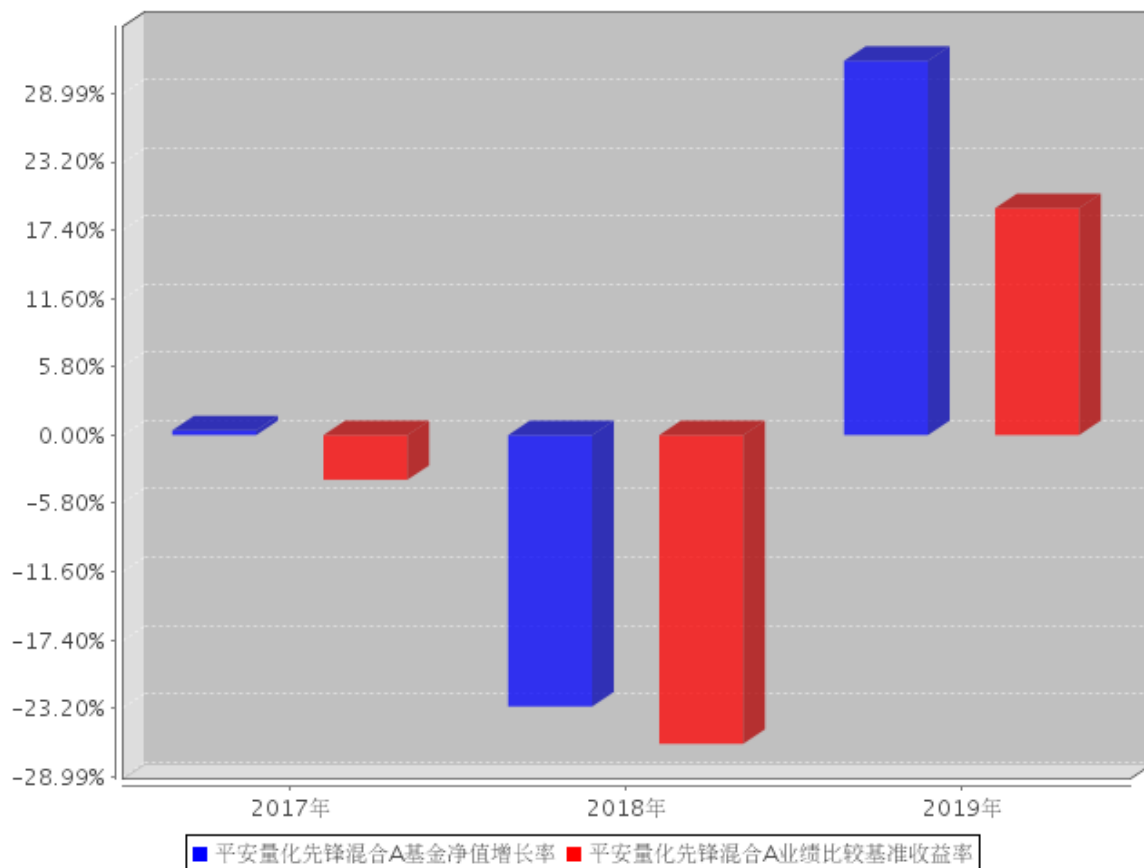
平安量化先锋混合C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



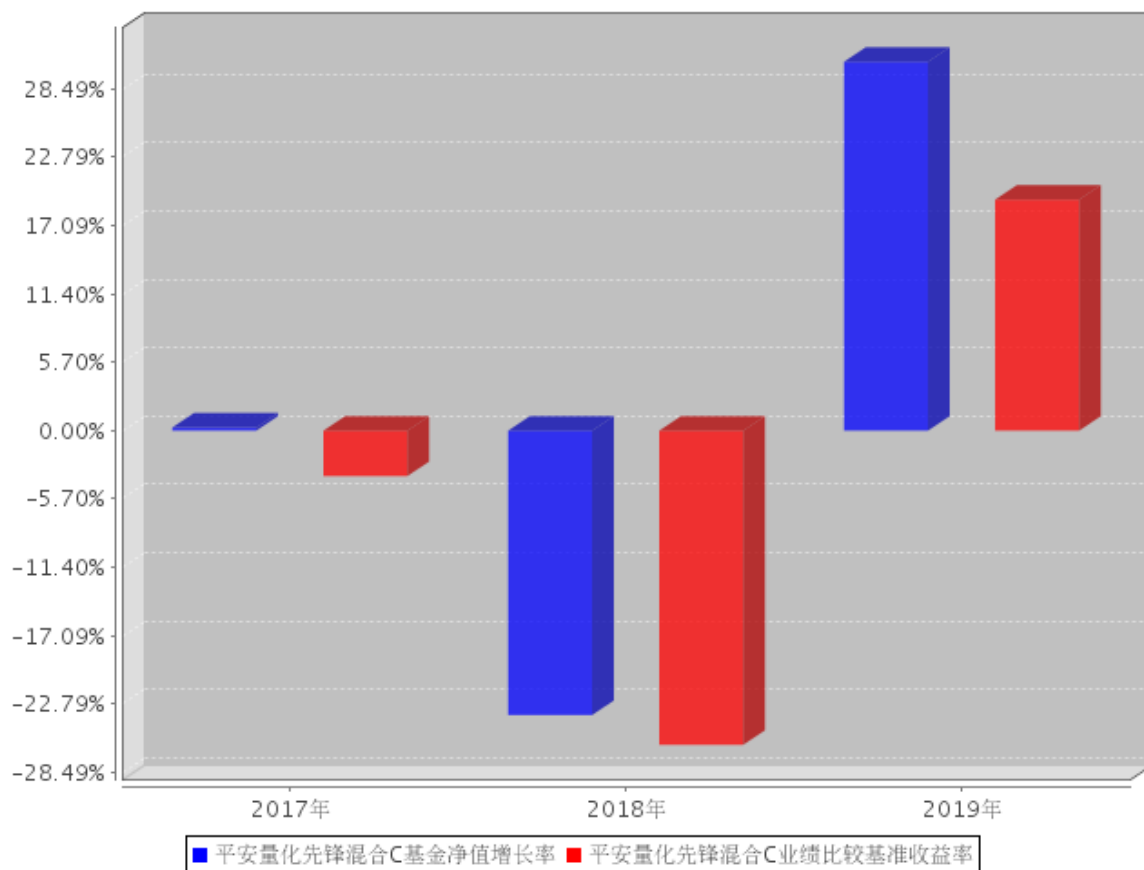
- 1、本基金基金合同于 2017 年 11 月 01 日正式生效；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

平安量化先锋混合A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安量化先锋混合C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2017 年 11 月 01 日正式生效。
2. 2017 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

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

本基金合同于 2017 年 11 月 01 日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## § 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（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股权 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2019 年 12 月 31 日，平安基金共管理 98 只公募基金，资产管理总规模约为 3494 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		
施旭	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金经理	2017 年 11 月 1 日	2019 年 11 月 1 日	10	施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士。曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，2015 年加入平安基金管理有限公司，任衍生品投资中心量化研究员，曾担任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安量化精选混合型发

					起式证券投资基金、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、平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
DANIEL DONGNING SUN	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金经理、衍生品投资中心投资执行总经理	2018 年 1 月 23 日	-	15	DANIEL DONGNING SUN 先生，美国籍，北京大学硕士，美国哥伦比亚大学博士，约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人。2014 年 10 月加入平安基金管理有限公司，任衍生品投资中心投资执行总经理。现任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。
吕振山	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金的基金经理	2019 年 10 月 11 日	-	5	吕振山先生，北京大学金融工程专业硕士研究生。曾担任中国银河证券股份有限公司投资经理。2018 年 3 月加入平安基金管理有限公司，曾任衍生品投资中心投资经理、平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平



					安鑫享混合型证券投资基金的基金经理助理。现担任平安量化精选混合型发起式证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安鑫享混合型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

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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，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管理制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控及报告制度》，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，由投资组合经理、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。

#### 4.3.3 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

报告期内，A 股市场后扬后抑再扬，呈现出震荡向上的趋势。各个板块整体分化明显，尤其是下半年流动性预期持续改善，风险偏好持续提升，业绩预告披露个股显示盈利预期稳定，科技板块呈现出明显的强硬走势。本基金坚持采用量化多因子策略，通过多个数据维度，结合股票的基本面和市场情绪，以严谨的数量化手段甄选个股、优化权重，构建中证 500 指数增强组合，借助拆单、分散换手等方法降低换仓成本，力图在控制行业、风格和个股偏离后，在市场波动过程中获取相对基准稳健有竞争力的超额收益，在指数回报之外，为投资人获得了良好的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安量化先锋混合 A 基金份额净值为 1.0183 元，本报告期基金份额净值增长率为 31.78%；截至本报告期末平安量化先锋混合 C 基金份额净值为 1.0001 元，本报告期基金份额净值增长率为 30.77%；同期业绩比较基准收益率为 19.27%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，由于资金相对宽松和对科技投入的认可，市场很大程度上将延续流动性和结构性行情，这个基金作为对于中大盘偏成长的中证 500 指数的增强基金，采用有效的量化策略，适合在股票精选和市场情绪中获取超额收益，具有很好的配置价值。

#### 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、邮件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

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。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工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组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。估值工作组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。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 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

不适用。

## § 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	普华永道中天审字(2020)第 24453 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	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安量化先锋基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	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。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。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安量化先锋基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	平安量化先锋基金的基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，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。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安量化先锋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，除非基金管理人管理层计划清算平安量化先锋基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督平安量化先锋基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的	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

责任	<p>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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人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>(四) 对基金管理人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，就可能导致对平安量化先锋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量化先锋基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

注册会计师的姓名	曹翠丽	邓昭君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2020 年 4 月 23 日	



## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：平安量化先锋混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	859,004.61	897,842.74
结算备付金		186,856.69	823,508.57
存出保证金		14,355.71	31,442.74
交易性金融资产	7.4.7.2	15,582,424.80	9,317,530.00
其中：股票投资		15,582,424.80	9,317,530.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	3,600,000.00
应收证券清算款		77,236.50	-
应收利息	7.4.7.5	269.70	-147.71
应收股利		-	-
应收申购款		13,786.98	4,992.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		16,733,934.99	14,675,168.85
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付证券清算款		19,645.06	96,500.00
应付赎回款		117,813.42	26,897.91
应付管理人报酬		21,099.02	18,868.83
应付托管费		3,516.49	3,144.80
应付销售服务费		1,488.42	1,646.65
应付交易费用	7.4.7.7	82,730.74	103,460.81
应交税费		-	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	42,511.64	92,598.65
负债合计		288,804.79	343,117.65
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	16,183,594.31	18,579,047.61
未分配利润	7.4.7.10	261,535.89	-4,246,996.41
所有者权益合计		16,445,130.20	14,332,051.20
负债和所有者权益总计		16,733,934.99	14,675,168.85

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额总额 16,183,594.31 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0183 元，A 类基金份额 14,297,423.01 份；下属 C 类基金份额净值 1.0001 元，C 类基金份额 1,886,171.30 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安量化先锋混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		5,584,555.97	-3,056,683.41
1.利息收入		14,124.44	133,636.31
其中：存款利息收入	7.4.7.11	11,267.05	22,187.07
债券利息收入		-	8,699.17
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,857.39	102,750.07
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		4,596,029.34	-2,463,127.97
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,402,047.66	-2,647,614.43
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-13,800.00
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	193,981.68	198,286.46
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	961,709.84	-744,993.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	12,692.35	17,801.98

列)			
<b>减：二、费用</b>		1,022,664.84	876,067.50
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	251,605.68	280,434.51
2. 托管费	7.4.10.2.2	41,934.26	46,739.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	19,535.55	30,231.85
4. 交易费用	7.4.7.19	653,589.35	411,161.99
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	56,000.00	107,500.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		4,561,891.13	-3,932,750.91
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		4,561,891.13	-3,932,750.91

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安量化先锋混合型发起式证券投资基金

本报告期：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	18,579,047.61	-4,246,996.41	14,332,051.20
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	4,561,891.13	4,561,891.13
三、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）	-2,395,453.30	-53,358.83	-2,448,812.13
其中：1. 基金申购款	4,262,653.25	-176,137.99	4,086,515.26
2. 基金赎回款	-6,658,106.55	122,779.16	-6,535,327.39
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基	16,183,594.31	261,535.89	16,445,130.20

项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益（基金净值）	34,382,351.74	115,195.63	34,497,547.37
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-3,932,750.91	-3,932,750.91
三、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）	-15,803,304.13	-429,441.13	-16,232,745.26
其中：1. 基金申购款	3,921,581.81	56,000.44	3,977,582.25
2. 基金赎回款	-19,724,885.94	-485,441.57	-20,210,327.51
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	18,579,047.61	-4,246,996.41	14,332,051.20

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  林婉文  张南南                      
 基金管理人负责人                    主管会计工作负责人                    会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安量化先锋混合型发起式证券投资基金(原名为平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金,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[2017]1046号《关于准予平安大华量化先锋混合型发起式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《平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集41,005,096.27元,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(2017)第 823 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2017 年 11 月 1 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 41,032,787.21 份基金份额,其中认购资金利息折合 27,690.94 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(以下简称“平安银行”)。

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》,平安大华量化先锋混合型发起式证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安量化先锋混合型发起式证券投资基金。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,109,883.69 基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《平安量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(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、金融债、央行票据、地方政府债、企业债、公司债、可转换公司债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债)、资产支持证券、债券回购、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款)、同业存单、货币市场工具,权证、股指期货、国债期货,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。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+商业银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于 2019 年 12 月 31 日，本基金的基金资产净值为 16,445,130.20 元，且本基金的基金合同将于未来 12 个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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一致。

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产

与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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

本基金的收益分配政策为：(1) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金进行分红，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利



再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金份额持有人可对本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额分别选择不同的分红方式，同一投资者持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式。如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；(3) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，但本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权；(4) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指

数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《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》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《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》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。对资管产品在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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(2) 对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，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
活期存款	859,004.61	897,842.74
定期存款	-	-
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	-	-
合计：	859,004.61	897,842.74

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	15,154,025.96	15,582,424.80	428,398.84
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	15,154,025.96	15,582,424.80	428,398.84
	项目	上年度末 2018年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
	股票	9,850,841.00	9,317,530.00	-533,311.00
	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	9,850,841.00	9,317,530.00	-533,311.00

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
合计	-	-
项目	上年度末 2018年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,600,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	3,600,000.00	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	179.10	167.59
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	84.10	370.60
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-700.00
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	6.50	14.10
合计	269.70	-147.71

## 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	82,730.74	103,460.81
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	82,730.74	103,460.81

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	11.64	98.65
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	42,500.00	92,500.00
合计	42,511.64	92,598.65

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安量化先锋混合 A		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,493,115.73	15,493,115.73
本期申购	2,595,961.00	2,595,961.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,791,653.72	-3,791,653.72
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	14,297,423.01	14,297,423.01

金额单位：人民币元

平安量化先锋混合 C		
项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,085,931.88	3,085,931.88
本期申购	1,666,692.25	1,666,692.25
本期赎回（以“-”号填列）	-2,866,452.83	-2,866,452.83
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,886,171.30	1,886,171.30

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安量化先锋混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,754,440.53	-766,593.83	-3,521,034.36
本期利润	3,051,131.60	794,182.89	3,845,314.49
本期基金份额交易产生的变动数	-35,252.32	-27,721.19	-62,973.51
其中：基金申购款	-98,748.47	-15,403.92	-114,152.39
基金赎回款	63,496.15	-12,317.27	51,178.88
本期已分配利润	-	-	-

本期末	261,438.75	-132.13	261,306.62
-----	------------	---------	------------

单位：人民币元

平安量化先锋混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-574,361.74	-151,600.31	-725,962.05
本期利润	549,049.69	167,526.95	716,576.64
本期基金份额交易产生的变动数	26,130.14	-16,515.46	9,614.68
其中：基金申购款	-39,855.96	-22,129.64	-61,985.60
基金赎回款	65,986.10	5,614.18	71,600.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	818.09	-588.82	229.27

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
活期存款利息收入	6,896.71	15,354.38
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	4,027.87	6,443.76
其他	342.47	388.93
合计	11,267.05	22,187.07

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
卖出股票成交总额	250,487,041.04	163,881,158.30
减：卖出股票成本总额	246,084,993.38	166,528,772.73
买卖股票差价收入	4,402,047.66	-2,647,614.43

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-	-13,800.00
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	-	-13,800.00

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	-	3,061,334.79
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	-	3,027,600.00
减：应收利息总额	-	47,534.79
买卖债券差价收入	-	-13,800.00

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

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。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

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。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

#### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。



**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	193,981.68	198,286.46
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	193,981.68	198,286.46

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	961,709.84	-744,993.73
——股票投资	961,709.84	-744,993.73
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-

——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	961,709.84	-744,993.73

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
基金赎回费收入	12,374.88	17,739.03
基金转换费收入	317.47	62.95
合计	12,692.35	17,801.98

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持续持有期少于 30 日的投资人，将赎回费全额计入基金财产；对持续持有期大于 30 日(含)但少于 3 个月的投资人，赎回费总额的 75% 计入基金财产；对持续持有期长于 3 个月(含)但少于 6 个月的投资人，将赎回费总额的 50% 计入基金财产；对持续持有期长于 6 个月(含)的投资人，将赎回费总额的 25% 计入基金财产，其余用于支付登记费和其他必要的手续费。对于 C 类基金份额持有人，对于赎回时份额持有不满 7 天的收取 1.5% 的赎回费，对赎回时份额持有期长于 7 天(含 7 天)但少于 30 天的投资人收取 0.50% 的赎回费，收取的赎回费全额计入基金财产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12 月31日
交易所市场交易费用	653,589.35	411,161.99
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	653,589.35	411,161.99

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 12月31日
审计费用	38,000.00	38,000.00
信息披露费	-	50,000.00
证券出借违约金	-	-
银行间账户维护费	18,000.00	19,500.00
合计	56,000.00	107,500.00

### 7.4.7.21 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，无需作披露的分部报告。

### 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，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 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。

### 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、注册登记机构、基金销售机构
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
深圳平安汇通投资管理有限公司	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
中国平安保险（集团）股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
上海陆金所基金销售有限公司（“陆金所”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
中国平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基

	金销售机构
--	-------

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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
平安证券	2,040,997.00	0.41%	13,010,080.56	4.21%

###### 7.4.10.1.2 债券交易

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交易。

###### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
平安证券	7,000,000.00	64.81%	-	-

###### 7.4.10.1.4 权证交易

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 2019年1月1日至2019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
平安证券	1,451.81	0.40%	-	-

关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018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
平安证券	9,254.59	4.21%	9,254.59	8.95%

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。

## 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	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	251,605.68	280,434.51
其中：支付销售机构的客户维护费	56,247.67	72,632.40

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 1.50%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 × 1.50% / 当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年1月1日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	41,934.26	46,739.15

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.25%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 × 0.25% / 当年天数。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安量化先锋混合 A	平安量化先锋混合 C	合计
	平安银行	0.00	8,341.06
平安基金	0.00	248.50	248.50
陆金所	0.00	112.71	112.71
平安证券	0.00	10.46	10.46
合计	0.00	8,712.73	8,712.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日 当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安量化先锋混合 A	平安量化先锋混合 C	合计
	平安银行	0.00	10,939.82
平安基金	0.00	251.48	251.48
陆金所	0.00	178.46	178.46
平安证券	0.00	1.71	1.71
合计	0.00	11,371.47	11,371.47

支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.8% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.8% / 当年天数。

**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**

本基金于本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。

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

#### 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

份额单位：份

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	
	平安量化先锋混合 A	平安量化先锋混合 C
基金合同生效日（2017年11月1日）持有的基金份额	10,010,801.08	-
报告期初持有的基金份额	10,010,801.08	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,010,801.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	61.8577%	-

项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年12月31日	
	平安量化先锋混合 A	平安量化先锋混合 C
基金合同生效日（2017年11月1日）持有的基金份额	10,010,801.08	-
报告期初持有的基金份额	10,010,801.08	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,010,801.08	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	53.8822%	-

上述持有份额占总份额比例的计算中，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

##### 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

无

**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 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	859,004.61	6,896.71	897,842.74	15,354.38

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**

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**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**7.4.12 期末（2019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**

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

**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
603799	华友钴业	2019年12月31日	重大资产重组	39.39	2020年1月2日	40.43	2,400	88,588.00	94,536.00	-

注：本基金截至2019年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

**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**

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

本基金本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涉及的财务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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

##### 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之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2019 年 12 月 31 日，本基金无债券投资（2018 年 12 月 31 日：同）

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

##### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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。

于报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.2 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时间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发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金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%，本基金与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上述比例限制)。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%。于报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 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。于报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过 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**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

##### **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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019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	859,004.61	-	-	-	859,004.61
结算备付金	186,856.69	-	-	-	186,856.69
存出保证金	14,355.71	-	-	-	14,355.71
交易性金融资产	-	-	-	15,582,424.80	15,582,424.80
应收证券清算款	-	-	-	77,236.50	77,236.50
应收利息	-	-	-	269.70	269.70
应收申购款	-	-	-	13,786.98	13,786.98
资产总计	1,060,217.01	-	-	15,673,717.98	16,733,934.99
负债					
应付证券清算款	-	-	-	19,645.06	19,645.06
应付赎回款	-	-	-	117,813.42	117,813.42
应付管理人报酬	-	-	-	21,099.02	21,099.02
应付托管费	-	-	-	3,516.49	3,516.49
应付销售服务费	-	-	-	1,488.42	1,488.42
应付交易费用	-	-	-	82,730.74	82,730.74
其他负债	-	-	-	42,511.64	42,511.64
负债总计	-	-	-	288,804.79	288,804.79
利率敏感度缺口	1,060,217.01	-	-	-15,384,913.19	16,445,130.20
上年度末 2018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	897,842.74	-	-	-	897,842.74
结算备付金	823,508.57	-	-	-	823,508.57
存出保证金	31,442.74	-	-	-	31,442.74
交易性金融资产	-	-	-	9,317,530.00	9,317,530.00
买入返售金融资产	3,600,000.00	-	-	-	3,600,000.00
应收利息	-	-	-	-147.71	-147.71
应收申购款	-	-	-	4,992.51	4,992.51
资产总计	5,352,794.05	-	-	9,322,374.80	14,675,168.85
负债					
应付证券清算款	-	-	-	96,500.00	96,500.00
应付赎回款	-	-	-	26,897.91	26,897.91
应付管理人报酬	-	-	-	18,868.83	18,868.83
应付托管费	-	-	-	3,144.80	3,144.80

应付销售服务费	-	-	-	1,646.65	1,646.65
应付交易费用	-	-	-	103,460.81	103,460.81
其他负债	-	-	-	92,598.65	92,598.65
负债总计	-	-	-	343,117.65	343,117.65
利率敏感度缺口	5,352,794.05	-	-	8,979,257.15	14,332,051.20

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

于报告期末，本基金未持有交易性债券（上年末：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。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素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股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用数量化投资策略建立模型，采用自上而下的资产配置和而上的个股选择相结合的方式，切实贯彻数量化的投资策略，以保证在控制风险的前提下实现收益最大化。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占产的比例范围为 60% -95%。本基金每个交易日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值 5%，前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金资

		资产净 值比例 (%)		产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	15,582,424.80	94.75	9,317,530.00	65.01
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	15,582,424.80	94.75	9,317,530.00	65.01

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019年12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准增加5%	933,568.98	520,989.10
	业绩比较基准减少5%	-933,568.98	-520,989.10

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日，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中属于第一层次的余额为15,487,888.80元，属于第二层次的余额为94,536.00元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次9,108,227.00元，第二层次209,303.00元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	15,582,424.80	93.12
	其中：股票	15,582,424.80	93.12
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	1,045,861.30	6.25
8	其他各项资产	105,648.89	0.63
9	合计	16,733,934.99	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	265,721.00	1.62
B	采矿业	203,499.00	1.24
C	制造业	9,174,085.00	55.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	492,100.00	2.99
E	建筑业	208,620.00	1.27
F	批发和零售业	548,194.80	3.33
G	交通运输、仓储和邮政业	509,063.00	3.10
H	住宿和餐饮业	60,291.00	0.37
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,455,111.00	8.85
J	金融业	1,014,901.00	6.17
K	房地产业	756,946.00	4.60
L	租赁和商务服务业	62,122.00	0.38
M	科学研究和技术服务业	-	-



N	水利、环境和公共设施管理业	126,628.00	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	134,978.00	0.82
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	570,165.00	3.47
S	综合	-	-
	合计	15,582,424.80	94.75

### 8.2.2 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。

### 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

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	占基金资产净值比例（%）
1	600872	中炬高新	6,300	247,905.00	1.51
2	002821	凯莱英	1,900	246,050.00	1.50
3	002223	鱼跃医疗	11,800	239,776.00	1.46
4	002916	深南电路	1,600	227,360.00	1.38
5	000402	金融街	27,600	224,112.00	1.36
6	300251	光线传媒	18,300	215,940.00	1.31
7	600664	哈药股份	56,200	212,998.00	1.30
8	600717	天津港	33,400	209,752.00	1.28
9	600584	长电科技	9,200	202,216.00	1.23
10	300750	宁德时代	1,900	202,160.00	1.23
11	300002	神州泰岳	61,900	201,794.00	1.23
12	002153	石基信息	5,100	198,900.00	1.21
12	002672	东江环保	22,100	198,900.00	1.21
13	300724	捷佳伟创	5,200	197,028.00	1.20
14	601811	新华文轩	14,700	193,893.00	1.18
15	600720	祁连山	15,400	193,270.00	1.18
16	600061	国投资本	12,700	192,278.00	1.17
17	002736	国信证券	15,300	192,015.00	1.17
18	300394	天孚通信	5,000	191,300.00	1.16
19	300326	凯利泰	14,100	191,055.00	1.16
20	601216	君正集团	60,600	189,678.00	1.15
21	601618	中国中冶	67,100	187,880.00	1.14
22	300682	朗新科技	8,300	187,829.00	1.14
23	000966	长源电力	40,200	186,930.00	1.14

24	603639	海利尔	7,500	186,825.00	1.14
25	600019	宝钢股份	32,400	185,976.00	1.13
26	000697	炼石航空	17,500	185,500.00	1.13
26	600007	中国国贸	10,600	185,500.00	1.13
27	603737	三棵树	2,300	185,495.00	1.13
28	600723	首商股份	30,300	185,436.00	1.13
29	002202	金风科技	15,500	185,225.00	1.13
30	300305	裕兴股份	22,000	184,800.00	1.12
31	601998	中信银行	29,900	184,483.00	1.12
32	002123	梦网集团	9,600	183,648.00	1.12
33	300628	亿联网络	2,500	181,025.00	1.10
34	300433	蓝思科技	13,000	179,660.00	1.09
35	002611	东方精工	42,000	178,500.00	1.09
36	600183	生益科技	8,500	177,820.00	1.08
37	600468	百利电气	46,300	171,310.00	1.04
38	600845	宝信软件	5,200	171,080.00	1.04
39	600018	上港集团	29,500	170,215.00	1.04
40	603898	好莱客	10,400	169,936.00	1.03
41	000709	河钢股份	65,600	169,248.00	1.03
42	002533	金杯电工	33,700	169,174.00	1.03
43	300498	温氏股份	4,800	161,280.00	0.98
44	000681	视觉中国	9,300	160,332.00	0.97
45	600688	上海石化	41,200	159,444.00	0.97
46	600741	华域汽车	6,000	155,940.00	0.95
47	601211	国泰君安	8,400	155,316.00	0.94
48	600888	新疆众和	33,700	154,683.00	0.94
49	600546	山煤国际	21,000	146,580.00	0.89
50	002241	歌尔股份	6,900	137,448.00	0.84
51	601139	深圳燃气	17,400	136,242.00	0.83
52	000661	长春高新	300	134,100.00	0.82
53	600562	国睿科技	9,200	131,928.00	0.80
54	002913	奥士康	2,200	130,218.00	0.79
55	002204	大连重工	40,500	130,005.00	0.79
56	000919	金陵药业	17,400	127,020.00	0.77
57	603160	汇顶科技	600	123,780.00	0.75
58	600510	黑牡丹	17,700	118,590.00	0.72
59	002869	金溢科技	1,800	117,594.00	0.72
60	300613	富瀚微	700	113,526.00	0.69
61	000540	中天金融	33,100	110,223.00	0.67

62	603399	吉翔股份	8,000	108,000.00	0.66
63	002511	中顺洁柔	8,500	107,610.00	0.65
64	600578	京能电力	34,400	107,328.00	0.65
65	603519	立霸股份	7,500	105,075.00	0.64
66	000998	隆平高科	7,100	104,441.00	0.64
67	600837	海通证券	6,700	103,582.00	0.63
68	002308	威创股份	22,200	102,564.00	0.62
69	002008	大族激光	2,500	100,000.00	0.61
70	601600	中国铝业	27,200	96,288.00	0.59
71	603799	华友钴业	2,400	94,536.00	0.57
72	600406	国电南瑞	4,400	93,192.00	0.57
73	000895	双汇发展	3,200	92,896.00	0.56
74	601857	中国石油	15,700	91,531.00	0.56
75	300454	深信服	800	91,512.00	0.56
76	603111	康尼机电	17,300	91,344.00	0.56
77	600737	中粮糖业	10,600	89,676.00	0.55
78	601005	重庆钢铁	46,600	86,210.00	0.52
79	000626	远大控股	11,200	84,224.00	0.51
80	002737	葵花药业	5,600	82,656.00	0.50
81	600643	爱建集团	8,300	79,680.00	0.48
82	600811	东方集团	22,900	76,944.00	0.47
83	300449	汉邦高科	7,000	72,100.00	0.44
84	600990	四创电子	1,600	71,328.00	0.43
85	600050	中国联通	12,100	71,269.00	0.43
86	002607	中公教育	3,900	69,732.00	0.42
87	002287	奇正藏药	3,100	67,487.00	0.41
88	603885	吉祥航空	4,400	66,000.00	0.40
89	600661	昂立教育	3,800	65,246.00	0.40
90	002367	康力电梯	8,100	64,395.00	0.39
91	601969	海南矿业	10,900	63,111.00	0.38
92	601518	吉林高速	23,900	63,096.00	0.38
93	002010	传化智联	8,900	62,122.00	0.38
94	601158	重庆水务	11,000	61,600.00	0.37
95	603818	曲美家居	7,300	61,028.00	0.37
96	000725	京东方A	13,400	60,836.00	0.37
97	300197	铁汉生态	19,800	60,588.00	0.37
98	600754	锦江酒店	2,100	60,291.00	0.37
99	603045	福达合金	4,000	60,000.00	0.36
100	000667	美好置业	21,700	59,241.00	0.36

101	002415	海康威视	1,800	58,932.00	0.36
102	600779	水井坊	1,100	56,925.00	0.35
103	600718	东软集团	5,000	56,750.00	0.35
104	000550	江铃汽车	3,900	53,820.00	0.33
105	603708	家家悦	2,200	53,548.00	0.33
106	000615	京汉股份	11,000	48,730.00	0.30
107	300543	朗科智能	2,100	48,699.00	0.30
108	300037	新宙邦	1,300	47,242.00	0.29
109	601636	旗滨集团	8,400	46,116.00	0.28
110	601633	长城汽车	5,100	45,135.00	0.27
111	000810	创维数字	3,600	43,164.00	0.26
112	002705	新宝股份	2,600	42,874.00	0.26
113	603518	锦泓集团	5,800	41,006.00	0.25
114	002641	永高股份	8,200	38,294.00	0.23
115	000408	藏格控股	5,100	37,638.00	0.23
116	000333	美的集团	600	34,950.00	0.21
117	601339	百隆东方	8,700	34,713.00	0.21
118	002159	三特索道	2,800	34,468.00	0.21
119	600958	东方证券	3,100	33,356.00	0.20
120	600323	瀚蓝环境	1,800	31,572.00	0.19
121	002382	蓝帆医疗	2,600	31,564.00	0.19
122	603993	洛阳钼业	7,100	30,956.00	0.19
123	002669	康达新材	2,300	30,498.00	0.19
124	000617	中油资本	2,500	30,425.00	0.19
125	601009	南京银行	3,400	29,818.00	0.18
126	002365	永安药业	3,000	29,580.00	0.18
127	002908	德生科技	2,300	29,532.00	0.18
128	300128	锦富技术	7,000	28,140.00	0.17
129	600570	恒生电子	300	23,319.00	0.14
130	000541	佛山照明	4,700	23,030.00	0.14
131	300571	平治信息	400	21,952.00	0.13
132	002431	棕榈股份	6,800	20,740.00	0.13
133	601899	紫金矿业	3,900	17,901.00	0.11
134	601628	中国人寿	400	13,948.00	0.08
135	300281	金明精机	2,100	12,642.00	0.08
136	000961	中南建设	1,000	10,550.00	0.06
137	300523	辰安科技	200	8,972.00	0.05
138	600165	新日恒力	2,000	7,740.00	0.05
139	002531	天顺风能	900	5,688.00	0.03

140	600038	中直股份	100	4,771.00	0.03
141	002812	恩捷股份	90	4,545.00	0.03
142	600804	鹏博士	300	1,836.00	0.01
143	000963	华东医药	60	1,462.80	0.01

## 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	600637	东方明珠	1,348,838.80	9.41
2	600519	贵州茅台	1,108,011.00	7.73
3	002475	立讯精密	1,093,012.00	7.63
4	603939	益丰药房	1,081,102.00	7.54
5	603039	泛微网络	956,064.52	6.67
6	600019	宝钢股份	954,774.00	6.66
7	600585	海螺水泥	943,479.00	6.58
8	600699	均胜电子	923,864.00	6.45
9	601928	凤凰传媒	890,555.00	6.21
10	002202	金风科技	879,096.00	6.13
11	600999	招商证券	875,371.00	6.11
12	600038	中直股份	873,695.56	6.10
13	600795	国电电力	873,574.00	6.10
14	002470	金正大	868,622.00	6.06
15	601958	金钼股份	864,639.00	6.03
16	600183	生益科技	861,024.00	6.01
17	600219	南山铝业	847,702.00	5.91
18	000895	双汇发展	846,392.00	5.91
19	601005	重庆钢铁	834,348.00	5.82
20	600376	首开股份	833,421.00	5.82
21	601088	中国神华	821,692.00	5.73
22	002624	完美世界	800,297.00	5.58
23	002916	深南电路	764,191.27	5.33
24	600048	保利地产	751,563.00	5.24
25	000709	河钢股份	741,986.00	5.18
26	601607	上海医药	739,201.00	5.16

27	600276	恒瑞医药	733,150.00	5.12
28	600582	天地科技	732,634.00	5.11
29	603979	金诚信	731,971.12	5.11
30	002410	广联达	722,986.00	5.04
31	300002	神州泰岳	722,065.00	5.04
32	600606	绿地控股	721,343.00	5.03
33	002419	天虹股份	715,683.00	4.99
34	002299	圣农发展	715,385.00	4.99
35	002773	康弘药业	713,853.00	4.98
36	600837	海通证券	700,645.00	4.89
37	002180	纳思达	700,138.00	4.89
38	600373	中文传媒	697,433.00	4.87
39	002511	中顺洁柔	693,286.00	4.84
40	300498	温氏股份	690,149.00	4.82
41	000725	京东方A	687,165.00	4.79
42	002365	永安药业	685,224.00	4.78
43	600018	上港集团	684,795.00	4.78
44	300183	东软载波	680,843.00	4.75
45	600011	华能国际	678,197.00	4.73
46	600845	宝信软件	677,535.00	4.73
47	000401	冀东水泥	676,562.00	4.72
48	601222	林洋能源	676,036.00	4.72
49	000063	中兴通讯	667,412.00	4.66
50	600881	亚泰集团	659,398.00	4.60
51	002241	歌尔股份	658,967.00	4.60
52	300037	新宙邦	657,999.00	4.59
53	300363	博腾股份	654,842.50	4.57
54	600030	中信证券	654,547.00	4.57
55	600811	东方集团	653,359.00	4.56
56	002812	恩捷股份	652,029.00	4.55
57	601211	国泰君安	642,643.00	4.48
58	002092	中泰化学	642,416.00	4.48
59	601100	恒立液压	638,037.00	4.45
60	002010	传化智联	637,319.00	4.45
61	600885	宏发股份	636,848.20	4.44
62	002555	三七互娱	629,548.00	4.39

63	000661	长春高新	627,601.00	4.38
64	000898	鞍钢股份	614,745.00	4.29
65	000961	中南建设	614,530.00	4.29
66	601618	中国中冶	612,105.00	4.27
67	300750	宁德时代	593,066.00	4.14
68	600990	四创电子	591,807.00	4.13
69	000028	国药一致	591,102.00	4.12
70	000402	金融街	587,759.00	4.10
71	601857	中国石油	584,034.00	4.08
72	600383	金地集团	578,256.00	4.03
73	300511	雪榕生物	574,348.00	4.01
74	002153	石基信息	573,145.00	4.00
75	603160	汇顶科技	570,602.00	3.98
76	601985	中国核电	568,796.00	3.97
77	600299	安迪苏	564,450.00	3.94
78	601000	唐山港	563,818.00	3.93
79	600028	中国石化	562,151.00	3.92
80	600622	光大嘉宝	558,259.00	3.90
81	000046	泛海控股	549,473.00	3.83
82	600623	华谊集团	549,026.00	3.83
83	000759	中百集团	548,930.00	3.83
84	300662	科锐国际	548,784.00	3.83
85	600741	华域汽车	547,953.00	3.82
86	601818	光大银行	546,348.00	3.81
87	002531	天顺风能	544,150.00	3.80
88	603806	福斯特	543,192.00	3.79
89	000966	长源电力	540,872.00	3.77
90	600510	黑牡丹	538,982.00	3.76
91	002252	上海莱士	535,307.00	3.74
92	300408	三环集团	535,230.00	3.73
93	002517	恺英网络	533,661.50	3.72
94	600958	东方证券	532,213.00	3.71
95	601216	君正集团	531,604.00	3.71
96	600267	海正药业	531,375.00	3.71
97	002244	滨江集团	527,267.00	3.68
98	600022	山东钢铁	524,261.00	3.66

99	600985	淮北矿业	522,108.00	3.64
100	300003	乐普医疗	519,769.00	3.63
101	601800	中国交建	518,637.00	3.62
102	300628	亿联网络	517,783.00	3.61
103	601998	中信银行	513,655.00	3.58
104	600893	航发动力	503,599.00	3.51
105	001896	豫能控股	502,675.74	3.51
106	600743	华远地产	496,195.00	3.46
107	002048	宁波华翔	496,182.32	3.46
108	300042	朗科科技	493,545.82	3.44
109	000540	中天金融	493,347.00	3.44
110	300058	蓝色光标	492,415.00	3.44
111	600694	大商股份	491,933.00	3.43
112	601012	隆基股份	484,807.00	3.38
113	002422	科伦药业	482,324.00	3.37
114	002332	仙琚制药	478,668.00	3.34
115	601600	中国铝业	476,742.00	3.33
116	000626	远大控股	474,650.00	3.31
117	000999	华润三九	474,251.00	3.31
118	000998	隆平高科	473,826.00	3.31
119	300335	迪森股份	472,871.00	3.30
120	300033	同花顺	472,775.00	3.30
121	600820	隧道股份	471,845.00	3.29
122	601098	中南传媒	467,837.00	3.26
123	601898	中煤能源	467,737.68	3.26
124	300209	天泽信息	459,807.00	3.21
125	002738	中矿资源	458,811.00	3.20
126	000656	金科股份	457,955.00	3.20
127	002250	联化科技	456,956.00	3.19
128	600433	冠豪高新	455,250.00	3.18
129	300282	三盛教育	449,028.00	3.13
130	600361	华联综超	447,973.00	3.13
131	000568	泸州老窖	447,899.00	3.13
132	600537	亿晶光电	445,310.00	3.11
133	600872	中炬高新	445,181.93	3.11
134	600036	招商银行	442,917.00	3.09



135	000858	五 粮 液	439,389.00	3.07
136	300394	天孚通信	438,181.00	3.06
137	601231	环旭电子	429,028.00	2.99
138	002441	众业达	428,525.80	2.99
139	601919	中远海控	427,180.00	2.98
140	002417	深南股份	425,033.00	2.97
141	600600	青岛啤酒	424,674.00	2.96
142	600888	新疆众和	424,143.00	2.96
143	600823	世茂股份	423,106.00	2.95
144	603993	洛阳钼业	421,775.00	2.94
145	300203	聚光科技	420,760.00	2.94
146	600887	伊利股份	419,603.00	2.93
147	600016	民生银行	417,636.00	2.91
148	601668	中国建筑	415,815.00	2.90
149	000019	深粮控股	414,463.60	2.89
150	000636	风华高科	414,119.00	2.89
151	603096	新经典	413,308.00	2.88
152	000166	申万宏源	411,335.00	2.87
153	000959	首钢股份	410,495.00	2.86
154	300014	亿纬锂能	410,357.00	2.86
155	603856	东宏股份	408,587.05	2.85
156	300158	振东制药	408,432.00	2.85
157	601766	中国中车	407,901.00	2.85
158	000876	新 希 望	406,933.00	2.84
159	300275	梅安森	406,346.00	2.84
160	600570	恒生电子	405,330.10	2.83
161	002573	清新环境	404,780.00	2.82
162	002146	荣盛发展	404,720.00	2.82
163	300084	海默科技	402,544.00	2.81
164	300338	开元股份	401,246.00	2.80
165	300087	荃银高科	400,981.74	2.80
166	603399	吉翔股份	400,906.00	2.80
167	600438	通威股份	400,041.00	2.79
168	601933	永辉超市	400,025.00	2.79
169	002314	南山控股	399,050.00	2.78
170	600027	华电国际	398,629.00	2.78

171	601899	紫金矿业	397,946.00	2.78
172	002415	海康威视	397,818.53	2.78
173	600388	龙净环保	397,322.00	2.77
174	000733	振华科技	396,522.00	2.77
175	600211	西藏药业	394,432.00	2.75
176	600273	嘉化能源	392,578.00	2.74
177	300251	光线传媒	391,834.00	2.73
178	000892	欢瑞世纪	391,324.00	2.73
179	300709	精研科技	391,226.00	2.73
180	603496	恒为科技	390,601.00	2.73
181	002044	美年健康	389,877.00	2.72
182	002672	东江环保	389,657.00	2.72
183	002344	海宁皮城	389,304.00	2.72
184	300447	全信股份	388,929.00	2.71
185	002308	威创股份	388,000.00	2.71
186	600529	山东药玻	387,770.00	2.71
187	603678	火炬电子	387,334.00	2.70
188	000513	丽珠集团	386,247.00	2.69
189	000573	粤宏远 A	386,060.00	2.69
190	002912	中新赛克	385,937.00	2.69
191	300690	双一科技	385,842.00	2.69
192	603630	拉芳家化	385,558.00	2.69
193	300326	凯利泰	384,958.00	2.69
194	000036	华联控股	384,554.00	2.68
195	600521	华海药业	384,374.00	2.68
196	002399	海普瑞	382,782.20	2.67
197	300454	深信服	382,116.00	2.67
198	600737	中粮糖业	382,017.00	2.67
199	600562	国睿科技	381,770.00	2.66
200	600066	宇通客车	381,763.00	2.66
201	002454	松芝股份	381,749.00	2.66
202	603737	三棵树	380,210.00	2.65
203	300380	安硕信息	379,728.00	2.65
204	002234	民和股份	379,455.00	2.65
205	603029	天鹅股份	378,866.00	2.64
206	603421	鼎信通讯	378,425.00	2.64

207	300624	万兴科技	377,936.00	2.64
208	000061	农产品	376,442.00	2.63
209	600292	远达环保	375,120.00	2.62
210	002621	美吉姆	374,814.00	2.62
211	000049	德赛电池	374,315.00	2.61
212	600717	天津港	373,968.00	2.61
213	600100	同方股份	373,558.00	2.61
214	002577	雷柏科技	373,308.35	2.60
215	601369	陕鼓动力	371,756.77	2.59
216	000550	江铃汽车	371,704.00	2.59
217	002053	云南能投	370,656.00	2.59
218	000411	英特集团	370,104.00	2.58
219	000686	东北证券	369,858.00	2.58
220	002698	博实股份	369,662.00	2.58
221	600584	长电科技	369,537.00	2.58
222	300543	朗科智能	369,485.00	2.58
223	600008	首创股份	369,214.00	2.58
224	603801	志邦家居	367,786.00	2.57
225	601866	中远海发	367,124.00	2.56
226	600180	瑞茂通	365,138.00	2.55
227	600566	济川药业	364,279.00	2.54
228	603659	璞泰来	363,936.00	2.54
229	300190	维尔利	363,020.00	2.53
230	002626	金达威	362,992.00	2.53
231	603900	莱绅通灵	362,558.00	2.53
232	002204	大连重工	362,349.00	2.53
233	601872	招商轮船	361,498.00	2.52
234	002182	云海金属	361,492.00	2.52
235	002739	万达电影	361,366.50	2.52
236	600809	山西汾酒	360,924.00	2.52
237	300010	立思辰	359,351.00	2.51
238	300055	万邦达	358,186.00	2.50
239	601169	北京银行	357,920.00	2.50
240	601811	新华文轩	356,775.00	2.49
241	300433	蓝思科技	356,337.00	2.49
242	600420	现代制药	355,714.00	2.48

243	600673	东阳光	355,521.00	2.48
244	600580	卧龙电驱	355,256.00	2.48
245	600248	延长化建	354,690.00	2.47
246	002322	理工环科	353,578.00	2.47
247	000729	燕京啤酒	351,941.00	2.46
248	000034	神州数码	351,833.00	2.45
249	600239	云南城投	351,388.00	2.45
250	002049	紫光国微	350,527.05	2.45
251	300719	安达维尔	350,345.00	2.44
252	300533	冰川网络	349,902.00	2.44
253	002304	洋河股份	347,880.00	2.43
254	600824	益民集团	347,117.00	2.42
255	002195	二三四五	346,883.00	2.42
256	000031	大悦城	346,288.00	2.42
257	002311	海大集团	345,801.00	2.41
258	601158	重庆水务	344,777.00	2.41
259	002409	雅克科技	342,871.00	2.39
260	000400	许继电气	341,258.00	2.38
261	601717	郑煤机	340,643.00	2.38
262	300012	华测检测	340,626.00	2.38
263	002913	奥士康	340,509.00	2.38
264	601669	中国电建	339,043.00	2.37
265	300130	新国都	337,601.40	2.36
266	600089	特变电工	336,643.00	2.35
267	300461	田中精机	336,456.00	2.35
268	601688	华泰证券	335,320.00	2.34
269	002405	四维图新	334,223.00	2.33
270	002433	太安堂	334,085.00	2.33
271	002518	科士达	334,057.00	2.33
272	000501	鄂武商A	332,380.00	2.32
273	600302	标准股份	331,253.00	2.31
274	600060	海信视像	331,110.00	2.31
275	600862	中航高科	330,921.00	2.31
276	600271	航天信息	329,083.00	2.30
277	000488	晨鸣纸业	329,060.00	2.30
278	300089	文化长城	328,605.00	2.29

279	002316	亚联发展	326,354.00	2.28
280	601588	北辰实业	324,704.00	2.27
281	002714	牧原股份	324,164.00	2.26
282	601633	长城汽车	324,164.00	2.26
283	600406	国电南瑞	323,538.00	2.26
284	603825	华扬联众	319,411.00	2.23
285	002869	金溢科技	318,609.00	2.22
286	601018	宁波港	318,378.00	2.22
287	600200	江苏吴中	318,197.00	2.22
288	600335	国机汽车	317,932.00	2.22
289	300608	思特奇	317,853.20	2.22
290	000701	厦门信达	317,524.00	2.22
291	002090	金智科技	316,724.00	2.21
292	600967	内蒙一机	316,398.00	2.21
293	300378	鼎捷软件	315,967.00	2.20
294	600258	首旅酒店	315,829.00	2.20
295	300682	朗新科技	315,181.00	2.20
296	600208	新湖中宝	314,199.00	2.19
297	000938	紫光股份	313,569.00	2.19
298	603636	南威软件	311,001.00	2.17
299	300661	圣邦股份	310,420.00	2.17
300	001979	招商蛇口	309,944.00	2.16
301	300305	裕兴股份	307,853.00	2.15
302	002376	新北洋	305,971.00	2.13
303	600153	建发股份	305,826.00	2.13
304	600707	彩虹股份	305,118.00	2.13
305	000908	景峰医药	301,721.00	2.11
306	600143	金发科技	299,006.00	2.09
307	002414	高德红外	297,468.00	2.08
308	002737	葵花药业	295,748.00	2.06
309	601390	中国中铁	295,742.00	2.06
310	603208	江山欧派	294,997.25	2.06
311	603589	口子窖	292,664.00	2.04
312	300232	洲明科技	292,194.00	2.04
313	600023	浙能电力	288,269.00	2.01

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	600519	贵州茅台	1,346,276.00	9.39
2	600637	东方明珠	1,311,605.76	9.15
3	002475	立讯精密	1,243,825.90	8.68
4	600585	海螺水泥	1,112,522.00	7.76
5	603939	益丰药房	1,084,790.00	7.57
6	603039	泛微网络	1,049,710.68	7.32
7	300750	宁德时代	1,033,572.00	7.21
8	600999	招商证券	941,637.00	6.57
9	600699	均胜电子	932,400.20	6.51
10	600048	保利地产	930,949.00	6.50
11	600030	中信证券	910,449.00	6.35
12	601928	凤凰传媒	900,153.00	6.28
13	600038	中直股份	878,461.00	6.13
14	000063	中兴通讯	871,086.00	6.08
15	600219	南山铝业	870,536.00	6.07
16	600795	国电电力	868,872.00	6.06
17	601088	中国神华	850,383.00	5.93
18	601958	金钼股份	848,878.00	5.92
19	600276	恒瑞医药	835,128.00	5.83
20	002624	完美世界	805,380.04	5.62
21	000895	双汇发展	788,673.00	5.50
22	002773	康弘药业	778,097.50	5.43
23	600036	招商银行	770,192.90	5.37
24	002470	金正大	766,591.00	5.35
25	002202	金风科技	761,145.47	5.31
26	600376	首开股份	760,005.00	5.30
27	603979	金诚信	749,684.80	5.23
28	002419	天虹股份	746,371.00	5.21
29	601005	重庆钢铁	744,001.00	5.19
30	600582	天地科技	741,134.00	5.17
31	601607	上海医药	740,328.48	5.17
32	300183	东软载波	738,950.00	5.16
33	601012	隆基股份	733,032.00	5.11
34	002299	圣农发展	729,671.00	5.09

35	600019	宝钢股份	726,103.00	5.07
36	600373	中文传媒	724,144.00	5.05
37	600606	绿地控股	722,895.00	5.04
38	002555	三七互娱	716,451.00	5.00
39	002410	广联达	706,985.00	4.93
40	601222	林洋能源	706,813.00	4.93
41	002365	永安药业	696,595.00	4.86
42	600837	海通证券	696,590.00	4.86
43	000401	冀东水泥	694,975.00	4.85
44	600438	通威股份	691,980.00	4.83
45	002180	纳思达	690,907.00	4.82
46	002812	恩捷股份	690,453.00	4.82
47	600885	宏发股份	689,245.00	4.81
48	600183	生益科技	688,363.00	4.80
49	000661	长春高新	678,694.00	4.74
50	600011	华能国际	670,083.00	4.68
51	601100	恒立液压	669,315.61	4.67
52	300037	新宙邦	648,448.00	4.52
53	300363	博腾股份	645,035.00	4.50
54	601818	光大银行	639,215.00	4.46
55	601211	国泰君安	638,791.00	4.46
56	002594	比亚迪	637,727.00	4.45
57	000028	国药一致	637,397.00	4.45
58	002092	中泰化学	627,764.00	4.38
59	000759	中百集团	625,067.00	4.36
60	002916	深南电路	617,945.00	4.31
61	000898	鞍钢股份	615,705.00	4.30
62	600299	安迪苏	609,816.00	4.25
63	002511	中顺洁柔	608,562.00	4.25
64	600028	中国石化	606,181.00	4.23
65	000961	中南建设	602,476.00	4.20
66	600881	亚泰集团	593,322.12	4.14
67	000725	京东方 A	589,193.00	4.11
68	000709	河钢股份	580,880.00	4.05
69	600622	光大嘉宝	578,984.00	4.04
70	002010	传化智联	575,604.00	4.02
71	600383	金地集团	574,656.00	4.01
72	000636	风华高科	572,598.00	4.00

73	002241	歌尔股份	571,368.00	3.99
74	002517	恺英网络	567,592.00	3.96
75	600016	民生银行	566,680.00	3.95
76	603806	福斯特	565,788.00	3.95
77	601766	中国中车	565,677.00	3.95
78	300002	神州泰岳	563,324.00	3.93
79	002244	滨江集团	561,029.00	3.91
80	300662	科锐国际	559,316.00	3.90
81	601985	中国核电	558,952.00	3.90
82	603160	汇顶科技	558,087.00	3.89
83	300408	三环集团	556,535.00	3.88
84	601668	中国建筑	555,952.00	3.88
85	000046	泛海控股	555,330.66	3.87
86	601000	唐山港	550,401.00	3.84
87	600022	山东钢铁	549,495.00	3.83
88	300511	雪榕生物	544,117.00	3.80
89	300014	亿纬锂能	542,957.00	3.79
90	600811	东方集团	541,244.00	3.78
91	300203	聚光科技	539,955.00	3.77
92	601800	中国交建	539,835.00	3.77
93	002714	牧原股份	539,434.00	3.76
94	600887	伊利股份	534,942.00	3.73
95	600018	上港集团	532,794.00	3.72
96	002252	上海莱士	532,500.00	3.72
97	300042	朗科科技	530,808.00	3.70
98	600623	华谊集团	529,450.00	3.69
99	300003	乐普医疗	528,047.79	3.68
100	000568	泸州老窖	527,779.51	3.68
101	600845	宝信软件	527,594.00	3.68
102	002399	海普瑞	527,506.80	3.68
103	001896	豫能控股	524,724.68	3.66
104	000858	五粮液	518,058.00	3.61
105	300033	同花顺	516,221.00	3.60
106	600893	航发动力	515,673.00	3.60
107	601872	招商轮船	515,037.00	3.59
108	600741	华域汽车	512,857.00	3.58
109	601898	中煤能源	508,676.60	3.55
110	300209	天泽信息	505,896.80	3.53



111	000999	华润三九	502,868.00	3.51
112	002738	中矿资源	501,982.00	3.50
113	600267	海正药业	500,180.00	3.49
114	002531	天顺风能	499,081.00	3.48
115	300498	温氏股份	498,074.00	3.48
116	600958	东方证券	496,570.00	3.46
117	600743	华远地产	495,931.00	3.46
118	600990	四创电子	492,069.15	3.43
119	002250	联化科技	491,680.00	3.43
120	600694	大商股份	485,986.00	3.39
121	600985	淮北矿业	481,148.00	3.36
122	300335	迪森股份	479,448.00	3.35
123	002048	宁波华翔	477,804.00	3.33
124	000656	金科股份	477,099.00	3.33
125	601857	中国石油	475,677.00	3.32
126	601098	中南传媒	469,369.00	3.27
127	600433	冠豪高新	468,709.00	3.27
128	002422	科伦药业	466,979.00	3.26
129	002415	海康威视	464,416.00	3.24
130	600820	隧道股份	462,636.00	3.23
131	002332	仙琚制药	461,132.00	3.22
132	600510	黑牡丹	456,358.00	3.18
133	300058	蓝色光标	455,571.00	3.18
134	600361	华联综超	454,114.00	3.17
135	300709	精研科技	453,999.00	3.17
136	002573	清新环境	453,809.00	3.17
137	603659	璞泰来	451,057.00	3.15
138	001979	招商蛇口	449,543.00	3.14
139	000876	新希望	449,190.00	3.13
140	601618	中国中冶	449,100.00	3.13
141	300282	三盛教育	447,691.00	3.12
142	600027	华电国际	446,491.00	3.12
143	600600	青岛啤酒	436,769.00	3.05
144	601231	环旭电子	436,538.00	3.05
145	000166	申万宏源	434,407.30	3.03
146	600823	世茂股份	433,922.00	3.03
147	600537	亿晶光电	429,178.00	2.99
148	600529	山东药玻	428,936.00	2.99

149	000049	德赛电池	428,291.00	2.99
150	603993	洛阳钼业	425,104.00	2.97
151	603496	恒为科技	422,458.53	2.95
152	601169	北京银行	421,392.00	2.94
153	000959	首钢股份	420,252.00	2.93
154	002153	石基信息	419,123.00	2.92
155	002304	洋河股份	418,270.00	2.92
156	300158	振东制药	418,170.00	2.92
157	000036	华联控股	416,622.70	2.91
158	601919	中远海控	416,488.00	2.91
159	601688	华泰证券	415,786.00	2.90
160	000411	英特集团	415,447.00	2.90
161	000626	远大控股	414,713.00	2.89
162	002417	深南股份	414,670.97	2.89
163	300628	亿联网络	414,494.00	2.89
164	002441	众业达	413,878.70	2.89
165	603421	鼎信通讯	413,858.00	2.89
166	000019	深粮控股	413,466.00	2.88
167	002314	南山控股	410,762.00	2.87
168	600239	云南城投	410,284.00	2.86
169	002698	博实股份	410,117.00	2.86
170	300338	开元股份	409,300.00	2.86
171	300447	全信股份	408,932.00	2.85
172	000733	振华科技	408,022.00	2.85
173	000513	丽珠集团	406,707.00	2.84
174	300084	海默科技	405,295.00	2.83
175	603096	新经典	405,266.85	2.83
176	000998	隆平高科	404,903.00	2.83
177	300274	阳光电源	404,706.00	2.82
178	002739	万达电影	402,527.00	2.81
179	603678	火炬电子	402,076.00	2.81
180	600566	济川药业	401,838.00	2.80
181	300087	荃银高科	401,342.29	2.80
182	300275	梅安森	400,813.00	2.80
183	002049	紫光国微	400,660.00	2.80
184	600273	嘉化能源	400,431.00	2.79
185	002912	中新赛克	398,831.00	2.78
186	601866	中远海发	398,536.00	2.78

187	600570	恒生电子	398,387.00	2.78
188	300624	万兴科技	396,875.00	2.77
189	601600	中国铝业	394,716.00	2.75
190	002146	荣盛发展	393,436.00	2.75
191	000729	燕京啤酒	392,124.00	2.74
192	603630	拉芳家化	392,075.00	2.74
193	002344	海宁皮城	391,655.00	2.73
194	600211	西藏药业	391,212.00	2.73
195	002044	美年健康	391,135.00	2.73
196	600100	同方股份	389,528.00	2.72
197	600292	远达环保	389,090.30	2.71
198	603856	东宏股份	388,422.00	2.71
199	300719	安达维尔	387,665.00	2.70
200	603900	莱绅通灵	386,942.00	2.70
201	002182	云海金属	383,626.00	2.68
202	603801	志邦家居	382,791.00	2.67
203	601369	陕鼓动力	382,519.00	2.67
204	000061	农产品	379,969.00	2.65
205	002626	金达威	379,569.00	2.65
206	600521	华海药业	379,560.00	2.65
207	002053	云南能投	378,818.00	2.64
208	601899	紫金矿业	378,682.00	2.64
209	601933	永辉超市	378,556.00	2.64
210	002621	美吉姆	378,138.50	2.64
211	600809	山西汾酒	376,410.00	2.63
212	002311	海大集团	376,336.00	2.63
213	600066	宇通客车	375,755.00	2.62
214	600388	龙净环保	373,789.00	2.61
215	000031	大悦城	371,732.00	2.59
216	600824	益民集团	371,097.00	2.59
217	300661	圣邦股份	371,001.00	2.59
218	002322	理工环科	369,233.00	2.58
219	600580	卧龙电驱	369,062.00	2.58
220	300690	双一科技	366,934.00	2.56
221	000540	中天金融	366,732.00	2.56
222	600258	首旅酒店	366,642.00	2.56
223	000402	金融街	366,452.00	2.56
224	600060	海信视像	366,024.00	2.55

225	600420	现代制药	365,962.00	2.55
226	002234	民和股份	365,867.00	2.55
227	603029	天鹅股份	365,312.00	2.55
228	300380	安硕信息	364,578.00	2.54
229	300190	维尔利	363,653.00	2.54
230	000686	东北证券	363,040.80	2.53
231	000573	粤宏远 A	362,753.00	2.53
232	002409	雅克科技	362,097.00	2.53
233	002648	卫星石化	361,667.57	2.52
234	300089	文化长城	361,177.00	2.52
235	000892	欢瑞世纪	360,416.00	2.51
236	002433	太安堂	360,259.00	2.51
237	300533	冰川网络	358,517.00	2.50
238	600302	标准股份	357,150.70	2.49
239	300012	华测检测	355,132.00	2.48
240	000966	长源电力	355,041.00	2.48
241	600180	瑞茂通	354,806.00	2.48
242	300055	万邦达	353,762.00	2.47
243	300130	新国都	353,186.00	2.46
244	002577	雷柏科技	352,051.12	2.46
245	600104	上汽集团	351,231.00	2.45
246	601588	北辰实业	350,006.00	2.44
247	600008	首创股份	348,690.00	2.43
248	000157	中联重科	348,302.00	2.43
249	600248	延长化建	346,309.00	2.42
250	600089	特变电工	345,837.00	2.41
251	601717	郑煤机	345,792.00	2.41
252	000908	景峰医药	345,494.00	2.41
253	601998	中信银行	343,875.00	2.40
254	002316	亚联发展	343,621.00	2.40
255	002454	松芝股份	342,704.00	2.39
256	600673	东阳光	341,289.00	2.38
257	002195	二三四五	341,160.30	2.38
258	600967	内蒙一机	339,781.00	2.37
259	603825	华扬联众	339,444.00	2.37
260	000501	鄂武商 A	336,212.00	2.35
261	002090	金智科技	335,886.90	2.34
262	002518	科士达	335,632.00	2.34

263	300202	聚龙股份	334,952.00	2.34
264	600707	彩虹股份	334,533.00	2.33
265	300608	思特奇	333,792.00	2.33
266	600862	中航高科	332,941.00	2.32
267	603636	南威软件	332,884.00	2.32
268	600271	航天信息	329,313.00	2.30
269	600335	国机汽车	328,531.00	2.29
270	600143	金发科技	324,909.00	2.27
271	000034	神州数码	323,939.00	2.26
272	601216	君正集团	323,215.00	2.26
273	000400	许继电气	320,969.00	2.24
274	601669	中国电建	320,854.00	2.24
275	000488	晨鸣纸业	319,333.09	2.23
276	000701	厦门信达	318,986.00	2.23
277	601877	正泰电器	318,625.00	2.22
278	002308	威创股份	316,258.00	2.21
279	002024	苏宁易购	315,846.00	2.20
280	000550	江铃汽车	313,740.00	2.19
281	600208	新湖中宝	311,615.00	2.17
282	300454	深信服	311,526.00	2.17
283	603399	吉翔股份	311,097.00	2.17
284	601018	宁波港	309,652.00	2.16
285	601633	长城汽车	309,279.00	2.16
286	002405	四维图新	308,168.00	2.15
287	300543	朗科智能	307,237.00	2.14
288	600737	中粮糖业	306,068.00	2.14
289	300378	鼎捷软件	305,384.00	2.13
290	000938	紫光股份	304,880.44	2.13
291	002414	高德红外	303,902.00	2.12
292	600031	三一重工	303,448.00	2.12
293	300461	田中精机	302,382.00	2.11
294	600068	葛洲坝	301,258.00	2.10
295	603859	能科股份	300,996.00	2.10
296	600200	江苏吴中	300,411.00	2.10
297	600153	建发股份	299,194.00	2.09
298	300010	立思辰	297,616.00	2.08
299	600888	新疆众和	296,994.00	2.07
300	601390	中国中铁	295,524.00	2.06

301	603589	口子窖	293,515.00	2.05
302	600884	杉杉股份	293,383.00	2.05
303	002376	新北洋	293,205.00	2.05
304	600704	物产中大	290,883.00	2.03
305	601158	重庆水务	289,217.00	2.02
306	603538	美诺华	288,487.00	2.01
307	600816	安信信托	288,428.00	2.01

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	251,388,178.34
卖出股票收入（成交）总额	250,487,041.04

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

本报告期末本基金未持有债券投资。

#### 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

本报告期末本基金未持有债券投资。

#### 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

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

##### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

基金本报告期末无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

中炬高新技术实业（集团）股份有限公司（以下简称“公司”）于 2019 年 4 月 22 日收到《于对中炬高新技术实业（集团）股份有限公司及时任董事会秘书彭海泓予以监管关注的决定》（以下简称“决定书”）（上证公监函（2019）0035 号）。决定书指出，公司持有广东厨邦食品有限公司（以下简称厨邦公司）80%股权，曲水朗天慧德企业管理有限公司（以下简称朗天慧德）持有厨邦公司剩余 20%股权。厨邦公司是对上市公司具有重要影响的控股子公司，朗天慧德作为厨邦公司持股 10%以上的法人股东，为公司的关联方。2018 年 12 月 17 日，公司与关联方朗天慧德签署了《广东厨邦食品有限公司股权转让协议》（以下简称《协议》），约定公司以 3.4 亿元收购持有的厨邦公司剩余 20%股权。上述《协议》经双方当事人签字盖章，已依法成立。同时，《协议》约定待公司董事会批准后生效。本次交易构成关联交易，交易金额占公司最近一期经审计净资产的 10.82%，达到股东大会的审议标准。公司收购少数股东股权，达到了关联交易的披露标准，是对投资者决策具有重要影响的信息。但公司并未就上述关联交易事项及时履行信息披露义务，也未及时召开董事会、股东大会进行审议，直至 2019 年 3 月 5 日才召开董事会、3 月 20 日才召开股东大会审议批准上述收购子公司股权的《协议》，并进行相应信息披露。公司未及时披露关联交易事项，损害了投资者的知情权。上述行为违反了《上海证券交易所股票上市规则》（以下简称《股票上市规则》）第 2.1 条、第 2.3 条、第 7.3 条、第 10.2.5 条等相关规定。时任董事会秘书彭海泓作为公司信息披露事务的具体负责人，未能勤勉尽责，对公司的上述违规行为负有主要责任，违反了《股票上市规则》第 2.2 条、第 3.1.4 条、第 3.2.2 条的规定及其在《高级管理人员声明及承诺书》中做出的承诺。鉴于上述违规事实和情节，根据《股票上市规则》第 17.1 条和《上海证券交易所纪律处分和监管措施实施办法》的有关规定，上海证券交易所做出如下监管措施决定：对中炬高新技术实业（集团）股份有限公司和时任董事会秘书彭海泓予以监管关注。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项对公司的盈利情况暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。报告期内，本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

### 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	14,355.71
2	应收证券清算款	77,236.50
3	应收股利	-
4	应收利息	269.70
5	应收申购款	13,786.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	105,648.89

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

### 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

份额单位：份

份额级别	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
平安量化先锋混合 A	354	40,388.20	10,010,801.08	70.02%	4,286,621.93	29.98%
平安量化先锋混合 C	191	9,875.24	0.00	0.00%	1,886,171.30	100.00%
合计	532	30,420.29	10,010,801.08	61.86%	6,172,793.23	38.14%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对分级份额，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	平安量化先锋混合 A	167,106.61	1.1688%
	平安量化先锋混合 C	0.00	0.0000%
	合计	167,106.61	1.0326%

上述从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	平安量化先锋混合 A	0~10
	平安量化先锋混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	平安量化先锋混合 A	0~10
	平安量化先锋混合 C	0
	合计	0~10

#### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,010,801.08	61.86	10,010,801.08	61.86	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	84,205.68	0.52	84,205.68	0.52	3 年
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,095,006.76	62.38	10,095,006.76	62.38	3 年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安量化先锋混合 A	平安量化先锋混合 C
基金合同生效日（2017年11月1日）基金份额总额	18,761,106.70	22,271,680.51
本报告期期初基金份额总额	15,493,115.73	3,085,931.88
本报告期基金总申购份额	2,595,961.00	1,666,692.25
减:本报告期基金总赎回份额	3,791,653.72	2,866,452.83
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,297,423.01	1,886,171.30

## § 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

- 1、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。
- 2、经平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）2019 年第三次股东会议审议通过，由薛世峰先生接替李兆良先生任职公司的独立董事，任职日期为 2019 年 6 月 7 日。
- 3、2019 年 8 月 19 日，付强先生因工作调动，辞去平安基金管理有限公司副总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 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，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 38,000.00 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

本报告期内，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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	
安信证券	3	56,051,203.59	11.17%	39,868.94	11.12%	-
天风证券	2	47,206,082.32	9.41%	33,578.34	9.36%	-

东兴证券	2	46,108,016.56	9.19%	32,796.32	9.15%	-
中信建投	2	38,389,736.84	7.65%	27,306.44	7.61%	-
广州证券	2	38,350,144.02	7.64%	27,278.22	7.61%	-
西南证券	1	32,260,197.86	6.43%	22,946.34	6.40%	-
万联证券	4	29,196,460.36	5.82%	20,767.28	5.79%	-
兴业证券	1	22,956,050.73	4.57%	16,328.46	4.55%	-
渤海证券	1	22,819,736.39	4.55%	16,231.72	4.53%	-
国盛证券	2	18,877,201.88	3.76%	13,427.37	3.74%	新增
中信证券	3	18,381,519.17	3.66%	13,074.66	3.65%	-
国信证券	2	14,673,063.80	2.92%	10,436.82	2.91%	-
开源证券	2	12,329,100.77	2.46%	8,769.81	2.45%	-
上海证券	2	10,655,280.53	2.12%	7,579.04	2.11%	新增
华泰证券	2	10,367,275.31	2.07%	7,374.04	2.06%	-
光大证券	2	10,323,012.19	2.06%	7,343.18	2.05%	-
华创证券	2	10,191,416.93	2.03%	7,249.19	2.02%	-
中泰证券	1	9,799,160.10	1.95%	6,970.29	1.94%	-
海通证券	2	9,291,677.69	1.85%	6,609.15	1.84%	-
长江证券	1	8,694,299.64	1.73%	6,184.22	1.72%	-
东北证券	7	8,384,541.60	1.67%	5,963.76	1.66%	-
广发证券	2	8,289,296.80	1.65%	7,554.08	2.11%	-
申港证券	1	7,989,890.76	1.59%	5,683.21	1.58%	-
银河证券	2	4,335,069.42	0.86%	3,083.57	0.86%	-
平安证券	4	2,040,997.00	0.41%	1,451.81	0.40%	-
财通证券	2	1,129,156.00	0.23%	803.20	0.22%	-
川财证券	1	1,081,922.00	0.22%	769.52	0.21%	-
方正证券	2	947,583.52	0.19%	674.06	0.19%	-
东吴证券	2	705,749.60	0.14%	502.00	0.14%	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	新增
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

华宝证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	新增
申万宏源	2	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	退租
联讯证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	新增

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。

### 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
安信证券	-	-	3,800,000.00	35.19%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-

上海证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	7,000,000.00	64.81%	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-

## 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	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月3日
2	关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月17日
3	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月18日
4	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月12日
5	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月27日
6	关于旗下部分基金新增上海凯石财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月15日
7	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月26日
8	关于旗下部分基金新增国盛证券有限责任公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月3日
9	关于平安量化先锋混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月9日
10	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月9日
11	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月18日
12	关于旗下部分基金新增江苏汇林保大基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年5月10日
13	关于旗下部分基金新增上海陆享基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年5月14日
14	关于新增包商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年5月14日



15	关于旗下部分基金新增中信证券股份有限公司为销售机构及开通、定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年6月6日
16	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书更新（2019年第1期）以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年6月11日
17	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年6月18日
18	平安基金管理有限公司 2019年6月30日基金净值披露公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年6月30日
19	关于子公司深圳平安大华汇通财富管理有限公司名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年7月9日
20	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2019 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年7月15日
21	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增江苏银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年7月31日
22	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月20日
23	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月22日
24	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2019 年半年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月22日
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增西藏东方财富证券股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月26日
26	关于旗下部分基金新增中信证券（山东）有限责任公司为销售机构及开通、定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年8月27日
27	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书更新以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月15日

28	关于平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月15日
29	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金 2019 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月24日
30	关于旗下部分基金新增浦领基金销售有限公司为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年10月25日
31	关于平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月5日
32	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书更新以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月5日
33	关于旗下 12 只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订相关法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月27日
34	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书更新（摘要）	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月27日
35	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月27日
36	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月27日
37	平安量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月27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	2019/01/01--2019/12/31	10,010,801.08	0.00	0.00	10,010,801.08	61.86%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

为保护基金份额持有人的合法权益，以更科学、合理的业绩比较基准评估平安量化先锋混合型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”），经与托管行平安银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案后，根据《平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，决定自 2019 年 4 月 9 日起，本基金的业绩比较基准由“中证 500 指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%”修改为“中证 500 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%”。详细内容可阅读本公司于 2019 年 4 月 9 日发布的《关于平安量化先锋混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修改基金合同的公告》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准平安量化先锋混合型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金基金合同；
- 3、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金托管协议；
- 4、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在指定报刊以及指定网站上披露的各项公告。

### 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) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>

平安基金管理有限公司

2020 年 4 月 29 日