

平安股息精选沪港深股票型证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	44
8.3 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情况	44
§ 9 开放式基金份额变动	44
§ 10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	48
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金	
基金简称	平安股息精选沪港深股票	
基金主代码	004403	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 5 月 17 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	102,161,388.67 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安股息精选沪港深股票 A	平安股息精选沪港深股票 C
下属分级基金的交易代码	004403	004404
报告期末下属分级基金的份额总额	100,980,244.62 份	1,181,144.05 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要通过股息价值策略构建股票组合，在严格控制风险的前提下，力争获取超越业绩比较基准的收益，追求基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量、定性相结合的方法分析宏观经济、财政及货币政策、资金供需情况等因素综合分析以及对资本市场发展趋势的判断，在评价未来一段时间各类的预期风险收益率、相关性的基础上，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，并将重点关注债券资产的收益率。此外，本基金将持续地进行定期与不定期的资产配置风险监控，适时地做出相应的调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×35%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×35%+中证综合债券指数收益率×30%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金、货币市场基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
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	95566

传真	0755-23997878	010-66594942
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)	
	平安股息精选沪港深股票 A	平安股息精选沪港深股票 C
本期已实现收益	4,732,686.61	61,466.22
本期利润	2,384,142.12	-7,078.07
加权平均基金份额本期利润	0.0255	-0.0053
本期加权平均净值利润率	2.38%	-0.50%
本期基金份额净值增长率	-1.23%	-1.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
	期末可供分配利润	120,521.89
	13,705,785.60	

期末可供分配基金份额利润	0.1357	0.1020
期末基金资产净值	114,686,030.22	1,301,665.94
期末基金份额净值	1.1357	1.1020
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	13.57%	10.20%

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

平安股息精选沪港深股票 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
过去一个月	5.70%	0.85%	4.42%	0.76%	1.28%	0.09%
过去三个月	13.35%	0.81%	5.67%	0.80%	7.68%	0.01%
过去六个月	-1.23%	1.40%	-2.58%	1.10%	1.35%	0.30%
过去一年	5.22%	1.13%	0.94%	0.86%	4.28%	0.27%
过去三年	12.02%	1.09%	11.03%	0.80%	0.99%	0.29%
自基金合同生效起至	13.57%	1.07%	14.07%	0.78%	-0.50%	0.29%

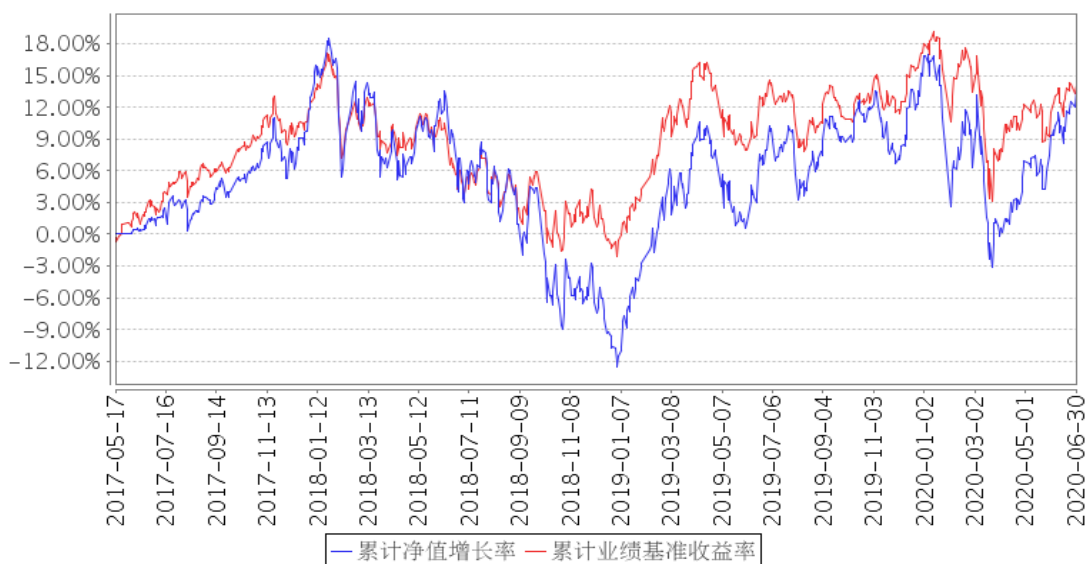
平安股息精选沪港深股票 C

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
过去一个月	5.62%	0.85%	4.42%	0.76%	1.20%	0.09%
过去三个月	13.13%	0.81%	5.67%	0.80%	7.46%	0.01%
过去六个月	-1.62%	1.40%	-2.58%	1.10%	0.96%	0.30%

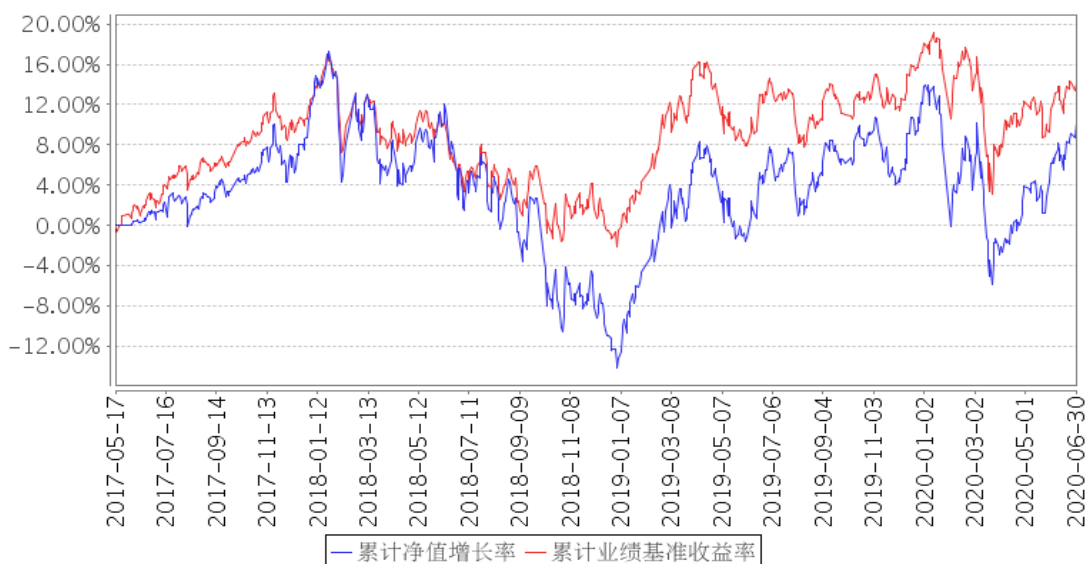
过去一年	4.44%	1.13%	0.94%	0.86%	3.50%	0.27%
过去三年	8.87%	1.09%	11.03%	0.80%	-2.16%	0.29%
自基金合同生效起至	10.20%	1.07%	14.07%	0.78%	-3.87%	0.29%

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

平安股息精选沪港深股票A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



平安股息精选沪港深股票C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 5 月 17 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。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（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 2020 年 06 月 30 日，平安基金共管理 115 只公募基金，资产管理总规模约为 3,784 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		
DANIEL DONGNING SUN	衍生品投资中心投资执行总经理，平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 7 日	2020 年 6 月 29 日	15 年	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，曾任衍生品投资中心投资执行总经理，曾任平安深证 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、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理。
毛时超	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理助理	2019 年 10 月 28 日	2020 年 5 月 8 日	3 年	毛时超先生，中山大学硕士研究生。2016 年 7 月加入平安基金管理有限公司，曾任衍生品投资中心衍生品研究员、基金经理助理。现担任平安安享灵活配置混合型证券投资基金、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、平安中证 500 指数增强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。
成钧	ETF 指数中心指数投资总监，平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理	2020 年 6 月 24 日	-	9 年	成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数中心指数投资总监。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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。
毛时超	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理	2020 年 6 月 24 日	-	3 年	毛时超先生，中山大学硕士研究生。2016 年 7 月加入平安基金管理有限公司，曾任衍生品投资中心衍生品研究员、基金经理助理。现担任平安安享灵活配置混合型证券投资基金、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、平安中证 500 指数增强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。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，国内疫情得到良好控制，企业逐步复工复产，宏观经济走向正常，A 股呈现反弹上涨行情，尤其是医药、消费以及科技等行业股票。相比于估值较高的医药、电子、计算机等行业股票，历史股息率较高的金融行业股票，估值依然处于历史较低位置，具有较高的投资预期收益空间。本基金基于股息率、估值和波动率等因素，主要配置股息率较高、估值较低的金融股，同时积极参与新股申购，增厚基金的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期平安股息精选沪港深股票 A 基金份额净值 1.1357 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.23%，同期业绩比较基准收益率为-2.58%；截至本报告期平安股息精选沪港深股票 C 基金份额净值 1.1020 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.62%，同期业绩比较基准收益率为-2.58%。

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，金融行业的股票估值较低，股息率较高且波动率较低，无论市场如何上下波动，长期来看依然具有良好的投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安股息精选沪港深股票型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安股息精选沪港深股票型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,154,580.82	4,696,947.88
结算备付金		23,350.58	837,203.45
存出保证金		12,902.34	55,891.21
交易性金融资产	6.4.7.2	109,033,914.65	88,305,032.27
其中：股票投资		109,033,914.65	88,305,032.27
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		2,026,386.79	-
应收利息	6.4.7.5	793.27	1,341.72
应收股利		-	-
应收申购款		32,051.59	12,716.42
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		118,283,980.04	93,909,132.95
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		2,051,394.42	50,572.09
应付管理人报酬		141,708.47	115,355.20
应付托管费		23,618.10	19,225.89

应付销售服务费		872.11	813.38
应付交易费用	6.4.7.7	16,994.80	74,810.74
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	61,695.98	39,531.65
负债合计		2,296,283.88	300,308.95
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	102,161,388.67	81,439,633.92
未分配利润	6.4.7.10	13,826,307.49	12,169,190.08
所有者权益合计		115,987,696.16	93,608,824.00
负债和所有者权益总计		118,283,980.04	93,909,132.95

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，平安股息精选沪港深股票份额总额合计为 102,161,388.67 份。平安股息精选沪港深股票 A 基金份额净值 1.1357 元，基金份额总额 100,980,244.62 份；平安股息精选沪港深股票 C 基金份额净值 1.1020 元，基金份额总额 1,181,144.05 份。

6.2 利润表

会计主体：平安股息精选沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		3,384,607.54	2,854,323.08
1. 利息收入		25,554.90	7,475.13
其中：存款利息收入	6.4.7.11	25,231.61	7,340.88
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		323.29	134.25
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,696,754.32	-82,369.66
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,436,485.01	-192,403.20
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,260,269.31	110,033.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-2,417,088.78	2,920,111.53
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	79,387.10	9,106.08
减：二、费用		1,007,543.49	154,770.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	757,085.52	95,334.66
2. 托管费	6.4.10.2.2	126,180.91	15,889.11
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,472.73	5,054.32
4. 交易费用	6.4.7.19	50,299.74	10,625.28
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	6.4.7.20	68,504.59	27,867.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,377,064.05	2,699,552.68
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,377,064.05	2,699,552.68

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安股息精选沪港深股票型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	81,439,633.92	12,169,190.08	93,608,824.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,377,064.05	2,377,064.05
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）	20,721,754.75	-719,946.64	20,001,808.11
其中：1. 基金申	34,167,153.02	363,735.63	34,530,888.65

购款			
2. 基金赎回款	-13,445,398.27	-1,083,682.27	-14,529,080.54
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）	102,161,388.67	13,826,307.49	115,987,696.16
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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）	15,240,907.30	-1,655,643.59	13,585,263.71
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,699,552.68	2,699,552.68
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）	-4,702,570.28	-236,141.04	-4,938,711.32
其中：1. 基金申购款	1,684,917.28	63,951.37	1,748,868.65
2. 基金赎回款	-6,387,487.56	-300,092.41	-6,687,579.97
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）	10,538,337.02	807,768.05	11,346,105.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安股息精选沪港深股票型证券投资基金(原名为平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金,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[2016]2506号《关于准予平安大华股息精选沪港深股票型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《平安大华股息精选沪港深股票型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,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301,260,380.30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319号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金基金合同》于2017年5月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为301,436,789.32份基金份额,其中认购资金利息折合176,409.02份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

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》,平安大华股息精选沪港深股票型证券投资基金于2018年11月30日起更名为平安股息精选沪港深股票型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安股息精选沪港深股票型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,包括国内依法公开发行上市股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、港股通标的股票、衍生工具(权证、股指期货、国债期货等),债券资产(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债、地方政府债、政府支持机构债、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券),资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款),现金资产等货币市场工具,以及法律法规或中国证监会允许投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金的投资组合比例为:股票资产占基金资产的比例范围为80%-95%,其中投资于国内依法发行上市股票的比例为基金资产的0-95%,投资于港股通标的股票比例为基金资产的0-95%;投资于股息主题相关的证券的比例不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后,基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率×35%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×35%+中证综合债券指数收益率×30%。

6.4.2 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《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》、《平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
活期存款	7,154,580.82
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	7,154,580.82

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	108,310,720.01	109,033,914.65	723,194.64
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	108,310,720.01	109,033,914.65	723,194.64

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	778.60
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	9.45
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	-
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	5.22
合计	793.27

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	16,994.80
银行间市场应付交易费用	-
合计	16,994.80

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9.76
应付证券出借违约金	-
预提费用	61,686.22
合计	61,695.98

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安股息精选沪港深股票 A

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	80,440,317.18	80,440,317.18
本期申购	31,676,722.20	31,676,722.20

本期赎回（以“-”号填列）	-11,136,794.76	-11,136,794.76
-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	100,980,244.62	100,980,244.62

平安股息精选沪港深股票 C

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	999,316.74	999,316.74
本期申购	2,490,430.82	2,490,430.82
本期赎回（以“-”号填列）	-2,308,603.51	-2,308,603.51
-基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,181,144.05	1,181,144.05

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安股息精选沪港深股票 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,221,582.84	-2,172,395.46	12,049,187.38
本期利润	4,732,686.61	-2,348,544.49	2,384,142.12
本期基金份额 交易产生的变 动数	3,967,997.67	-4,695,541.57	-727,543.90
其中：基金申 购款	6,243,705.75	-5,986,924.83	256,780.92
基金赎 回款	-2,275,708.08	1,291,383.26	-984,324.82
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	22,922,267.12	-9,216,481.52	13,705,785.60
平安股息精选沪港深股票 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	147,769.03	-27,766.33	120,002.70
本期利润	61,466.22	-68,544.29	-7,078.07
本期基金份额 交易产生的变 动数	18,177.98	-10,580.72	7,597.26
其中：基金申 购款	397,242.69	-290,287.98	106,954.71

基金赎回款	-379,064.71	279,707.26	-99,357.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	227,413.23	-106,891.34	120,521.89

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
活期存款利息收入		24,442.16
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		414.55
其他		374.90
合计		25,231.61

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		4,436,485.01
股票投资收益——赎回差价收入		-
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		4,436,485.01

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2020年1月1日至2020年6月30日	
卖出股票成交总额		10,055,780.31
减：卖出股票成本总额		5,619,295.30
买卖股票差价收入		4,436,485.01

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于证券出借产生的差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,260,269.31
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	1,260,269.31

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,417,088.78
股票投资	-2,417,088.78
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-2,417,088.78

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	79,355.91
基金转换费收入	31.19
合计	79,387.10

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	50,299.74
银行间市场交易费用	-
合计	50,299.74

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
审计费用	17,404.66
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	2,318.37
账户维护费	9,000.00
合计	68,504.59

6.4.7.21 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，无须作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国银行	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（“平安人寿”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
平安证券	-	-	2,650,990.89	43.56

6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例(%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例(%)
平安证券	1,325.51	30.70	557.69	46.53

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	757,085.52	95,334.66
其中：支付销售机构的客户维护费	443,569.56	38,034.81

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	126,180.91	15,889.11

注：支付基金托管人中国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。

6.4.10.2.3 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 2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安股息精选沪港深股 票 A	平安股息精选沪港深股 票 C	合计
陆金所	-	107.25	107.25
平安基金	-	299.11	299.11
平安证券	-	0.83	0.83
中国银行	-	124.05	124.05
合计	-	531.24	531.24

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安股息精选沪港深股票 A	平安股息精选沪港深股票 C	合计
平安证券	-	199.40	199.40
中国银行	-	154.13	154.13
陆金所	-	135.41	135.41
平安基金	-	49.98	49.98
合计	-	538.92	538.92

注：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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

注：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。

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

注：本基金本报告期内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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	7,154,580.82	24,442.16	1,864,884.92	7,110.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年07月08日	新股流通受限	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年07月02日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年07月03日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年07月01日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688277	天智航	2020年6月24日	2020年07月07日	新股流通受限	12.04	12.04	5,175	62,307.00	62,307.00	-
688278	特宝生物	2020年1月9日	2020年7月17日	非公开限售	8.24	67.73	5,757	47,437.68	389,921.61	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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中国银行，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资

6.4.13.2.3 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末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 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末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 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末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 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末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 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于约定开放日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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

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

于报告期末，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

6.4.13.3.2 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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%。于报告期末日，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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、应收申购款、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,154,580.82	-	-	-	7,154,580.82
结算备付金	23,350.58	-	-	-	23,350.58
存出保证金	12,902.34	-	-	-	12,902.34
交易性金融资产	-	-	-	109,033,914.65	109,033,914.65
应收利息	-	-	-	793.27	793.27
应收申购款	-	-	-	32,051.59	32,051.59
应收证券清算款	-	-	-	2,026,386.79	2,026,386.79
资产总计	7,190,833.74	-	-	111,093,146.30	118,283,980.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,051,394.42	2,051,394.42
应付管理人报酬	-	-	-	141,708.47	141,708.47
应付托管费	-	-	-	23,618.10	23,618.10
应付销售服务费	-	-	-	872.11	872.11
应付交易费用	-	-	-	16,994.80	16,994.80
其他负债	-	-	-	61,695.98	61,695.98
负债总计	-	-	-	2,296,283.88	2,296,283.88
利率敏感度缺口	7,190,833.74	-	-	-108,796,862.42	115,987,696.16
上年度末 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	4,696,947.88	-	-	-	4,696,947.88
结算备付金	837,203.45	-	-	-	837,203.45
存出保证金	55,891.21	-	-	-	55,891.21
交易性金融资产	-	-	-	88,305,032.27	88,305,032.27
应收利息	-	-	-	1,341.72	1,341.72

应收申购款	-	-	-	12,716.42	12,716.42
资产总计	5,590,042.54	-	-	88,319,090.41	93,909,132.95
负债					
应付赎回款	-	-	-	50,572.09	50,572.09
应付管理人报酬	-	-	-	115,355.20	115,355.20
应付托管费	-	-	-	19,225.89	19,225.89
应付销售服务费	-	-	-	813.38	813.38
应付交易费用	-	-	-	74,810.74	74,810.74
其他负债	-	-	-	39,531.65	39,531.65
负债总计	-	-	-	300,308.95	300,308.95
利率敏感度缺口	5,590,042.54	-	-	88,018,781.46	93,608,824.00

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于报告期末，本基金未持有交易性债券(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)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单

个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产占基金资产的比例范围为 80%-95%，其中投资于国内依法发行上市的股票比例为基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例为基金资产的 0-95%；投资于股息主题相关的证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。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 atRisk) 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	109,033,914.65	94.00	88,305,032.27	94.33
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	109,033,914.65	94.00	88,305,032.27	94.33

6.4.13.4.3.2 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		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	

分析	1. 业绩比较基准增加 5%	5,800,949.74	4,742,954.06
	2. 业绩比较基准减少 5%	-5,800,949.74	-4,742,954.06

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	109,033,914.65	92.18
	其中：股票	109,033,914.65	92.18
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	7,177,931.40	6.07
8	其他各项资产	2,072,133.99	1.75
9	合计	118,283,980.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,684,180.15	22.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01

E	建筑业	4,974,633.00	4.29
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	5,477,320.00	4.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.01
J	金融业	66,326,642.61	57.18
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,546,275.00	5.64
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	109,033,914.65	94.00

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600436	片仔癀	67,028	11,411,517.00	9.84
2	000333	美的集团	143,069	8,554,095.51	7.38
3	600036	招商银行	221,170	7,457,852.40	6.43
4	600030	中信证券	303,100	7,307,741.00	6.30
5	601888	中国中免	42,500	6,546,275.00	5.64
6	601166	兴业银行	372,000	5,870,160.00	5.06
7	601009	南京银行	796,900	5,841,277.00	5.04
8	601628	中国人寿	214,001	5,822,967.21	5.02
9	600000	浦发银行	548,300	5,801,014.00	5.00
10	600009	上海机场	76,000	5,477,320.00	4.72
11	601601	中国太保	191,800	5,226,550.00	4.51
12	603899	晨光文具	95,000	5,187,000.00	4.47
13	601668	中国建筑	1,042,900	4,974,633.00	4.29
14	002142	宁波银行	178,400	4,686,568.00	4.04
15	000776	广发证券	324,900	4,587,588.00	3.96
16	601688	华泰证券	200,100	3,761,880.00	3.24
17	601328	交通银行	658,500	3,378,105.00	2.91

18	601939	建设银行	505,200	3,187,812.00	2.75
19	601818	光大银行	880,200	3,151,116.00	2.72
20	688278	特宝生物	5,757	389,921.61	0.34
21	601398	工商银行	49,400	246,012.00	0.21
22	688277	天智航	5,175	62,307.00	0.05
23	603087	甘李药业	344	34,503.20	0.03
24	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
25	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
26	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
27	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
28	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
29	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
30	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600009	上海机场	5,165,916.00	5.52
2	603899	晨光文具	4,560,700.00	4.87
3	601888	中国中免	4,199,343.00	4.49
4	600436	片仔癀	4,188,986.00	4.47
5	601668	中国建筑	1,924,220.00	2.06
6	000333	美的集团	1,613,640.00	1.72
7	600036	招商银行	1,065,899.00	1.14
8	600352	浙江龙盛	508,800.00	0.54
9	000002	万科A	504,970.00	0.54
10	601088	中国神华	418,200.00	0.45
11	600104	上汽集团	382,700.00	0.41
12	002142	宁波银行	378,500.00	0.40
13	601628	中国人寿	354,000.00	0.38
14	601225	陕西煤业	325,600.00	0.35
15	601166	兴业银行	305,000.00	0.33
16	601328	交通银行	212,800.00	0.23
17	601939	建设银行	201,300.00	0.22
18	601818	光大银行	196,000.00	0.21
19	688266	泽璟制药	157,051.52	0.17
20	688588	凌志软件	109,832.91	0.12

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	601888	中国中免	1,507,902.00	1.61
2	600352	浙江龙盛	527,800.00	0.56
3	000002	万科A	441,830.00	0.47
4	688588	凌志软件	432,870.36	0.46
5	601088	中国神华	410,750.00	0.44
6	600104	上汽集团	391,800.00	0.42
7	688266	泽璟制药	308,645.68	0.33
8	601225	陕西煤业	301,200.00	0.32
9	688396	华润微	262,785.99	0.28
10	603195	公牛集团	212,021.50	0.23
11	600918	中泰证券	205,478.31	0.22
12	688158	优刻得	204,431.75	0.22
13	688518	联赢激光	196,941.00	0.21
14	688298	东方生物	193,856.00	0.21
15	688106	金宏气体	192,695.32	0.21
16	688555	泽达易盛	186,288.50	0.20
17	688080	映翰通	174,853.00	0.19
18	688200	华峰测控	171,375.12	0.18
19	688365	光云科技	162,414.60	0.17
20	688026	洁特生物	162,004.70	0.17

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	28,765,266.46
卖出股票收入（成交）总额	10,055,780.31

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

2019 年 7 月 2 日对招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）在银行间债券回购市场达成 DR001 为 0.09% 的异常利率交易。经公司自查，为交易员操作失误所致。全国银行间同业拆借中心根据相关规定对公司进行通报批评，并依据《银行间本币市场交易员管理办法（试行）》暂停公司相关交易员的银行间本币市场交易员资格 1 年。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。

北京银保监局于 2019 年 10 月 8 日做出京银保监罚决字〔2019〕41 号，由于兴业银行北京分行违规向房地产开发企业提供融资、违规通过同业投资规避监管指标、违规修改理财协议文本、违规向企业权益性投资提供融资、违规向普通客户销售投向非上市公司股权的理财产品，根据相关规定责令兴业银行北京分行改正，并给予合计 600 万元罚款的行政处罚。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。

江苏银保监局于 2019 年 12 月 31 日做出苏银保监罚决字〔2019〕86 号处罚决定，由于南京银行股份有限公司（以下简称“公司”）存在以下违法违规行为：1. 未将部分银行承担风险的业务

纳入统一授信管理；2. 同业投资资金违规用于支付土地出让金；3. 同业投资资金违规用于上市公司定向增发；4. 同业投资资金违规用于土地储备开发；5. 违规为第三方金融机构同业投资业务提供信用担保；6. 理财产品之间相互调节收益；7. 理财资金投资非标债权资产总额超过规定上限；8. 面向一般个人客户销售的理财产品违规投资权益类资产；9. 理财资金与自营资金未充分隔离；10. 理财投资非标业务未比照自营贷款管理；11. 关联方管理不全面；12. 违规向关系人发放信用贷款；13. 债券投资操作不规范。根据相关规定对公司没收违法所得 137701 元，处以人民币 610 万元罚款。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

银保监会于 2019 年 6 月 24 日做出银保监罚决字（2019）7 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力。根据相关规定对公司罚款 130 万元。本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力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。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,902.34
2	应收证券清算款	2,026,386.79
3	应收股利	-
4	应收利息	793.27
5	应收申购款	32,051.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,072,133.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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（%）
平安股息精选沪港深股票 A	768	131,484.69	49,436.36	0.05	100,930,808.26	99.95
平安股息精选沪港深股票 C	345	3,423.61	-	-	1,181,144.05	100.00
合计	1,113	91,789.21	49,436.36	0.05	102,111,952.31	99.95

注：上述机构/个人投资者持有份额占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）。

8.2 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	平安股息精选沪港深股票 A	-	-
	平安股息精选沪港深股票 C	104.35	0.0088
	合计	104.35	0.0001

注：上述从业人员持有份额占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）。

8.3 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	平安股息精选沪港深股票 A	0
	平安股息精选沪港深股票 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安股息精选沪港深股票 A	0
	平安股息精选沪港深股票 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安股息精选沪港深股票 A	平安股息精选沪港深股票 C
基金合同生效日 (2017年5月17日) 基金份额总额	191,878,691.19	109,558,098.13
本报告期期初基金份额总额	80,440,317.18	999,316.74
本报告期基金总申购份额	31,676,722.20	2,490,430.82
减：本报告期基金总赎回份额	11,136,794.76	2,308,603.51
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	100,980,244.62	1,181,144.05

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、副总经理汪涛因个人原因提出辞任，经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，离任日期为 2020 年 2 月 28 日。

2、2020 年 5 月公司董事会换届，经公司 2020 年第三次股东会审议通过，陈宁、马琳接替姚波、陈敬达成为公司新任董事，任职日期为 2020 年 5 月 27 日。

3、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。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	15,541,357.16	42.51%	14,473.74	47.95%	-
兴业证券	2	8,138,274.02	22.26%	5,951.57	19.72%	-
安信证券	2	2,899,050.56	7.93%	2,120.10	7.02%	-
国盛证券	1	2,596,608.68	7.10%	1,846.92	6.12%	-

中泰证券	1	2,384,479.21	6.52%	1,696.09	5.62%	-
国信证券	2	1,604,884.45	4.39%	1,173.64	3.89%	-
中信证券	2	1,038,340.00	2.84%	966.92	3.20%	-
华泰证券	1	689,883.20	1.89%	490.75	1.63%	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	595,296.00	1.63%	554.40	1.84%	-
广发证券	1	505,849.27	1.38%	471.03	1.56%	-
国泰君安证 券	2	401,256.06	1.10%	285.40	0.95%	-
宏源证券	1	143,350.80	0.39%	133.49	0.44%	-
方正证券	2	23,724.90	0.06%	22.10	0.07%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海华信证 券	2	-	-	-	-	-
申银万国证 券	1	-	-	-	-	-
西藏东财证 券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

浙商证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证 券	1	-	-	-	-	-
中银国际证 券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	2,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-

宏源证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海华信 证券	-	-	-	-	-	-
申银万国 证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财 证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月10日
2	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月20日
3	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月30日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京蛋卷基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月20日
5	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增珠海盈米基金销售有限公司	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月20日

	为销售机构的公告		
6	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月24日
7	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增南京苏宁基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月24日
8	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月28日
9	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月29日
10	关于平安股息精选沪港深股票型证券投资基金暂停大额申购、转换转入和定期定额投资业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年3月18日
11	平安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年3月27日
12	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定投起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年4月7日
13	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020年4月20日
14	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020年4月28日
15	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券华南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	中国证监会规定报刊及网站	2020年5月6日
16	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增喜鹊财富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年5月26日
17	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增大连网金基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年6月1日
18	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金招募说明书（摘要）更新	中国证监会规定报刊及网站	2020年6月17日
19	平安股息精选沪港深股票型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	2020年6月17日
20	平安股息精选沪港深股票型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	2020年6月29日
21	平安股息精选沪港深股票型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	2020年6月29日
22	平安股息精选沪港深股票型证券投资基金招募说明书（摘要）更新	中国证监会规定报刊及网站	2020年6月29日

23	平安股息精选沪港深股票型证券投资 基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及 网站	2020 年 6 月 30 日
----	--------------------------------	------------------	-----------------

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	1	2020/01/01-- 2020/06/30	25,959,180.02	-	-	25,959,180.02	25.41
	2	2020/01/01-- 2020/06/30	27,737,190.08	-	-	27,737,190.08	27.15
	3	2020/03/19-- 2020/06/30	13,943,478.67	23,172,795.97	-	37,116,274.64	36.33

产品特有风险

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。

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 5,000 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予平安股息精选沪港深股票型证券投资基金设立的文件；
- 2、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金合同；
- 3、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金托管协议；

- 4、平安股息精选沪港深股票型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、报告期内在规定报刊以及规定网站上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

(1) 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 8 月 27 日