

平安中证新能源汽车产业交易型开放式指 数证券投资基金 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：招商证券股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 27 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	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	56
7.1 期末基金资产组合情况	56
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63

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	63
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	63
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	63
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§ 8 基金份额持有人信息	65
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末上市基金前十名持有人	65
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
§ 9 开放式基金份额变动	66
§ 10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	66
10.4 基金投资策略的改变	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
10.8 其他重大事件	68
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	69
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	69
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§ 12 备查文件目录	69
12.1 备查文件目录	69
12.2 存放地点	69
12.3 查阅方式	69

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证新能源汽车产业 ETF
场内简称	新能车（扩位证券简称：新能车 ETF）
基金主代码	515700
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	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	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,118,510,190.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 10 日

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	韩鑫普
	联系电话	0755-22626828	0755-82943666
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95565
传真		0755-23997878	0755-82960794

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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码	518048	518000
法定代表人	罗春风	霍达

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	-424,064,784.76
本期利润	-212,930,826.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0486
本期加权平均净值利润率	-4.70%
本期基金份额净值增长率	18.14%
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	-271,416,208.23
期末可供分配基金份额利润	-0.0659
期末基金资产净值	4,867,274,900.20
期末基金份额净值	1.1818
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	18.18%

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

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	15.05%	1.36%	15.29%	1.35%	-0.24%	0.01%
过去三个月	28.14%	1.66%	28.24%	1.67%	-0.10%	-0.01%
过去六个月	18.14%	2.43%	20.06%	2.50%	-1.92%	-0.07%
自基金合同生效起至今	18.18%	2.42%	19.94%	2.49%	-1.76%	-0.07%

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

平安中证新能源汽车产业ETF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、本基金合同于2019年12月31日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；

2、截止报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定；

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 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		
钱晶	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2019 年 12 月 31 日	-	9 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任资产配置事业部 ETF 指数部投资经理。现担任 ETF 指数中心投资副总监，同时担任平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安 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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
董俊玲	平安中证新能源汽车产业交易型开放	2020 年 1 月 8 日	-	2 年	董俊玲，女，同济大学硕士。曾担任鹏华基金管理有限公司 FOF 研究员。2019 年 7 月加入平安基金管理有限公司，现任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究

	式指数证券投资基金基金经理助理				员。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。
刘帆	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2020 年 1 月 8 日	-	3 年	刘帆，女，南开大学硕士。2016 年 7 月加入平安基金管理有限公司，现任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究员。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决

定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

作为一只投资于中证新能源汽车产业公司的被动型产品，基金在投资管理上，采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

报告期内，本基金自上市日起，日均偏离度为 0.02%，年化跟踪误差 0.63%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2%的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.1818 元；本报告期基金份额净值增长率为 18.14%，业

绩比较基准收益率为 20.06%。

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 2020 年下半年，中美贸易摩擦虽然仍有一定不确定性，但是边际影响下降。对比当前海外各国权益资产估值，A 股、港股都具备较高的吸引力。宏观方面，在“以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进”的指导下，国内经济转型进程或将加速，寻找并挖掘潜在的行业增长机会。货币政策方面，在经济未完全恢复之前，预计仍然会保持适当宽松，很难突然转向。综合考虑，我们对权益资产的前景仍保持谨慎乐观。

作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金

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	28,533,906.61	288,470,000.00
结算备付金		6,519,554.47	-
存出保证金		10,137,655.65	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,831,954,267.45	41,060.00
其中：股票投资		4,831,954,267.45	41,060.00
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,427,882.71	-
应收利息	6.4.7.5	190,589.77	83,444.31
应收股利		248,597.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	661,993.66	-
资产总计		4,883,674,447.32	288,594,504.31
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		1,022,658.62	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		624,401.06	-
应付托管费		208,133.67	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,211,991.56	-
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	11,332,362.21	543.48
负债合计		16,399,547.12	543.48
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,118,510,190.00	288,510,190.00
未分配利润	6.4.7.10	748,764,710.20	83,770.83
所有者权益合计		4,867,274,900.20	288,593,960.83
负债和所有者权益总计		4,883,674,447.32	288,594,504.31

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1818 元，基金份额总额 4,118,510,190.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金

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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-191,956,341.44
1. 利息收入		1,850,706.72
其中：存款利息收入	6.4.7.11	337,379.19
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		31,227.08
证券出借利息收入		1,482,100.45
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-449,802,467.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-473,372,280.77
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	23,569,813.30
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	211,133,957.98
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	44,861,461.33
减：二、费用		20,974,485.34
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,247,841.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,082,613.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	15,786,860.27
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	857,169.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-212,930,826.78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-212,930,826.78

注：本基金于 2019 年 12 月 31 日成立，故无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金

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）	288,510,190.00	83,770.83	288,593,960.83
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-212,930,826.78	-212,930,826.78
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）	3,830,000,000.00	961,611,766.15	4,791,611,766.15
其中：1. 基金申	9,072,000,000.00	1,274,837,534.59	10,346,837,534.59

购款			
2. 基金赎回款	-5,242,000,000.00	-313,225,768.44	-5,555,225,768.44
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）	4,118,510,190.00	748,764,710.20	4,867,274,900.20

注：本基金于 2019 年 12 月 31 日成立，故无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

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

平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1820号《关于准予平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 288,510,190.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0798 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 12 月 31 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 288,510,190.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为招商证券(以下简称“招商证券”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)审核同意,本基金 288,510,190.00 份基金份额于 2020 年 2 月 10 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围中证新能源汽车产业指数的成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公

司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款、同业存单、资产支持证券、资产支持票据、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在条件许可的情况下,根据相关法律法规,本基金可参与融资及转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即中证新能源汽车产业指数收益率。

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《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》、《平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金》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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产和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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 本基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配；(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使出息后的基金份额净值低于面值；(3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；(4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(5) 每一基金份额享有同等分配权；(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动

性折扣后的价值进行估值。

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[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。

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	28,533,906.61
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	28,533,906.61

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	4,620,819,439.47	4,831,954,267.45	211,134,827.98
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	4,620,819,439.47	4,831,954,267.45	211,134,827.98

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	2,409.72
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	2,640.42
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	181,433.83
其他	4,105.80
合计	190,589.77

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	75,409.91
现金差额	586,583.75
合计	661,993.66

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	3,211,991.56
银行间市场应付交易费用	-

合计	3,211,991.56
----	--------------

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	507,365.23
应退替代款	10,820,794.57
可退替代款	4,202.41
合计	11,332,362.21

注：可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	288,510,190.00	288,510,190.00
本期申购	9,072,000,000.00	9,072,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-5,242,000,000.00	-5,242,000,000.00
- 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	4,118,510,190.00	4,118,510,190.00

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	82,900.83	870.00	83,770.83
本期利润	-424,064,784.76	211,133,957.98	-212,930,826.78
本期基金份额交易产生的变动数	152,565,675.70	809,046,090.45	961,611,766.15
其中：基金申购款	2,722,085.94	1,272,115,448.65	1,274,837,534.59
基金赎回款	149,843,589.76	-463,069,358.20	-313,225,768.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-271,416,208.23	1,020,180,918.43	748,764,710.20

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	162,000.31
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	125,341.64
其他	50,037.24
合计	337,379.19

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	-296,488,564.46
股票投资收益——赎回差价收入	-176,883,716.31
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	-473,372,280.77

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	4,941,556,157.29
减：卖出股票成本总额	5,238,044,721.75
买卖股票差价收入	-296,488,564.46

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	5,555,225,768.44
减：现金支付赎回款总额	3,841,657,722.44
减：赎回股票成本总额	1,890,451,762.31
赎回差价收入	-176,883,716.31

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

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：本基金本报告期内无债券投资收益。

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	23,569,813.30
其中：证券出借权益补偿收入	498,077.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,569,813.30

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	211,133,957.98
股票投资	211,133,957.98
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	211,133,957.98

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	-
替代损益	44,861,461.33
合计	44,861,461.33

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

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	15,786,860.27
银行间市场交易费用	-
合计	15,786,860.27

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	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	9,496.75
指数使用费	649,568.29
IOPV 费用	8,606.88
中登登记结算费	99,590.09
开户费	400.00
合计	857,169.61

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
招商证券	基金托管人
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
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
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
中国平安财产保险股份有限公司(“平安财险”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

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	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
招商证券	13,552,289,359.65	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内无债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例(%)
招商证券	253,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期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 (%)
招商证券	9,639,760.44	100.00	3,211,991.56	100.00

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
当期发生的基金应支付的管理费	3,247,841.62
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

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
当期发生的基金应支付的托管费	1,082,613.84

注：注：支付基金托管人招商证券的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券	15,841,290.56	3,872.09	-	-

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：本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
招商证券	5,848,434.00	0.1420	-	-
平安人寿	65,000,000.00	1.5782	-	-
平安财险	79,518,300.00	1.9308	-	-

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	
	期末余额	当期利息收入
招商证券-活期	28,533,906.61	162,000.31

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券保管，按银行同业利率计息。

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：本基金本报告期末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	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	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	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020年6月29日	2020年07月09日	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688277	天智航-U	2020年6月24日	2020年07月07日	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688518	联赢激光	2020年6月12日	2020年12月11日	新股锁定	7.81	20.83	14,111	110,206.91	293,932.13	-

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：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
202006300000843	000887	中鼎股份	2020年06月30日	2020年07月28日	7.85	20,000	157,000.00
202006290000306	000887	中鼎股份	2020年6月29日	2020年7月13日	7.85	28,000	219,800.00
202006230000228	000887	中鼎股份	2020年6月23日	2020年7月7日	7.85	28,000	219,800.00
202006300000846	000887	中鼎股份	2020年6月30日	2020年7月14日	7.85	15,000	117,750.00
2020061700001330	000887	中鼎股份	2020年6月17日	2020年7月15日	7.85	435,000	3,414,750.00
202006240000621	000887	中鼎股份	2020年6月24日	2020年7月8日	7.85	10,000	78,500.00
202006190000231	000887	中鼎股份	2020年6月19日	2020年7月17日	7.85	160,600	1,260,710.00
20200619	000970	中科三环	2020年6月19日	2020年7月17日	9.78	45,900	448,902.00

0000 0247							
2020 0624 0000 0734	000970	中科三环	2020年6月 24日	2020年7 月8日	9.78	22,000	215,160 .00
2020 0617 0000 1823	000970	中科三环	2020年6月 17日	2020年7 月15日	9.78	98,000	958,440 .00
2020 0630 0000 0911	000970	中科三环	2020年6月 30日	2020年7 月28日	9.78	41,200	402,936 .00
2020 0619 0000 0267	002050	三花智控	2020年6月 19日	2020年7 月17日	21.90	50,000	1,095,0 00.00
2020 0618 0000 0262	002056	横店东磁	2020年6月 18日	2020年7 月16日	11.25	30,000	337,500 .00
2020 0617 0000 2724	002056	横店东磁	2020年6月 17日	2020年7 月15日	11.25	30,000	337,500 .00
2020 0619 0000 0269	002056	横店东磁	2020年6月 19日	2020年7 月17日	11.25	58,900	662,625 .00
2020 0623 0000 0260	002056	横店东磁	2020年6月 23日	2020年7 月7日	11.25	20,000	225,000 .00
2020 0617 0000 2726	002056	横店东磁	2020年6月 17日	2020年7 月15日	11.25	86,000	967,500 .00
2020 0617 0000 2725	002056	横店东磁	2020年6月 17日	2020年7 月15日	11.25	180,000	2,025,0 00.00
2020 0618 0000	002056	横店东磁	2020年6月 18日	2020年7 月2日	11.25	100,200	1,127,2 50.00

0258							
2020 0619 0000 0268	002056	横店东磁	2020年6月 19日	2020年7 月17日	11.25	81,700	919,125 .00
2020 0617 0000 2723	002056	横店东磁	2020年6月 17日	2020年7 月15日	11.25	21,000	236,250 .00
2020 0619 0000 0270	002056	横店东磁	2020年6月 19日	2020年7 月17日	11.25	20,000	225,000 .00
2020 0624 0000 1192	002056	横店东磁	2020年6月 24日	2020年7 月8日	11.25	81,500	916,875 .00
2020 0611 0000 0163	002056	横店东磁	2020年6月 11日	2020年7 月9日	11.25	200,000	2,250,0 00.00
2020 0612 0000 0932	002074	国轩高科	2020年6月 12日	2020年7 月10日	26.84	112,900	3,030,2 36.00
2020 0630 0000 1111	002074	国轩高科	2020年6月 30日	2020年7 月28日	26.84	29,300	786,412 .00
2020 0619 0000 0276	002074	国轩高科	2020年6月 19日	2020年7 月17日	26.84	126,600	3,397,9 44.00
2020 0617 0000 2786	002074	国轩高科	2020年6月 17日	2020年7 月15日	26.84	22,200	595,848 .00
2020 0615 0000 5144	002074	国轩高科	2020年6月 15日	2020年7 月13日	26.84	29,700	797,148 .00
2020 0617 0000 2788	002074	国轩高科	2020年6月 17日	2020年7 月15日	26.84	22,100	593,164 .00

2020 0622 0000 1450	002074	国轩高科	2020年6月 22日	2020年7 月20日	26.84	86,000	2,308,2 40.00
2020 0617 0000 2811	002074	国轩高科	2020年6月 17日	2020年7 月15日	26.84	22,100	593,164 .00
2020 0611 0000 2446	002074	国轩高科	2020年6月 11日	2020年7 月9日	26.84	90,000	2,415,6 00.00
2020 0622 0000 1451	002074	国轩高科	2020年6月 22日	2020年7 月20日	26.84	86,000	2,308,2 40.00
2020 0610 0000 0247	002074	国轩高科	2020年6月 10日	2020年7 月8日	26.84	238,600	6,404,0 24.00
2020 0617 0000 2954	002091	江苏国泰	2020年6月 17日	2020年7 月15日	6.05	111,000	671,550 .00
2020 0617 0000 3707	002179	中航光电	2020年6月 17日	2020年7 月15日	41.01	10,000	410,100 .00
2020 0617 0000 3728	002179	中航光电	2020年6月 17日	2020年7 月15日	41.01	28,000	1,148,2 80.00
2020 0630 0000 1420	002276	万马股份	2020年6月 30日	2020年7 月14日	7.14	332,700	2,375,4 78.00
2020 0629 0000 0449	002276	万马股份	2020年6月 29日	2020年7 月13日	7.14	72,000	514,080 .00
2020 0630 0000 1423	002276	万马股份	2020年6月 30日	2020年7 月28日	7.14	61,600	439,824 .00
2020	002276	万马股份	2020年6月	2020年7	7.14	158,800	1,133,8

0618 0000 0327			18 日	月 2 日			32.00
2020 0617 0000 4511	002276	万马股份	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	7.14	96,000	685,440 .00
2020 0624 0000 1800	002340	格林美	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	4.97	61,300	304,661 .00
2020 0629 0000 0460	002340	格林美	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	4.97	138,000	685,860 .00
2020 0611 0000 0199	002340	格林美	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	4.97	320,000	1,590,4 00.00
2020 0617 0000 4650	002340	格林美	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	4.97	749,000	3,722,5 30.00
2020 0630 0000 1455	002340	格林美	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	4.97	83,400	414,498 .00
2020 0623 0000 0294	002340	格林美	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	4.97	400,000	1,988,0 00.00
2020 0630 0000 1548	002407	多氟多	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	10.64	82,300	875,672 .00
2020 0618 0000 0354	002407	多氟多	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 2 日	10.64	107,600	1,144,8 64.00
2020 0623 0000 0300	002407	多氟多	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 7 日	10.64	20,000	212,800 .00
2020 0629	002407	多氟多	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	10.64	48,000	510,720 .00

0000 0482							
2020 0617 0000 4954	002407	多氟多	2020年6月 17日	2020年7 月15日	10.64	323,000	3,436,7 20.00
2020 0630 0000 1551	002407	多氟多	2020年6月 30日	2020年7 月14日	10.64	86,000	915,040 .00
2020 0617 0000 5091	002460	赣锋锂业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	53.57	67,000	3,589,1 90.00
2020 0622 0000 4077	002460	赣锋锂业	2020年6月 22日	2020年7 月20日	53.57	18,000	964,260 .00
2020 0629 0000 0498	002460	赣锋锂业	2020年6月 29日	2020年7 月27日	53.57	16,000	857,120 .00
2020 0618 0000 0369	002460	赣锋锂业	2020年6月 18日	2020年7 月16日	53.57	38,200	2,046,3 74.00
2020 0630 0000 1643	002460	赣锋锂业	2020年6月 30日	2020年7 月28日	53.57	10,000	535,700 .00
2020 0617 0000 5090	002460	赣锋锂业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	53.57	29,100	1,558,8 87.00
2020 0618 0000 0358	002460	赣锋锂业	2020年6月 18日	2020年7 月2日	53.57	30,000	1,607,1 00.00
2020 0610 0000 0266	002460	赣锋锂业	2020年6月 10日	2020年7 月8日	53.57	20,000	1,071,4 00.00
2020 0629 0000	002460	赣锋锂业	2020年6月 29日	2020年7 月27日	53.57	10,000	535,700 .00

0517							
2020 0617 0000 5094	002460	赣锋锂业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	53.57	10,000	535,700 .00
2020 0617 0000 5112	002466	天齐锂业	2020年6月 17日	2020年7 月1日	22.95	160,200	3,676,5 90.00
2020 0610 0000 0264	002466	天齐锂业	2020年6月 10日	2020年7 月8日	22.95	280,000	6,426,0 00.00
2020 0617 0000 5109	002466	天齐锂业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	22.95	160,200	3,676,5 90.00
2020 0605 0000 0400	002466	天齐锂业	2020年6月5 日	2020年7 月3日	22.95	350,000	8,032,5 00.00
2020 0617 0000 5110	002466	天齐锂业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	22.95	50,000	1,147,5 00.00
2020 0618 0000 0364	002466	天齐锂业	2020年6月 18日	2020年7 月16日	22.95	53,500	1,227,8 25.00
2020 0617 0000 5198	002518	科士达	2020年6月 17日	2020年7 月15日	12.40	275,200	3,412,4 80.00
2020 0623 0000 0312	002594	比亚迪	2020年6月 23日	2020年7 月7日	71.80	10,000	718,000 .00
2020 0619 0000 0350	002709	天赐材料	2020年6月 19日	2020年7 月17日	33.79	47,000	1,588,1 30.00
2020 0617 0000 5392	002709	天赐材料	2020年6月 17日	2020年7 月15日	33.79	20,000	675,800 .00

2020 0622 0000 5023	002709	天赐材料	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	33.79	207,200	7,001,2 88.00
2020 0617 0000 5394	002709	天赐材料	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	33.79	34,000	1,148,8 60.00
2020 0617 0000 5429	002812	恩捷股份	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	65.80	10,000	658,000 .00
2020 0617 0000 5427	002812	恩捷股份	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	65.80	58,000	3,816,4 00.00
2020 0619 0000 0353	002812	恩捷股份	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	65.80	16,000	1,052,8 00.00
2020 0617 0000 5482	300001	特锐德	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	20.94	153,000	3,203,8 20.00
2020 0630 0000 1897	300001	特锐德	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	20.94	20,000	418,800 .00
2020 0619 0000 0354	300001	特锐德	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 3 日	20.94	35,200	737,088 .00
2020 0617 0000 5490	300001	特锐德	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	20.94	17,700	370,638 .00
2020 0629 0000 0581	300001	特锐德	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	20.94	10,000	209,400 .00
2020 0629 0000 0579	300001	特锐德	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	20.94	28,200	590,508 .00
2020	300001	特锐德	2020 年 6 月	2020 年 7	20.94	20,000	418,800

0617 0000 5488			17 日	月 15 日			.00
2020 0610 0000 0286	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 10 日	2020 年 7 月 8 日	47.85	50,000	2,392,5 00.00
2020 0629 0000 0589	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	47.85	50,000	2,392,5 00.00
2020 0629 0000 0595	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	47.85	10,000	478,500 .00
2020 0617 0000 5554	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	47.85	10,000	478,500 .00
2020 0617 0000 5555	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	47.85	45,800	2,191,5 30.00
2020 0622 0000 5281	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	47.85	15,000	717,750 .00
2020 0618 0000 0441	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 2 日	47.85	20,000	957,000 .00
2020 0617 0000 5557	300014	亿纬锂能	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	47.85	82,000	3,923,7 00.00
2020 0619 0000 0372	300037	新宙邦	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	55.06	30,000	1,651,8 00.00
2020 0622 0000 5365	300037	新宙邦	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	55.06	10,000	550,600 .00
2020 0617	300037	新宙邦	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	55.06	10,000	550,600 .00

0000 5610							
2020 0617 0000 5611	300037	新宙邦	2020年6月 17日	2020年7 月15日	55.06	22,000	1,211,3 20.00
2020 0618 0000 0467	300073	当升科技	2020年6月 18日	2020年7 月16日	33.07	10,000	330,700 .00
2020 0618 0000 0464	300073	当升科技	2020年6月 18日	2020年7 月16日	33.07	20,000	661,400 .00
2020 0617 0000 5657	300073	当升科技	2020年6月 17日	2020年7 月15日	33.07	33,000	1,091,3 10.00
2020 0623 0000 0407	300073	当升科技	2020年6月 23日	2020年7 月21日	33.07	29,000	959,030 .00
2020 0629 0000 0637	300073	当升科技	2020年6月 29日	2020年7 月27日	33.07	15,000	496,050 .00
2020 0623 0000 0410	300073	当升科技	2020年6月 23日	2020年7 月21日	33.07	25,000	826,750 .00
2020 0622 0000 5437	300073	当升科技	2020年6月 22日	2020年7 月20日	33.07	26,200	866,434 .00
2020 0617 0000 5658	300073	当升科技	2020年6月 17日	2020年7 月15日	33.07	10,000	330,700 .00
2020 0617 0000 5660	300073	当升科技	2020年6月 17日	2020年7 月1日	33.07	26,300	869,741 .00
2020 0617 0000	300073	当升科技	2020年6月 17日	2020年7 月15日	33.07	20,000	661,400 .00

5661							
2020 0629 0000 0636	300073	当升科技	2020年6月 29日	2020年7 月27日	33.07	51,800	1,713,0 26.00
2020 0622 0000 5439	300073	当升科技	2020年6月 22日	2020年7 月20日	33.07	40,000	1,322,8 00.00
2020 0622 0000 5440	300073	当升科技	2020年6月 22日	2020年7 月6日	33.07	30,000	992,100 .00
2020 0618 0000 0466	300073	当升科技	2020年6月 18日	2020年7 月16日	33.07	30,000	992,100 .00
2020 0623 0000 0406	300073	当升科技	2020年6月 23日	2020年7 月21日	33.07	20,000	661,400 .00
2020 0617 0000 5733	300124	汇川技术	2020年6月 17日	2020年7 月15日	37.99	29,000	1,101,7 10.00
2020 0617 0000 5730	300124	汇川技术	2020年6月 17日	2020年7 月1日	37.99	31,600	1,200,4 84.00
2020 0630 0000 2098	300207	欣旺达	2020年6月 30日	2020年7 月28日	18.90	30,000	567,000 .00
2020 0629 0000 0681	300207	欣旺达	2020年6月 29日	2020年7 月27日	18.90	48,700	920,430 .00
2020 0619 0000 0405	300207	欣旺达	2020年6月 19日	2020年7 月3日	18.90	237,000	4,479,3 00.00
2020 0617 0000 5853	300207	欣旺达	2020年6月 17日	2020年7 月15日	18.90	62,000	1,171,8 00.00

2020 0617 0000 5847	300207	欣旺达	2020年6月 17日	2020年7 月1日	18.90	58,600	1,107,5 40.00
2020 0623 0000 0456	300207	欣旺达	2020年6月 23日	2020年7 月7日	18.90	80,000	1,512,0 00.00
2020 0623 0000 0455	300207	欣旺达	2020年6月 23日	2020年7 月21日	18.90	17,200	325,080 .00
2020 0617 0000 5854	300207	欣旺达	2020年6月 17日	2020年7 月15日	18.90	10,000	189,000 .00
2020 0618 0000 0500	300207	欣旺达	2020年6月 18日	2020年7 月2日	18.90	150,000	2,835,0 00.00
2020 0619 0000 0398	300207	欣旺达	2020年6月 19日	2020年7 月17日	18.90	10,000	189,000 .00
2020 0622 0000 5581	300207	欣旺达	2020年6月 22日	2020年7 月20日	18.90	30,000	567,000 .00
2020 0630 0000 2093	300207	欣旺达	2020年6月 30日	2020年7 月28日	18.90	61,800	1,168,0 20.00
2020 0623 0000 0458	300207	欣旺达	2020年6月 23日	2020年7 月21日	18.90	110,000	2,079,0 00.00
2020 0629 0000 0684	300207	欣旺达	2020年6月 29日	2020年7 月13日	18.90	115,200	2,177,2 80.00
2020 0617 0000 6077	300450	先导智能	2020年6月 17日	2020年7 月15日	46.21	21,000	970,410 .00
2020	300450	先导智能	2020年6月	2020年7	46.21	30,400	1,404,7

0622 0000 5753			22 日	月 20 日			84.00
2020 0617 0000 6072	300450	先导智能	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	46.21	10,000	462,100 .00
2020 0617 0000 6083	300457	赢合科技	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	31.88	31,000	988,280 .00
2020 0629 0000 0749	300457	赢合科技	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	31.88	108,400	3,455,7 92.00
2020 0617 0000 6082	300457	赢合科技	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	31.88	34,000	1,083,9 20.00
2020 0617 0000 6190	300618	寒锐钴业	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	62.02	29,000	1,798,5 80.00
2020 0617 0000 6183	300618	寒锐钴业	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	62.02	28,900	1,792,3 78.00
2020 0617 0000 6185	300618	寒锐钴业	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	62.02	80,500	4,992,6 10.00
2020 0617 0000 6189	300618	寒锐钴业	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	62.02	10,000	620,200 .00
2020 0617 0000 6181	300618	寒锐钴业	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 1 日	62.02	15,000	930,300 .00
2020 0618 0000 0538	300618	寒锐钴业	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 16 日	62.02	20,000	1,240,4 00.00
2020 0617	300750	宁德时代	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	174.36	10,000	1,743,6 00.00

0000 6219							
2020 0611 0000 0325	300750	宁德时代	2020年6月 11日	2020年7 月9日	174.36	20,000	3,487,2 00.00
2020 0622 0000 5809	300750	宁德时代	2020年6月 22日	2020年7 月20日	174.36	10,000	1,743,6 00.00
2020 0617 0000 1077	600066	宇通客车	2020年6月 17日	2020年7 月15日	12.20	85,000	1,037,0 00.00
2020 0622 0000 1724	600478	科力远	2020年6月 22日	2020年7 月20日	4.71	37,700	177,567 .00
2020 0617 0000 1127	600478	科力远	2020年6月 17日	2020年7 月15日	4.71	117,000	551,070 .00
2020 0624 0000 0465	600478	科力远	2020年6月 24日	2020年7 月22日	4.71	430,300	2,026,7 13.00
2020 0623 0000 0721	600478	科力远	2020年6月 23日	2020年7 月7日	4.71	258,000	1,215,1 80.00
2020 0624 0000 2034	600478	科力远	2020年6月 24日	2020年7 月8日	4.71	20,000	94,200. 00
2020 0618 0000 0879	600478	科力远	2020年6月 18日	2020年7 月2日	4.71	150,000	706,500 .00
2020 0619 0000 0593	600478	科力远	2020年6月 19日	2020年7 月3日	4.71	150,000	706,500 .00
2020 0619 0000	600478	科力远	2020年6月 19日	2020年7 月17日	4.71	55,500	261,405 .00

0454							
2020 0623 0000 0564	600478	科力远	2020年6月 23日	2020年7 月21日	4.71	50,000	235,500 .00
2020 0617 0000 3735	600549	厦门钨业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	11.84	284,000	3,362,5 60.00
2020 0629 0000 1169	600549	厦门钨业	2020年6月 29日	2020年7 月27日	11.84	15,200	179,968 .00
2020 0617 0000 2472	600563	法拉电子	2020年6月 17日	2020年7 月15日	61.80	10,000	618,000 .00
2020 0617 0000 2466	600563	法拉电子	2020年6月 17日	2020年7 月15日	61.80	17,000	1,050,6 00.00
2020 0617 0000 1797	600580	卧龙电驱	2020年6月 17日	2020年7 月15日	11.24	304,000	3,416,9 60.00
2020 0619 0000 0480	600580	卧龙电驱	2020年6月 19日	2020年7 月17日	11.24	42,400	476,576 .00
2020 0630 0000 2600	600580	卧龙电驱	2020年6月 30日	2020年7 月28日	11.24	36,000	404,640 .00
2020 0629 0000 0859	600580	卧龙电驱	2020年6月 29日	2020年7 月27日	11.24	21,900	246,156 .00
2020 0630 0000 2268	600699	均胜电子	2020年6月 30日	2020年7 月14日	23.81	10,000	238,100 .00
2020 0619 0000 0501	600699	均胜电子	2020年6月 19日	2020年7 月17日	23.81	80,700	1,921,4 67.00

2020 0617 0000 1865	600699	均胜电子	2020年6月 17日	2020年7 月15日	23.81	20,000	476,200 .00
2020 0630 0000 2610	600699	均胜电子	2020年6月 30日	2020年7 月28日	23.81	40,000	952,400 .00
2020 0618 0000 0553	600699	均胜电子	2020年6月 18日	2020年7 月2日	23.81	50,000	1,190,5 00.00
2020 0617 0000 1837	600699	均胜电子	2020年6月 17日	2020年7 月15日	23.81	43,000	1,023,8 30.00
2020 0617 0000 2532	600733	北汽蓝谷	2020年6月 17日	2020年7 月15日	6.43	50,000	321,500 .00
2020 0617 0000 2529	600733	北汽蓝谷	2020年6月 17日	2020年7 月15日	6.43	50,000	321,500 .00
2020 0617 0000 3384	600733	北汽蓝谷	2020年6月 17日	2020年7 月1日	6.43	10,000	64,300. 00
2020 0619 0000 0519	600733	北汽蓝谷	2020年6月 19日	2020年7 月17日	6.43	20,000	128,600 .00
2020 0624 0000 1267	600733	北汽蓝谷	2020年6月 24日	2020年7 月22日	6.43	167,300	1,075,7 39.00
2020 0617 0000 2526	600733	北汽蓝谷	2020年6月 17日	2020年7 月15日	6.43	102,000	655,860 .00
2020 0619 0000 0646	600884	杉杉股份	2020年6月 19日	2020年7 月17日	11.79	35,000	412,650 .00
2020	600884	杉杉股份	2020年6月	2020年7	11.79	508,805	5,998,8

0611 0000 0515			11 日	月 9 日			10.95
2020 0611 0000 0506	600884	杉杉股份	2020 年 6 月 11 日	2020 年 7 月 9 日	11.79	941,195	11,096, 689.05
2020 0619 0000 0652	600884	杉杉股份	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	11.79	35,400	417,366 .00
2020 0619 0000 0640	600884	杉杉股份	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	11.79	35,400	417,366 .00
2020 0619 0000 0627	600884	杉杉股份	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	11.79	35,500	418,545 .00
2020 0623 0000 0740	600884	杉杉股份	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	11.79	10,000	117,900 .00
2020 0619 0000 0603	600884	杉杉股份	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	11.79	30,000	353,700 .00
2020 0617 0000 4123	600885	宏发股份	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	40.12	97,000	3,891,6 40.00
2020 0629 0000 0997	601689	拓普集团	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 27 日	27.90	10,000	279,000 .00
2020 0619 0000 0540	601689	拓普集团	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	27.90	22,200	619,380 .00
2020 0617 0000 2848	601689	拓普集团	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	27.90	41,000	1,143,9 00.00
2020 0630	603026	石大胜华	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 14 日	26.69	17,200	459,068 .00

0000 2890							
2020 0617 0000 4154	603026	石大胜华	2020年6月 17日	2020年7 月15日	26.69	139,000	3,709,9 10.00
2020 0622 0000 3859	603659	璞泰来	2020年6月 22日	2020年7 月20日	103.02	11,000	1,133,2 20.00
2020 0619 0000 0555	603659	璞泰来	2020年6月 19日	2020年7 月17日	103.02	10,000	1,030,2 00.00
2020 0617 0000 3444	603659	璞泰来	2020年6月 17日	2020年7 月15日	103.02	10,000	1,030,2 00.00
2020 0619 0000 0570	603659	璞泰来	2020年6月 19日	2020年7 月17日	103.02	11,000	1,133,2 20.00
2020 0622 0000 3870	603659	璞泰来	2020年6月 22日	2020年7 月20日	103.02	10,000	1,030,2 00.00
2020 0617 0000 3430	603659	璞泰来	2020年6月 17日	2020年7 月15日	103.02	38,000	3,914,7 60.00
2020 0617 0000 3417	603659	璞泰来	2020年6月 17日	2020年7 月15日	103.02	10,000	1,030,2 00.00
2020 0611 0000 0389	603799	华友钴业	2020年6月 11日	2020年7 月9日	38.86	100,000	3,886,0 00.00
2020 0617 0000 2309	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	38.86	95,000	3,691,7 00.00
2020 0617 0000	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月1日	38.86	30,000	1,165,8 00.00

2791							
2020 0618 0000 0700	603799	华友钴业	2020年6月 18日	2020年7 月16日	38.86	47,500	1,845,8 50.00
2020 0618 0000 0712	603799	华友钴业	2020年6月 18日	2020年7 月16日	38.86	52,000	2,020,7 20.00
2020 0617 0000 2337	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	38.86	15,000	582,900 .00
2020 0618 0000 0717	603799	华友钴业	2020年6月 18日	2020年7 月16日	38.86	52,100	2,024,6 06.00
2020 0617 0000 2381	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	38.86	30,000	1,165,8 00.00
2020 0617 0000 2361	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	38.86	84,000	3,264,2 40.00
2020 0617 0000 4854	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	38.86	170,000	6,606,2 00.00
2020 0618 0000 0975	603799	华友钴业	2020年6月 18日	2020年7 月16日	38.86	52,200	2,028,4 92.00
2020 0617 0000 2280	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	38.86	30,000	1,165,8 00.00
2020 0617 0000 2373	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	38.86	36,000	1,398,9 60.00
2020 0617 0000 2753	603799	华友钴业	2020年6月 17日	2020年7 月1日	38.86	20,000	777,200 .00

2020 0617 0000 1105	603993	洛阳钼业	2020年6月 17日	2020年7 月15日	3.67	133,000	488,110 .00
2020 0624 0000 0416	603993	洛阳钼业	2020年6月 24日	2020年7 月22日	3.67	300,000	1,101,0 00.00
2020 0610 0000 0380	603993	洛阳钼业	2020年6月 10日	2020年7 月8日	3.67	250,000	917,500 .00
2020 0622 0000 5221	603993	洛阳钼业	2020年6月 22日	2020年7 月20日	3.67	600,000	2,202,0 00.00
合计	-	-	-	-	-	17,442,8 00	308,420 ,923.00

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人招商证券开立于平安银行的托管账户中，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度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单

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度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度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度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单

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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

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、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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2020年6月30日					
资产					
银行存款	28,533,906.61	-	-	-	28,533,906.61
结算备付金	6,519,554.47	-	-	-	6,519,554.47
存出保证金	10,137,655.65	-	-	-	10,137,655.65
交易性金融资产	-	-	-	-4,831,954,267.45	4,831,954,267.45
应收利息	-	-	-	190,589.77	190,589.77
应收股利	-	-	-	248,597.00	248,597.00
应收证券清算款	-	-	-	5,427,882.71	5,427,882.71
其他资产	-	-	-	661,993.66	661,993.66
资产总计	45,191,116.73	-	-	-4,838,483,330.59	4,883,674,447.32
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	624,401.06	624,401.06
应付托管费	-	-	-	208,133.67	208,133.67
应付证券清算款	-	-	-	1,022,658.62	1,022,658.62
应付交易费用	-	-	-	3,211,991.56	3,211,991.56
其他负债	-	-	-	11,332,362.21	11,332,362.21
负债总计	-	-	-	16,399,547.12	16,399,547.12
利率敏感度缺口	45,191,116.73	-	-	-4,822,083,783.47	4,867,274,900.20
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	288,470,000.00	-	-	-	288,470,000.00
交易性金融资产	-	-	-	41,060.00	41,060.00
应收利息	-	-	-	83,444.31	83,444.31
资产总计	288,470,000.00	-	-	124,504.31	288,594,504.31
负债					
其他负债	-	-	-	543.48	543.48
负债总计	-	-	-	543.48	543.48
利率敏感度缺口	288,470,000.00	-	-	123,960.83	288,593,960.83

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注:无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注:无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

本基金采用完全复制法,跟踪中证新能源汽车产业指数,以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资于中证新能源汽车产业指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。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,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	4,831,954,267.45	99.27	41,060.00	0.01
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	4,831,954,267.45	99.27	41,060.00	0.01

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%	391,412,957.86	2,274.39
	2. 业绩比较基准减少 5%	-391,412,957.86	-2,274.39

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	4,831,954,267.45	98.94
	其中：股票	4,831,954,267.45	98.94
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	35,053,461.08	0.72
8	其他各项资产	16,666,718.79	0.34
9	合计	4,883,674,447.32	100.00

注：注：1、投资组合报表中股票投资市值与按行业分类股票投资组合报表中股票总市值之间的差异是由于可退替代款估值增值引起的；

2、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务融出证券市值为 308,420,923, 占基金资产净值比例 6.34%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	156,688,539.75	3.22
C	制造业	4,640,743,661.92	95.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	33,907,787.65	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	4,831,339,989.32	99.26

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	589,414.24	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	614,278.13	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,345,190	408,907,328.40	8.40
2	002594	比亚迪	5,487,648	394,013,126.40	8.10
3	300014	亿纬锂能	5,560,416	266,065,905.60	5.47
4	002460	赣锋锂业	4,628,143	247,929,620.51	5.09
5	300124	汇川技术	6,284,838	238,760,995.62	4.91
6	002050	三花智控	10,855,280	237,730,632.00	4.88
7	603799	华友钴业	4,139,632	160,866,099.52	3.31
8	002812	恩捷股份	2,431,507	159,993,160.60	3.29
9	603993	洛阳钼业	42,694,425	156,688,539.75	3.22
10	300450	先导智能	3,188,784	147,353,708.64	3.03
11	002179	中航光电	3,332,234	136,654,916.34	2.81
12	002074	国轩高科	4,764,661	127,883,501.24	2.63
13	300207	欣旺达	6,620,100	125,119,890.00	2.57

14	002466	天齐锂业	5,360,579	123,025,288.05	2.53
15	002340	格林美	23,136,200	114,986,914.00	2.36
16	600885	宏发股份	2,698,241	108,253,428.92	2.22
17	600699	均胜电子	4,491,765	106,948,924.65	2.20
18	600066	宇通客车	8,029,070	97,954,654.00	2.01
19	300037	新宙邦	1,486,574	81,850,764.44	1.68
20	603659	璞泰来	788,900	81,272,478.00	1.67
21	600884	杉杉股份	6,867,388	80,966,504.52	1.66
22	300457	赢合科技	2,385,396	76,046,424.48	1.56
23	300001	特锐德	3,619,390	75,790,026.60	1.56
24	601689	拓普集团	2,553,300	71,237,070.00	1.46
25	300073	当升科技	2,115,900	69,972,813.00	1.44
26	600733	北汽蓝谷	10,534,700	67,738,121.00	1.39
27	300618	寒锐钴业	985,615	61,127,842.30	1.26
28	600549	厦门钨业	5,108,160	60,480,614.40	1.24
29	002126	银轮股份	4,770,500	58,390,920.00	1.20
30	002709	天赐材料	1,658,221	56,031,287.59	1.15
31	002056	横店东磁	4,970,467	55,917,753.75	1.15
32	600580	卧龙电驱	4,722,800	53,084,272.00	1.09
33	600563	法拉电子	816,016	50,429,788.80	1.04
34	000970	中科三环	5,129,857	50,170,001.46	1.03
35	002407	多氟多	4,135,800	44,004,912.00	0.90
36	002850	科达利	513,700	35,548,040.00	0.73
37	300568	星源材质	1,875,075	34,913,896.50	0.72
38	000887	中鼎股份	4,374,100	34,336,685.00	0.71
39	002091	江苏国泰	5,604,593	33,907,787.65	0.70
40	600478	科力远	6,932,111	32,650,242.81	0.67
41	002276	万马股份	4,366,700	31,178,238.00	0.64
42	600114	东睦股份	2,597,700	26,964,126.00	0.55
43	603026	石大胜华	858,300	22,908,027.00	0.47
44	300224	正海磁材	2,454,300	21,254,238.00	0.44
45	603305	旭升股份	552,400	21,145,872.00	0.43
46	002510	天汽模	4,401,900	18,752,094.00	0.39
47	002518	科士达	1,414,378	17,538,287.20	0.36
48	300769	德方纳米	135,280	13,173,566.40	0.27
49	002101	广东鸿图	1,578,900	10,847,043.00	0.22
50	002454	松芝股份	2,240,400	10,440,264.00	0.21
51	300745	欣锐科技	330,710	6,088,371.10	0.13
52	300742	越博动力	272,788	6,044,982.08	0.12

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	688518	联赢激光	14,111	293,932.13	0.01
2	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
3	688277	天智航-U	8,810	106,072.40	0.00
4	300824	北鼎股份	1,954	26,789.34	0.00
5	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
6	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
7	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
8	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
9	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
10	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
11	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
12	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%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	300750	宁德时代	1,100,576,475.25	381.36
2	002594	比亚迪	743,257,047.76	257.54
3	002460	赣锋锂业	542,787,851.11	188.08
4	300014	亿纬锂能	520,158,717.79	180.24
5	300124	汇川技术	419,240,324.97	145.27
6	002050	三花智控	388,721,056.21	134.69
7	002466	天齐锂业	374,614,954.79	129.81
8	300450	先导智能	343,630,017.02	119.07
9	002812	恩捷股份	316,969,845.86	109.83
10	300207	欣旺达	306,929,620.51	106.35
11	002340	格林美	306,896,564.11	106.34
12	002179	中航光电	269,049,178.05	93.23
13	002074	国轩高科	255,347,997.85	88.48
14	000625	长安汽车	252,811,862.32	87.60
15	300001	特锐德	189,869,153.48	65.79
16	300073	当升科技	155,830,171.08	54.00
17	300618	寒锐钴业	151,029,154.84	52.33
18	002056	横店东磁	129,933,236.62	45.02
19	300037	新宙邦	124,824,840.87	43.25
20	000970	中科三环	119,038,303.26	41.25
21	002126	银轮股份	114,162,924.77	39.56
22	002709	天赐材料	113,618,449.62	39.37
23	002407	多氟多	111,399,396.26	38.60

24	000887	中鼎股份	96,131,139.61	33.31
25	300457	赢合科技	83,111,317.48	28.80
26	603799	华友钴业	82,743,772.07	28.67
27	002091	江苏国泰	82,731,896.42	28.67
28	300568	星源材质	79,602,632.09	27.58
29	600733	北汽蓝谷	72,705,515.43	25.19
30	603993	洛阳钼业	63,902,591.15	22.14
31	002510	天汽模	62,331,191.53	21.60
32	000957	中通客车	45,555,663.18	15.79
33	300224	正海磁材	43,628,958.60	15.12
34	002518	科士达	41,454,536.81	14.36
35	600104	上汽集团	41,208,346.87	14.28
36	002276	万马股份	38,150,782.95	13.22
37	002850	科达利	33,438,480.00	11.59
38	002101	广东鸿图	32,560,034.83	11.28
39	600066	宇通客车	28,146,360.98	9.75
40	002454	松芝股份	28,094,175.35	9.73
41	600699	均胜电子	26,854,348.36	9.31
42	600885	宏发股份	25,818,724.84	8.95
43	603026	石大胜华	23,971,092.12	8.31
44	300742	越博动力	23,809,774.74	8.25
45	300745	欣锐科技	22,751,317.70	7.88
46	603659	璞泰来	22,264,376.25	7.71
47	600884	杉杉股份	19,727,326.76	6.84
48	300769	德方纳米	17,384,424.60	6.02
49	600549	厦门钨业	16,390,223.92	5.68
50	600418	江淮汽车	16,145,027.26	5.59
51	600580	卧龙电驱	15,991,123.89	5.54
52	601689	拓普集团	15,976,538.99	5.54
53	600563	法拉电子	13,733,953.00	4.76
54	601238	广汽集团	9,298,972.96	3.22
55	603305	旭升股份	8,995,925.00	3.12
56	600478	科力远	8,400,388.28	2.91
57	600114	东睦股份	7,313,870.00	2.53

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%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	300750	宁德时代	739,532,331.05	256.25
2	002594	比亚迪	392,826,767.52	136.12
3	300014	亿纬锂能	305,775,425.76	105.95
4	002460	赣锋锂业	268,399,015.55	93.00

5	600104	上汽集团	259,589,683.81	89.95
6	000625	长安汽车	255,919,735.87	88.68
7	300124	汇川技术	237,766,764.29	82.39
8	002050	三花智控	212,221,975.04	73.54
9	300450	先导智能	171,209,028.63	59.33
10	002466	天齐锂业	166,583,500.67	57.72
11	002812	恩捷股份	157,381,669.71	54.53
12	002340	格林美	155,030,120.32	53.72
13	002074	国轩高科	140,462,571.42	48.67
14	002179	中航光电	136,473,735.40	47.29
15	300207	欣旺达	135,473,304.08	46.94
16	300001	特锐德	94,830,286.78	32.86
17	300073	当升科技	81,388,087.45	28.20
18	600418	江淮汽车	75,762,886.60	26.25
19	300618	寒锐钴业	71,875,694.02	24.91
20	002056	横店东磁	68,355,326.76	23.69
21	300037	新宙邦	67,480,721.39	23.38
22	002709	天赐材料	63,163,568.45	21.89
23	000970	中科三环	58,390,605.62	20.23
24	002126	银轮股份	57,868,213.25	20.05
25	002407	多氟多	55,019,410.72	19.06
26	601238	广汽集团	54,290,015.65	18.81
27	000887	中鼎股份	47,933,170.06	16.61
28	000957	中通客车	39,833,486.76	13.80
29	300568	星源材质	39,633,582.16	13.73
30	002091	江苏国泰	35,804,588.26	12.41
31	600525	长园集团	31,682,574.05	10.98
32	002510	天汽模	29,228,685.59	10.13
33	600366	宁波韵升	24,670,216.05	8.55
34	002518	科士达	20,761,852.05	7.19
35	300224	正海磁材	18,939,115.77	6.56
36	002101	广东鸿图	18,288,991.11	6.34
37	300742	越博动力	18,090,920.84	6.27
38	603659	璞泰来	16,415,447.03	5.69
39	603799	华友钴业	15,578,259.50	5.40
40	300745	欣锐科技	15,494,148.80	5.37
41	002454	松芝股份	14,416,169.24	5.00
42	600686	金龙汽车	10,995,499.88	3.81
43	300457	赢合科技	10,412,340.01	3.61
44	600563	法拉电子	7,999,521.37	2.77

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	8,612,468,021.25
卖出股票收入（成交）总额	4,941,556,157.29

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

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

本组合投资的前十名证券之一赣锋锂业，因未及时披露公司重大事项，中国证券监督管理委员会

员会江西监管局于 2020 年 4 月 13 日依据相关法规给予出具警示函处分决定。

本组合投资的前十名证券之一中航光电, 中小板公司管理部于 2019 年 7 月 1 日做出中小板监管函【2019】第 118 号, 责令上市公司进行改正。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

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	10,137,655.65
2	应收证券清算款	5,427,882.71
3	应收股利	248,597.00
4	应收利息	190,589.77
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.91
8	其他	586,583.75
9	合计	16,666,718.79

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注: 本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注: 本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在受限流通情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位: 人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688518	联赢激光	293,932.13	0.01	新股锁定
2	688277	天智航-U	106,072.40	-	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
104,083	39,569.48	1,067,283,979.00	25.91	3,051,226,211.00	74.09

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	华西证券股份有限公司	89,558,200.00	2.17
2	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	79,518,300.00	1.93
3	华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	68,594,100.00	1.67
4	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	65,000,000.00	1.58
5	泰山财产保险股份有限公司—自有资金	54,000,000.00	1.31
6	中国石油天然气集团有限公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	51,057,000.00	1.24
7	友邦保险有限公司北京分公司—传统—普通保险产品	42,283,500.00	1.03
8	上海久事（集团）有限公司	41,900,000.00	1.02
9	渤海证券股份有限公司	41,007,000.00	1.00
10	民生通惠资产—工商银行—民生通惠通汇 2 号资产管理产品	39,980,000.00	0.97

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	27,200.00	0.0007

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年12月31日） 基金份额总额	288,510,190.00
本报告期期初基金份额总额	288,510,190.00
本报告期基金总申购份额	9,072,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,242,000,000.00
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	4,118,510,190.00

§ 10 重大事件揭示**10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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	
招商证券	4	13,552,289,359.65	100.00%	9,639,760.44	100.00%	新增 2个
长江证券	2	-	-	-	-	新增
国泰君安 证券	2	-	-	-	-	新增
国信证券	2	-	-	-	-	新增

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

招商证券	-	-	253,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

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	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月2日
2	关于平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议调整申购赎回相关条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
3	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
4	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
5	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
6	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
7	关于调整平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费收取下限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月22日
8	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月22日
9	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月22日
10	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月5日
11	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金上市交易公告书	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月5日
12	关于新增平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月13日
13	平安基金管理有限公司高级管理人员	中国证监会规定报刊及	2020年2月29日

	变更公告	网站	
14	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增兴业证券为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 30 日
15	平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 21 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

注：无。

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中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 2、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
- 3、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
- 4、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；
- 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 28 日