

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 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商银行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	8
§ 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	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	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	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	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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
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	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49

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	49
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	49
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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	56
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	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	粤港澳大湾区 ETF
场内简称	湾区 ETF (扩位证券简称: 大湾区 ETF)
基金主代码	512970
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 23 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,217,987,638.00 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	2019 年 11 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证粤港澳大湾区发展主题指数收益率
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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798

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 55 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 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	罗春风	陈四清

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	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	419,478,950.09
本期利润	281,962,146.51
加权平均基金份额本期利润	0.1165
本期加权平均净值利润率	11.14%
本期基金份额净值增长率	8.82%
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	155,312,040.26
期末可供分配基金份额利润	0.1275
期末基金资产净值	1,373,299,678.26
期末基金份额净值	1.1275
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	12.75%

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。

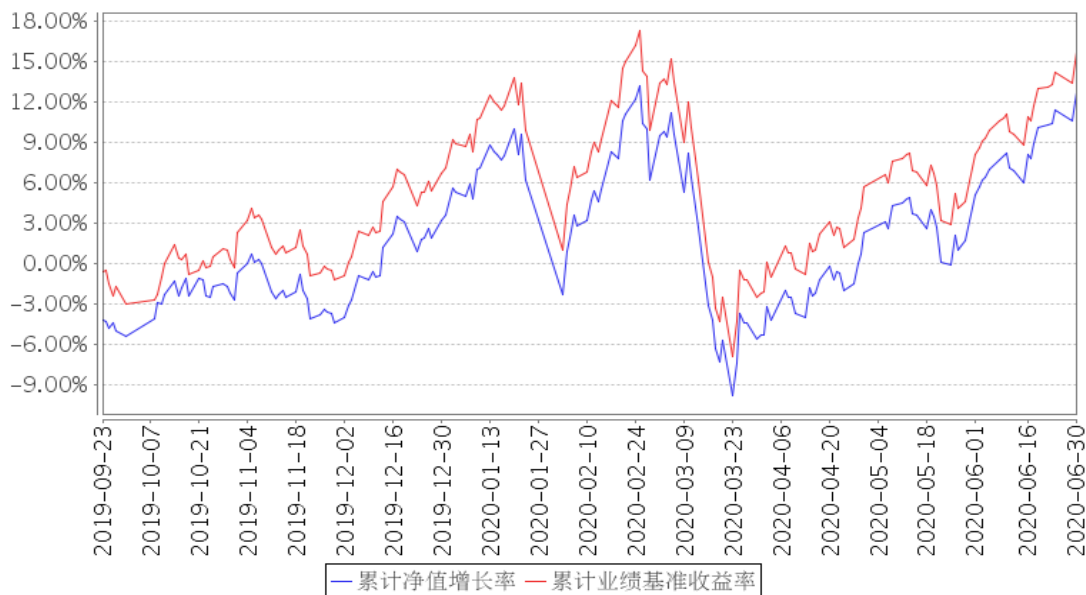
3.2 基金净值表现

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	10.85%	1.03%	10.64%	1.04%	0.21%	-0.01%
过去三个月	19.04%	1.11%	18.22%	1.12%	0.82%	-0.01%
过去六个月	8.82%	1.76%	7.96%	1.77%	0.86%	-0.01%
自基金合同生效起至今	12.75%	1.52%	15.68%	1.51%	-2.93%	0.01%

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

粤港澳大湾区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 09 月 23 日生效，截至本报告期末基金成立未满一年；

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

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		
成钧	ETF 指数中心指数投资总监，平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2019 年 9 月 23 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。
刘洁倩	平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2019 年 10 月 11 日	-	7 年	刘洁倩，浙江大学博士，曾担任国泰基金管理有限公司产品研究主管。2018 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究员、基金经理助理。现任平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
董俊玲	平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2019 年 10 月 16 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	平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券	2019 年 12 月 12 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

<p>投资基金 基金经理 助理</p>					<p>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。</p>
-----------------------------	--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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。

3、本基金的基金经理刘洁倩女士因个人原因（休产假）无法正常履行职务，自 2020 年 3 月 2 日起，由本基金共同管理的基金经理成钧代为管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

作为一只投资于粤港澳大湾区主题公司的被动型产品，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，本基金的日均偏离度为 0.02%，年化跟踪误差 0.61%，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 1.1275 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.82%，业绩比较基准收益率为 7.96%。

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

本报告期内，本基金托管人在对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的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，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的管理人——平安基金管理有限公司在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的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的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 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、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

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2020年6月30日	2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,217,044.92	14,719,767.64
结算备付金		920,406.10	17,290,450.69
存出保证金		738,999.74	940,593.84
交易性金融资产	6.4.7.2	1,353,423,222.07	5,100,491,879.95
其中：股票投资		1,353,423,222.07	5,100,491,879.95
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		15,884,783.97	-
应收利息	6.4.7.5	46,145.11	129,538.89
应收股利		66,908.31	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	25,988,834.15	33,531.98
资产总计		1,401,286,344.37	5,133,605,762.99
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		1,184,309.39	3,663,695.80
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		207,018.70	659,299.77
应付托管费		69,006.26	219,766.59
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	487,281.56	7,634,886.82
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	26,039,050.20	1,002,732.63
负债合计		27,986,666.11	13,180,381.61
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	1,217,987,638.00	4,941,987,638.00
未分配利润	6.4.7.10	155,312,040.26	178,437,743.38
所有者权益合计		1,373,299,678.26	5,120,425,381.38

负债和所有者权益总计		1,401,286,344.37	5,133,605,762.99
------------	--	------------------	------------------

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1275 元，基金份额总额 1,217,987,638.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

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		290,832,161.01
1. 利息收入		421,924.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	108,301.16
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		76,679.12
证券出借利息收入		236,944.38
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		420,180,554.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	405,043,323.10
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	15,137,231.73
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-137,516,803.58
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	7,746,485.10
减：二、费用		8,870,014.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,937,806.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	645,935.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-
4. 交易费用	6.4.7.19	5,664,278.14
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	621,994.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		281,962,146.51
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		281,962,146.51
-------------------	--	----------------

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	4,941,987,638.00	178,437,743.38	5,120,425,381.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	281,962,146.51	281,962,146.51
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）	-3,724,000,000.00	-305,087,849.63	-4,029,087,849.63
其中：1. 基金申购款	21,000,000.00	1,288,512.04	22,288,512.04
2. 基金赎回款	-3,745,000,000.00	-306,376,361.67	-4,051,376,361.67
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）	1,217,987,638.00	155,312,040.26	1,373,299,678.26

报表附注为财务报表的组成部分。

罗春风

基金管理人负责人

林婉文

主管会计工作负责人

张南南

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

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(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2117号《关于准予平安中证粤

《粤港澳大湾区发展主题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《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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 6,009,960,641.00 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 0497 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 9 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,009,987,638.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 26,997.00 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]229 号审核同意，本基金 6,009,987,638.00 份基金份额于 2019 年 11 月 11 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《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证粤港澳大湾区发展主题指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，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。本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证粤港澳大湾区发展主题指数收益率。

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》、《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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[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

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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	4,217,044.92
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	4,217,044.92

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	1,200,843,190.04	1,353,423,222.07	152,580,032.03
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,200,843,190.04	1,353,423,222.07	152,580,032.03

注：于 2020 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 4,312.00。

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	633.80
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	372.78
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	44,839.28
其他	299.25
合计	46,145.11

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	25,913,424.24

合计	25,988,834.15
----	---------------

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	487,281.56
银行间市场应付交易费用	-
合计	487,281.56

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	124,316.92
应付指数使用费	121,735.22
应退替代款	25,181,907.76
可退替代款	611,090.30
合计	26,039,050.20

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	4,941,987,638.00	4,941,987,638.00
本期申购	21,000,000.00	21,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,745,000,000.00	-3,745,000,000.00
- 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	1,217,987,638.00	1,217,987,638.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

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	-100,884,195.75	279,321,939.13	178,437,743.38
本期利润	419,478,950.09	-137,516,803.58	281,962,146.51
本期基金份额交易产生的变动数	-143,029,130.12	-162,058,719.51	-305,087,849.63
其中：基金申购款	575,603.95	712,908.09	1,288,512.04

基金赎回款	-143,604,734.07	-162,771,627.60	-306,376,361.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	175,565,624.22	-20,253,583.96	155,312,040.26

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	63,036.89
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	35,531.98
其他	9,732.29
合计	108,301.16

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	416,180,471.34
股票投资收益——赎回差价收入	-11,137,148.24
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	405,043,323.10

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	3,016,178,385.89
减：卖出股票成本总额	2,599,997,914.55
买卖股票差价收入	416,180,471.34

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	4,051,376,361.67
减：现金支付赎回款总额	2,756,354,763.67

减：赎回股票成本总额	1,306,158,746.24
赎回差价收入	-11,137,148.24

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产生的证券出借差价收入。

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	15,137,231.73
其中：证券出借权益补偿收入	189,078.64
基金投资产生的股利收益	-
合计	15,137,231.73

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	-137,516,803.58
股票投资	-137,516,803.58
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	-137,516,803.58

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为 4,312.00。

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	7,746,485.10
合计	7,746,485.10

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	5,664,278.14
银行间市场交易费用	-
合计	5,664,278.14

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	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	526.30
指数使用费	387,561.25
上市费	35,000.00
登记结算费	74,590.09
IOPV 计算费	9,944.48
合计	621,994.56

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
工商银行	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
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
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

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

本基金合同于 2019 年 9 月 23 日生效，无上年度可比期间数据。

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 (%)
平安证券	835,007,866.71	25.28

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内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

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 (%)
平安证券	10,000,000.00	1.13

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 (%)
平安证券	593,942.19	25.28	-	-

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	1,937,806.30
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：支付基金管理人平安基金管理有限公司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：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.15%/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	645,935.50

注：支付基金托管人工商银行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：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/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

注：本基金本报告期内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

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(%)
平安人寿	100,012,730.00	8.2113	100,012,730.00	2.0237

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
工商银行	4,217,044.92	63,036.89

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，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

为了更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人最终控股母公司中国平安保险(集团)股份有限公司发行的股票中国平安和于与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司平安银行发行的股票平安银行。

(1) 于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有 1,686,913 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 145,375,843.73 元，估值总额为人民币 120,445,588.20 元，占基金资产净值的比例为 8.77%。

(2) 于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有 2,594,839 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 42,936,559.02 元，估值总额为人民币 33,213,939.20 元，占基金资产净值的比例为 2.42%。

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	-

			日							
688106	金宏气体	2020年6月9日	2020年12月16日	新股锁定	15.48	41.36	26,075	403,641.00	1,078,462.00	-
688277	天智航	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	-

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
202006160000190	000009	中国宝安	2020年6月16日	2020年7月14日	8.51	44,900	382,099.00
202006160000189	000009	中国宝安	2020年6月16日	2020年7月14日	8.51	45,000	382,950.00
202006160000198	000021	深科技	2020年6月16日	2020年7月14日	21.83	25,600	558,848.00
202006160000208	000027	深圳能源	2020年6月16日	2020年7月14日	4.64	49,800	231,072.00
2020	000031	大悦城	2020年6月	2020年7	5.09	44,800	228,032

0616 0000 0226			16 日	月 14 日			.00
2020 0616 0000 0227	000039	中集集团	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	7.23	37,200	268,956 .00
2020 0616 0000 0233	000050	深天马 A	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	15.36	71,400	1,096,7 04.00
2020 0616 0000 0250	000062	深圳华强	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	14.54	10,900	158,486 .00
2020 0622 0000 0377	000063	中兴通讯	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 6 日	40.13	16,600	666,158 .00
2020 0618 0000 0120	000063	中兴通讯	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 2 日	40.13	20,000	802,600 .00
2020 0622 0000 0382	000063	中兴通讯	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	40.13	70,700	2,837,1 91.00
2020 0622 0000 0386	000063	中兴通讯	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	40.13	30,700	1,231,9 91.00
2020 0617 0000 0513	000063	中兴通讯	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	40.13	10,000	401,300 .00
2020 0616 0000 0267	000066	中国长城	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	13.20	17,100	225,720 .00
2020 0616 0000 0265	000066	中国长城	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	13.20	17,100	225,720 .00
2020 0617	000066	中国长城	2020 年 6 月 17 日	2020 年 7 月 15 日	13.20	17,200	227,040 .00

0000 0516							
2020 0616 0000 0268	000069	华侨城 A	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	6.06	143,000	866,580 .00
2020 0616 0000 0284	000089	深圳机场	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	7.66	35,700	273,462 .00
2020 0618 0000 0144	000100	TCL 科技	2020 年 6 月 18 日	2020 年 7 月 2 日	6.20	30,000	186,000 .00
2020 0622 0000 0423	000100	TCL 科技	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	6.20	84,600	524,520 .00
2020 0629 0000 0204	000100	TCL 科技	2020 年 6 月 29 日	2020 年 7 月 13 日	6.20	126,200	782,440 .00
2020 0624 0000 0224	000100	TCL 科技	2020 年 6 月 24 日	2020 年 7 月 22 日	6.20	200,000	1,240,0 00.00
2020 0616 0000 0362	000513	丽珠集团	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	48.01	25,800	1,238,6 58.00
2020 0616 0000 0411	000555	神州信息	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	15.38	16,900	259,922 .00
2020 0622 0000 0731	000651	格力电器	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 20 日	56.57	10,000	565,700 .00
2020 0619 0000 0223	000651	格力电器	2020 年 6 月 19 日	2020 年 7 月 17 日	56.57	10,500	593,985 .00
2020 0616 0000	000690	宝新能源	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	4.72	60,500	285,560 .00

0482							
2020 0616 0000 0703	000967	盈峰环境	2020年6月 16日	2020年7 月14日	8.25	33,100	273,075 .00
2020 0616 0000 0732	000987	越秀金控	2020年6月 16日	2020年7 月14日	11.66	19,200	223,872 .00
2020 0616 0000 0769	000999	华润三九	2020年6月 16日	2020年7 月14日	29.19	13,600	396,984 .00
2020 0616 0000 0774	001914	招商积余	2020年6月 16日	2020年7 月14日	30.73	14,800	454,804 .00
2020 0623 0000 0248	001979	招商蛇口	2020年6月 23日	2020年7 月7日	16.44	13,800	226,872 .00
2020 0622 0000 1265	001979	招商蛇口	2020年6月 22日	2020年7 月6日	16.44	68,400	1,124,4 96.00
2020 0622 0000 1266	001979	招商蛇口	2020年6月 22日	2020年7 月20日	16.44	22,300	366,612 .00
2020 0619 0000 0252	002008	大族激光	2020年6月 19日	2020年7 月3日	35.95	33,800	1,215,1 10.00
2020 0616 0000 1605	002138	顺络电子	2020年6月 16日	2020年7 月14日	24.95	44,900	1,120,2 55.00
2020 0616 0000 1615	002152	广电运通	2020年6月 16日	2020年7 月14日	12.94	21,000	271,740 .00
2020 0616 0000 1608	002152	广电运通	2020年6月 16日	2020年7 月14日	12.94	21,000	271,740 .00

2020 0616 0000 1619	002152	广电运通	2020年6月 16日	2020年7 月14日	12.94	21,000	271,740 .00
2020 0616 0000 1609	002152	广电运通	2020年6月 16日	2020年7 月14日	12.94	21,000	271,740 .00
2020 0616 0000 1665	002180	纳思达	2020年6月 16日	2020年7 月14日	32.91	44,500	1,464,4 95.00
2020 0616 0000 2143	002191	劲嘉股份	2020年6月 16日	2020年7 月14日	8.91	30,500	271,755 .00
2020 0616 0000 2346	002294	信立泰	2020年6月 16日	2020年7 月14日	29.66	29,100	863,106 .00
2020 0616 0000 2387	002340	格林美	2020年6月 16日	2020年7 月14日	4.97	133,400	662,998 .00
2020 0616 0000 2426	002352	顺丰控股	2020年6月 16日	2020年7 月14日	54.70	23,000	1,258,1 00.00
2020 0616 0000 2551	002399	海普瑞	2020年6月 16日	2020年7 月14日	25.04	13,000	325,520 .00
2020 0616 0000 2572	002419	天虹股份	2020年6月 16日	2020年7 月14日	9.55	16,700	159,485 .00
2020 0624 0000 2265	002429	兆驰股份	2020年6月 24日	2020年7 月22日	4.95	49,800	246,510 .00
2020 0622 0000 3923	002429	兆驰股份	2020年6月 22日	2020年7 月20日	4.95	10,000	49,500. 00
2020	002465	海格通信	2020年6月	2020年7	12.94	100,000	1,294,0

0616 0000 2887			16 日	月 14 日			00.00
2020 0616 0000 2889	002465	海格通信	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	12.94	28,600	370,084 .00
2020 0623 0000 0310	002475	立讯精密	2020 年 6 月 23 日	2020 年 7 月 21 日	51.35	30,000	1,540,5 00.00
2020 0630 0000 1678	002475	立讯精密	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	51.35	197,200	10,126, 220.00
2020 0630 0000 1676	002475	立讯精密	2020 年 6 月 30 日	2020 年 7 月 28 日	51.35	200	10,270. 00
2020 0616 0000 2968	002572	索菲亚	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	24.17	22,200	536,574 .00
2020 0616 0000 2974	002583	海能达	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	7.59	14,200	107,778 .00
2020 0616 0000 2975	002583	海能达	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	7.59	50,000	379,500 .00
2020 0616 0000 3028	002670	国盛金控	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	9.15	40,400	369,660 .00
2020 0616 0000 3061	002745	木林森	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	15.41	17,800	274,298 .00
2020 0616 0000 3078	002797	第一创业	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	6.92	85,400	590,968 .00
2020 0616	002939	长城证券	2020 年 6 月 16 日	2020 年 7 月 14 日	12.32	32,500	400,400 .00

0000 3123							
2020 0617 0000 5547	300012	华测检测	2020年6月 17日	2020年7 月15日	19.76	20,000	395,200 .00
2020 0617 0000 5545	300012	华测检测	2020年6月 17日	2020年7 月1日	19.76	26,400	521,664 .00
2020 0616 0000 3156	300014	亿纬锂能	2020年6月 16日	2020年7 月14日	47.85	64,100	3,067,1 85.00
2020 0616 0000 3248	300124	汇川技术	2020年6月 16日	2020年7 月14日	37.99	72,400	2,750,4 76.00
2020 0616 0000 3261	300136	信维通信	2020年6月 16日	2020年7 月14日	53.02	54,000	2,863,0 80.00
2020 0629 0000 0662	300146	汤臣倍健	2020年6月 29日	2020年7 月13日	19.69	25,400	500,126 .00
2020 0616 0000 3304	300207	欣旺达	2020年6月 16日	2020年7 月14日	18.90	66,600	1,258,7 40.00
2020 0616 0000 3308	300207	欣旺达	2020年6月 16日	2020年7 月14日	18.90	10,000	189,000 .00
2020 0617 0000 6078	300454	深信服	2020年6月 17日	2020年7 月1日	205.96	10,000	2,059,6 00.00
2020 0617 0000 6113	300482	万孚生物	2020年6月 17日	2020年7 月15日	104.00	14,000	1,456,0 00.00
2020 0616 0000	300529	健帆生物	2020年6月 16日	2020年7 月14日	69.50	10,000	695,000 .00

3439							
2020 0616 0000 3453	300601	康泰生物	2020年6月 16日	2020年7 月14日	162.16	23,400	3,794,5 44.00
2020 0616 0000 3468	300676	华大基因	2020年6月 16日	2020年7 月14日	155.91	11,100	1,730,6 01.00
2020 0616 0000 3467	300760	迈瑞医疗	2020年6月 16日	2020年7 月14日	305.70	25,400	7,764,7 80.00
2020 0630 0000 2574	600004	白云机场	2020年6月 30日	2020年7 月28日	15.24	26,600	405,384 .00
2020 0616 0000 2705	600183	生益科技	2020年6月 16日	2020年7 月14日	29.27	39,600	1,159,0 92.00
2020 0616 0000 2072	600325	华发股份	2020年6月 16日	2020年7 月14日	7.06	58,900	415,834 .00
2020 0616 0000 1755	600332	白云山	2020年6月 16日	2020年7 月14日	32.33	19,600	633,668 .00
2020 0616 0000 1190	600380	健康元	2020年6月 16日	2020年7 月14日	16.24	67,900	1,102,6 96.00
2020 0616 0000 1768	600383	金地集团	2020年6月 16日	2020年7 月14日	13.70	78,700	1,078,1 90.00
2020 0616 0000 1335	600446	金证股份	2020年6月 16日	2020年7 月14日	19.40	14,000	271,600 .00
2020 0616 0000 1316	600446	金证股份	2020年6月 16日	2020年7 月14日	19.40	14,000	271,600 .00

2020 0616 0000 1021	600728	佳都科技	2020年6月 16日	2020年7 月14日	9.11	48,900	445,479 .00
2020 0616 0000 1035	600872	中炬高新	2020年6月 16日	2020年7 月14日	58.53	19,400	1,135,4 82.00
2020 0622 0000 5225	600999	招商证券	2020年6月 22日	2020年7 月20日	21.95	97,400	2,137,9 30.00
2020 0616 0000 1960	601333	广深铁路	2020年6月 16日	2020年7 月14日	2.25	118,000	265,500 .00
2020 0616 0000 1531	601615	明阳智能	2020年6月 16日	2020年7 月14日	12.45	38,400	478,080 .00
2020 0616 0000 1073	603160	汇顶科技	2020年6月 16日	2020年7 月14日	222.90	12,700	2,830,8 30.00
合计	-	-	-	-	-	3,675,50 0	86,209, 816.00

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行工商银行，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 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	4,217,044.92	-	-	-	4,217,044.92
结算备付金	920,406.10	-	-	-	920,406.10
存出保证金	738,999.74	-	-	-	738,999.74
交易性金融资产	-	-	-	1,353,423,222.07	1,353,423,222.07
应收利息	-	-	-	46,145.11	46,145.11
应收股利	-	-	-	66,908.31	66,908.31
应收证券清算款	-	-	-	15,884,783.97	15,884,783.97
其他资产	-	-	-	25,988,834.15	25,988,834.15
资产总计	5,876,450.76	-	-	1,395,409,893.61	1,401,286,344.37
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	207,018.70	207,018.70
应付托管费	-	-	-	69,006.26	69,006.26
应付证券清算款	-	-	-	1,184,309.39	1,184,309.39
应付交易费用	-	-	-	487,281.56	487,281.56
其他负债	-	-	-	26,039,050.20	26,039,050.20
负债总计	-	-	-	27,986,666.11	27,986,666.11
利率敏感度缺口	5,876,450.76	-	-	1,367,423,227.50	1,373,299,678.26
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	14,719,767.64	-	-	-	14,719,767.64
结算备付金	17,290,450.69	-	-	-	17,290,450.69
存出保证金	940,593.84	-	-	-	940,593.84
交易性金融资产	-	-	-	5,100,491,879.95	5,100,491,879.95
应收利息	-	-	-	129,538.89	129,538.89
应收证券清算款	-	-	-	33,531.98	33,531.98
资产总计	32,950,812.17	-	-	5,100,654,950.82	5,133,605,762.99
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	659,299.77	659,299.77
应付托管费	-	-	-	219,766.59	219,766.59
应付证券清算款	-	-	-	3,663,695.80	3,663,695.80
应付交易费用	-	-	-	7,634,886.82	7,634,886.82
其他负债	-	-	-	1,002,732.63	1,002,732.63
负债总计	-	-	-	13,180,381.61	13,180,381.61
利率敏感度缺口	32,950,812.17	-	-	5,087,474,569.21	5,120,425,381.38

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粤港澳大湾区发展主题指数，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。本基金投资于中证粤港澳大湾区发展主题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	1,353,423,222.07	98.55	5,100,491,879.95	99.61

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	1,353,423,222.07	98.55	5,100,491,879.95	99.61

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%	88,537,045.02	298,434,612.53
	2. 业绩比较基准减少5%	-88,537,045.02	-298,434,612.53

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	1,353,423,222.07	96.58
	其中：股票	1,353,423,222.07	96.58
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	5,137,451.02	0.37
8	其他各项资产	42,725,671.28	3.05
9	合计	1,401,286,344.37	100.00

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. 本基金本报告期末融出证券市值为 86,209,816.00，占净值比例 6.28%。

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	-	-
C	制造业	812,052,462.48	59.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,662,742.32	0.70
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	9,666,893.40	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	34,382,735.14	2.50
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,107,342.84	2.19
J	金融业	294,838,435.48	21.47
K	房地产业	112,554,847.86	8.20
L	租赁和商务服务业	15,182,399.65	1.11
M	科学研究和技术服务业	19,636,151.45	1.43
N	水利、环境和公共设施管理业	2,116,125.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,068,100.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	5,751,866.45	0.42
	合计	1,352,020,102.07	98.45

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	1,373,944.11	0.10
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	1,398,808.00	0.10

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	601318	中国平安	1,686,913	120,445,588.20	8.77
2	002475	立讯精密	2,227,417	114,377,862.95	8.33
3	600036	招商银行	2,746,532	92,613,059.04	6.74
4	000333	美的集团	1,303,777	77,952,826.83	5.68

5	000651	格力电器	1,277,839	72,287,352.23	5.26
6	000063	中兴通讯	1,436,955	57,665,004.15	4.20
7	300760	迈瑞医疗	186,247	56,935,707.90	4.15
8	000002	万科A	1,815,000	47,444,100.00	3.45
9	000001	平安银行	2,594,839	33,213,939.20	2.42
10	603288	海天味业	261,087	32,479,222.80	2.37
11	300601	康泰生物	185,720	30,116,355.20	2.19
12	600048	保利地产	1,905,667	28,165,758.26	2.05
13	300014	亿纬锂能	492,644	23,573,015.40	1.72
14	300136	信维通信	436,044	23,119,052.88	1.68
15	000100	TCL科技	3,598,300	22,309,460.00	1.62
16	603160	汇顶科技	94,700	21,108,630.00	1.54
17	300124	汇川技术	548,533	20,838,768.67	1.52
18	002352	顺丰控股	351,925	19,250,297.50	1.40
19	002594	比亚迪	241,573	17,344,941.40	1.26
20	300454	深信服	82,704	17,033,715.84	1.24
21	600999	招商证券	766,500	16,824,675.00	1.23
22	002008	大族激光	452,107	16,253,246.65	1.18
23	002027	分众传媒	2,725,745	15,182,399.65	1.11
24	001979	招商蛇口	843,065	13,859,988.60	1.01
25	002465	海格通信	988,516	12,791,397.04	0.93
26	300676	华大基因	81,295	12,674,703.45	0.92
27	000066	中国长城	933,850	12,326,820.00	0.90
28	300482	万孚生物	108,300	11,263,200.00	0.82
29	002180	纳思达	337,500	11,107,125.00	0.81
30	000776	广发证券	782,802	11,053,164.24	0.80
31	300207	欣旺达	580,052	10,962,982.80	0.80
32	000513	丽珠集团	192,961	9,264,057.61	0.67
33	600872	中炬高新	151,790	8,884,268.70	0.65
34	600183	生益科技	297,006	8,693,365.62	0.63
35	002138	顺络电子	342,000	8,532,900.00	0.62
36	600380	健康元	523,009	8,493,666.16	0.62
37	002152	广电运通	646,300	8,363,122.00	0.61
38	000050	深天马A	539,658	8,289,146.88	0.60
39	600383	金地集团	600,600	8,228,220.00	0.60
40	601138	工业富联	534,800	8,102,220.00	0.59
41	002736	国信证券	661,806	7,478,407.80	0.54
42	300529	健帆生物	104,780	7,282,210.00	0.53
43	300012	华测检测	352,300	6,961,448.00	0.51
44	000069	华侨城A	1,094,800	6,634,488.00	0.48
45	002294	信立泰	220,900	6,551,894.00	0.48
46	002841	视源股份	63,550	6,324,496.00	0.46

47	600446	金证股份	316,900	6,147,860.00	0.45
48	603882	金域医学	67,800	6,068,100.00	0.44
49	600029	南方航空	1,169,700	6,047,349.00	0.44
50	002920	德赛西威	97,100	5,955,143.00	0.43
51	000009	中国宝安	675,895	5,751,866.45	0.42
52	002340	格林美	1,035,700	5,147,429.00	0.37
53	600332	白云山	153,300	4,956,189.00	0.36
54	002916	深南电路	28,420	4,760,918.40	0.35
55	603233	大参林	58,320	4,736,750.40	0.34
56	003816	中国广核	1,573,400	4,657,264.00	0.34
57	002797	第一创业	668,200	4,623,944.00	0.34
58	603833	欧派家居	37,400	4,334,660.00	0.32
59	600004	白云机场	279,261	4,255,937.64	0.31
60	002572	索菲亚	175,483	4,241,424.11	0.31
61	000021	深科技	191,000	4,169,530.00	0.30
62	300146	汤臣倍健	207,879	4,093,137.51	0.30
63	002511	中顺洁柔	180,260	4,019,798.00	0.29
64	002583	海能达	493,300	3,744,147.00	0.27
65	601615	明阳智能	299,893	3,733,667.85	0.27
66	600728	佳都科技	377,300	3,437,203.00	0.25
67	001914	招商积余	110,700	3,401,811.00	0.25
68	002625	光启技术	452,700	3,282,075.00	0.24
69	600325	华发股份	440,400	3,109,224.00	0.23
70	002938	鹏鼎控股	61,784	3,092,907.04	0.23
71	002939	长城证券	250,800	3,089,856.00	0.22
72	000999	华润三九	102,598	2,994,835.62	0.22
73	002670	国盛金控	303,200	2,774,280.00	0.20
74	002399	海普瑞	97,700	2,446,408.00	0.18
75	002429	兆驰股份	483,300	2,392,335.00	0.17
76	601238	广汽集团	249,802	2,248,218.00	0.16
77	603228	景旺电子	62,169	2,187,727.11	0.16
78	002745	木林森	141,300	2,177,433.00	0.16
79	000089	深圳机场	283,000	2,167,780.00	0.16
80	000039	中集集团	298,180	2,155,841.40	0.16
81	000690	宝新能源	456,201	2,153,268.72	0.16
82	000967	盈峰环境	256,500	2,116,125.00	0.15
83	002191	劲嘉股份	231,300	2,060,883.00	0.15
84	601333	广深铁路	913,100	2,054,475.00	0.15
85	000555	神州信息	132,300	2,034,774.00	0.15
86	002815	崇达技术	91,659	1,854,261.57	0.14
87	000987	越秀金控	155,000	1,807,300.00	0.13
88	000027	深圳能源	386,640	1,794,009.60	0.13

89	000031	大悦城	336,200	1,711,258.00	0.12
90	300770	新媒股份	6,500	1,453,790.00	0.11
91	600685	中船防务	84,300	1,425,513.00	0.10
92	000028	国药一致	30,900	1,390,809.00	0.10
93	002419	天虹股份	130,400	1,245,320.00	0.09
94	000062	深圳华强	79,400	1,154,476.00	0.08
95	002867	周大生	51,400	1,139,538.00	0.08
96	601139	深圳燃气	162,800	1,058,200.00	0.08
97	002945	华林证券	66,200	914,222.00	0.07
98	300616	尚品宅配	11,400	684,912.00	0.05
99	600548	深高速	66,400	606,896.00	0.04
100	002957	科瑞技术	12,500	298,750.00	0.02

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	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.08
2	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.01
3	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.01
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%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	300760	迈瑞医疗	47,455,986.25	0.93
2	601318	中国平安	29,071,556.00	0.57
3	000063	中兴通讯	15,531,186.81	0.30
4	300482	万孚生物	13,415,956.00	0.26
5	002841	视源股份	12,023,284.89	0.23
6	300454	深信服	9,231,877.08	0.18
7	002916	深南电路	8,963,302.00	0.18
8	000002	万科A	7,411,428.00	0.14
9	002352	顺丰控股	7,172,267.00	0.14

10	603160	汇顶科技	6,508,967.55	0.13
11	002475	立讯精密	6,332,938.70	0.12
12	003816	中国广核	6,301,292.00	0.12
13	000021	深科技	6,181,399.42	0.12
14	300770	新媒股份	6,153,690.00	0.12
15	002340	格林美	6,025,607.00	0.12
16	000651	格力电器	5,446,775.00	0.11
17	300529	健帆生物	5,116,498.00	0.10
18	000333	美的集团	4,836,848.00	0.09
19	001914	招商积余	4,679,631.00	0.09
20	300616	尚品宅配	4,667,168.00	0.09

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	002475	立讯精密	289,732,960.02	5.66
2	000651	格力电器	283,385,686.07	5.53
3	000333	美的集团	257,300,192.23	5.02
4	000063	中兴通讯	208,101,532.44	4.06
5	000002	万科A	161,934,130.64	3.16
6	000001	平安银行	136,786,452.28	2.67
7	300760	迈瑞医疗	75,936,561.24	1.48
8	000100	TCL 科技	75,487,515.37	1.47
9	300601	康泰生物	71,416,789.56	1.39
10	300136	信维通信	67,796,742.90	1.32
11	300014	亿纬锂能	63,897,983.25	1.25
12	002008	大族激光	63,771,969.15	1.25
13	300124	汇川技术	60,650,890.63	1.18
14	002594	比亚迪	55,955,270.20	1.09
15	002027	分众传媒	54,859,721.78	1.07
16	001979	招商蛇口	53,532,178.81	1.05
17	000066	中国长城	49,474,344.17	0.97
18	300454	深信服	48,083,607.03	0.94
19	300207	欣旺达	44,926,697.24	0.88
20	002465	海格通信	43,014,183.81	0.84

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	289,361,678.49
卖出股票收入（成交）总额	3,016,178,385.89

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招商银行，因未依法履行其他职责，全国银行间同业拆借中心于 2019 年 7 月 8 日依据相关法规给予内部通报批评处分决定。

本组合投资的前十名证券之一平安银行，中国银保监会深圳监管局于 2020 年 1 月 20 日做出

深银保监罚决字〔2020〕7号，由于平安银行股份有限公司：1. 汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成；2. 代理保险销售的人员为非商业银行人员；3. 汽车消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；4. 个人消费贷款风险分类结果不能反映真实风险水平；5. 个人经营性贷款分类结果不能反映真实风险水平；6. 汽车消费贷款和汽车抵押贷款贷前调查存在缺失；7. 汽车消费及经营贷款审查不到位；8. 个人汽车贷款和汽车抵押贷款业务存在同一抵押物重复抵押；9. 个别汽车消费贷款和汽车抵押贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；10. 个人消费贷款及个人经营性贷款用途管控不力，贷款资金被挪用；11. 部分个人消费贷款未按要求进行受托支付；12. 信用卡现金分期用途管控不力；13. 代销产品风险评级结果与合作机构评级结果不一致，未采用较高风险评级的评级结果；14. 代销产品底层资产涉及本行非标资产，没有实现代销业务与其他业务的风险隔离；15. “双录”管理审慎性不足，理财销售人员销售话术不当。根据相关规定对公司罚款720万元。

平安银行因未依法履行其他职责，全国银行间同业拆借中心于2019年7月8日依据相关法规给予内部通报批评处分决定。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为有效跟踪标的指数，控制跟踪偏离和跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成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	738,999.74
2	应收证券清算款	15,884,783.97
3	应收股利	66,908.31
4	应收利息	46,145.11
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.91
8	其他	25,913,424.24
9	合计	42,725,671.28

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不存在流通受限的情况。

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	688106	金宏气体	1,078,462.00	0.08	新股锁定
2	688277	天智航	106,072.40	0.01	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 (%)
917	1,328,230.79	1,190,991,211.00	97.78	26,996,427.00	2.22

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	安邦人寿保险股份有限公司—保守型投资组合	1,090,471,396.00	89.53
2	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红	100,012,730.00	8.21
3	杨德凤	1,130,000.00	0.09
4	周旭	1,008,000.00	0.08
5	来永珍	1,000,000.00	0.08
6	陶莉	1,000,000.00	0.08
7	林德伟	999,800.00	0.08

8	王静	508,100.00	0.04
9	华咬脐	500,000.00	0.04
10	李平	442,900.00	0.04

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

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9月23日） 基金份额总额	6,009,987,638.00
本报告期期初基金份额总额	4,941,987,638.00
本报告期基金总申购份额	21,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,745,000,000.00
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	1,217,987,638.00

§ 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	3	1,344,525,034.42	40.70%	956,366.02	40.70%	增加1个
平安证券	2	835,007,866.71	25.28%	593,942.19	25.28%	-
国盛证券	1	709,238,722.18	21.47%	504,484.84	21.47%	新增
长江证券	1	271,594,290.13	8.22%	193,186.90	8.22%	新增
中信建投证券	2	65,147,839.51	1.97%	46,340.87	1.97%	-
海通证券	4	39,629,207.62	1.20%	28,188.28	1.20%	-
广发证券	2	29,762,708.13	0.90%	21,171.31	0.90%	增加1个
中泰证券	2	8,535,354.40	0.26%	6,071.02	0.26%	-
爱建证券	2	-	-	-	-	退租
东方证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
新时代证	3	-	-	-	-	-

券						
长城证券	2	-	-	-	-	退租

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。其中招商证券的一个席位作为申赎本基金的专用席位。

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	-	-	24,000,000.00	2.71%	-	-
平安证券	-	-	10,000,000.00	1.13%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	34,000,000.00	3.83%	-	-
海通证券	-	-	380,000,000.00	42.84%	-	-
广发证券	-	-	338,000,000.00	38.11%	-	-
中泰证券	-	-	101,000,000.00	11.39%	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

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	关于平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日

	合同、托管协议调整申购赎回相关条款的公告		
2	平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
3	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
4	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	平安中证粤港澳大湾区发展主题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	关于新增方正证券为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1月17日
7	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 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
8	关于调整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
9	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	平安中证粤港澳大湾区发展主题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
11	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
12	平安基金管理有限公司关于基金经理代为履行职务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月29日
13	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
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	平安中证粤港澳大湾区发展主题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22日
16	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 2019 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020年4月30日
17	关于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调整	中国证监会规定报刊及网站	2020年5月23日

最小申购、赎回单位的公告		
--------------	--	--

§ 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	1	2020/01/01—2020/06/30	4,754,178,655.00	-	3,663,707,259.00	1,090,471,396.00	89.53
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元,基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

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粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金设立的文件;
- 2、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同;
- 3、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托管协议;
- 4、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