

平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资 基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 08 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告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	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
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	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	40
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	40
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	40
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	40
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	40
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	40
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	42
§ 9 开放式基金份额变动	42
§ 10 重大事件揭示	42
10.1 基金份额持有人大会决议	42
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	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	43
10.4 基金投资策略的改变	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	43
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	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8 其他重大事件	47
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§ 12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金
基金简称	平安中证沪港深高股息
基金主代码	003702
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 1 月 25 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,132,243.65 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证沪港深高股息精选指数。在正常市场情况下，力争将基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值控制在 0.35% 以内，年跟踪误差控制在 4% 以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金，原则上采用指数复制法，按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期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，基金管理人可以根据市场情况，采取合理措施，在合理期限内进行适当的处理和调整，力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。本基金力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证沪港深高股息精选指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金还将投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn

客户服务电话	400-800-4800	95511-3
传真	0755-23997878	0755-82080387
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 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	深圳市福田区益田路 5023 号平安 金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	-9,918.63
本期利润	-578,200.24
加权平均基金份额本期利润	-0.0509
本期加权平均净值利润率	-5.24%
本期基金份额净值增长率	-3.91%
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	-200,248.85
期末可供分配基金份额利润	-0.0281
期末基金资产净值	6,931,994.80
期末基金份额净值	0.9719
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	-2.81%

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。

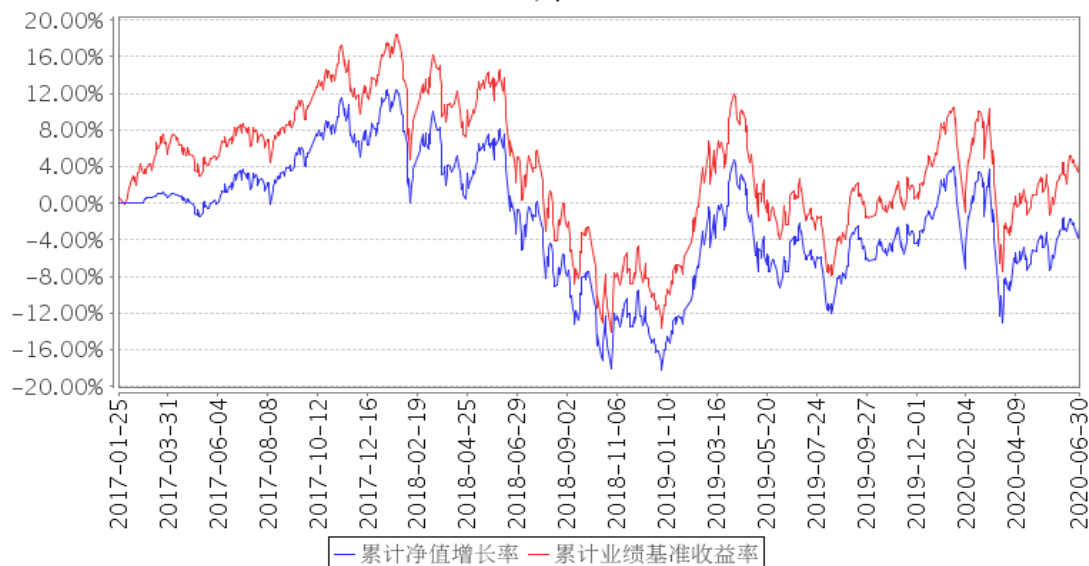
3.2 基金净值表现

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	3.45%	0.77%	4.76%	0.91%	-1.31%	-0.14%
过去三个月	6.35%	0.94%	7.39%	0.99%	-1.04%	-0.05%
过去六个月	-3.91%	1.48%	-2.32%	1.47%	-1.59%	0.01%
过去一年	1.31%	1.17%	4.02%	1.17%	-2.71%	0.00%
过去三年	-5.82%	1.15%	-3.32%	1.15%	-2.50%	0.00%
自基金合同生效起至今	-2.81%	1.08%	4.59%	1.09%	-7.40%	-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

平安中证沪港深高股息累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 1 月 25 日正式生效；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本为 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	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金经理	2018 年 3 月 26 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。
毛时超	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金经理助理	2019 年 10 月 22 日	2020 年 5 月 8 日	3 年	毛时超先生，中山大学硕士研究生。2016 年 7 月加入平安基金管理有限公司，曾任衍生品投资中心衍生品研究员、基金经理助理。现担任平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。

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

在报告期内，受全球流动性宽松及经济复苏预期的影响，沪港深高股息指数出现了增长态势。本基金采用跟踪复制沪港深高股息指数的投资策略，严格控制相对指数的跟踪误差。

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 0.9719 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.91%，业绩比较基准收益率为-2.32%。

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

本基金本报告期内出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形。截至报告期末，以上情况未消除。根据 2014 年 8 月 8 日生效的《公开募集证券投资基金运作管理办法》第四十一条的规定，予以披露，且基金管理人已经向证监会报告并提出了解决方案。

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低于 200 人的情形。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	708,303.11	1,062,603.87
结算备付金		-	298,341.35
存出保证金		5,618.35	62,609.79
交易性金融资产	6.4.7.2	6,362,634.08	12,683,708.21
其中：股票投资		6,362,634.08	12,683,708.21
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		-	281,441.94
应收利息	6.4.7.5	94.38	342.88
应收股利		8,361.31	5,161.34
应收申购款		-	2,696.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,085,011.23	14,396,906.14
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		0.19	274,640.53
应付赎回款		4,569.43	9,357.63
应付管理人报酬		4,143.89	11,582.13
应付托管费		828.78	2,316.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	8,462.84	13,575.87
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	135,011.30	139,519.22
负债合计		153,016.43	450,991.79
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	7,132,243.65	13,787,732.73
未分配利润	6.4.7.10	-200,248.85	158,181.62
所有者权益合计		6,931,994.80	13,945,914.35
负债和所有者权益总计		7,085,011.23	14,396,906.14

注：报告截止日 2020 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9719 元，基金份额总额 7,132,243.65 份。

6.2 利润表

会计主体：平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年	2019 年 1 月 1 日至 2019 年

		6 月 30 日	6 月 30 日
一、收入		-297,242.46	2,143,452.87
1. 利息收入		3,609.20	3,956.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	3,609.20	3,956.60
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		265,112.83	438,978.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	114,246.16	85,362.61
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	150,866.67	353,616.04
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-568,281.61	1,693,816.00
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	2,317.12	6,701.62
减：二、费用		280,957.78	213,436.60
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	55,286.28	71,560.49
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,057.30	14,312.08
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	22,114.20	1,207.94
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	192,500.00	126,356.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-578,200.24	1,930,016.27
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-578,200.24	1,930,016.27

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	13,787,732.73	158,181.62	13,945,914.35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-578,200.24	-578,200.24
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)	-6,655,489.08	219,769.77	-6,435,719.31
其中：1. 基金申购款	4,841,006.53	-127,558.18	4,713,448.35
2. 基金赎回款	-11,496,495.61	347,327.95	-11,149,167.66
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)	7,132,243.65	-200,248.85	6,931,994.80
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	16,056,729.98	-2,603,208.04	13,453,521.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,930,016.27	1,930,016.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-1,092,758.75	64,223.94	-1,028,534.81

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	1,593,378.94	-29,839.34	1,563,539.60
2. 基金赎回款	-2,686,137.69	94,063.28	-2,592,074.41
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)	14,963,971.23	-608,967.83	14,355,003.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金(原名为平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1978号《关于准予平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于2018年10月25日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币249,245,009.43元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第032号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》于2017年1月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为249,314,243.26份基金份额,其中认购资金利息折合69,233.83份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金于2018年11月30日起更名为平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资

基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成分股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、中小企业私募债券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。本基金的业绩比较基准为：中证沪港深高股息精选指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率（税后） \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

如财务报表附注 1 所述，本基金自 2020 年 7 月 2 日起进入基金财产清算期，因此本基金财务报表以清算基础编制。

本基金财务报表按附注 3 中所述的重要会计政策和会计估计以清算基础编制。于 2020 年 7 月 1 日（基金最后运作日），所有资产以可收回的金额与原账面价值孰低计量，负债以预计需要清偿的金额计量。

此外，本基金财务报表按照中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同》约定的资产估值和会计核算方法及在财务报表附注 3 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)

的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	708,303.11
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	708,303.11

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	6,274,734.83	6,362,634.08	87,899.25
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	6,274,734.83	6,362,634.08	87,899.25

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	92.13
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	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	2.25
合计	94.38

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	8,462.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	8,462.84

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	11.30
应付证券出借违约金	-
预提费用	135,000.00
合计	135,011.30

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	13,787,732.73	13,787,732.73
本期申购	4,841,006.53	4,841,006.53
本期赎回（以“-”号填列）	-11,496,495.61	-11,496,495.61
- 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	7,132,243.65	7,132,243.65

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	328,484.97	-170,303.35	158,181.62
本期利润	-9,918.63	-568,281.61	-578,200.24
本期基金份额交易产生的变动数	-203,684.53	423,454.30	219,769.77
其中：基金申购款	122,836.80	-250,394.98	-127,558.18
基金赎回款	-326,521.33	673,849.28	347,327.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	114,881.81	-315,130.66	-200,248.85

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	3,262.74
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	308.36
其他	38.10
合计	3,609.20

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	114,246.16
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	114,246.16

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	10,081,646.18
减：卖出股票成本总额	9,967,400.02
买卖股票差价收入	114,246.16

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于证券出借产生的股票差价收入。

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	150,866.67
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	150,866.67

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	-568,281.61
股票投资	-568,281.61
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	-568,281.61

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	2,308.35
基金转换费收入	8.77
合计	2,317.12

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对份额持有期限小于 30 个自然日的，赎回费用全部归基金财产，对份额持有期限小于 3 个自然月的，赎回费用的 75% 归基金财产，对份额持有期限小于 6 个自然月的，赎回费用的 50% 归基金财产，对份额持有期限大于等于 6 个自然月的，赎回费用的 25% 归基金财产。

2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

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	22,114.20
银行间市场交易费用	-
合计	22,114.20

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	35,000.00
信息披露费	-

证券出借违约金	-
账户维护费	7,500.00
指数使用费	100,000.00
其他	50,000.00
合计	192,500.00

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

根据《平安基金管理有限公司关于平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后，按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
上海陆金所基金销售有限公司（“陆金所”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
深圳鑫橙投资管理有限公司（“深圳鑫橙”）	基金管理人的子公司
深圳平安汇通初创投资管理有限公司（“平安汇通初创”）	基金管理人的子公司的合营公司

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		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
平安证券	3,179,206.27	22.24	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	1,604.20	16.86	1,264.08	14.94
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	55,286.28	71,560.49
其中：支付销售机构的客户维护费	23,074.38	30,520.68

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。根据《平安基金管理有限公司关于平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2020 年 7 月 2 日(含)起进入基金财产清算期。本基金进入清算程序后，停止收取基金管理费，因此本基金 2020 年 7 月 1 日(基金最后运作日)按照 2020 年 6 月 30 日基金资产净值 1.00%的年费率计提管理人报酬后停止计提管理人报酬。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,057.30	14,312.08

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。根据《平安基金管理有限公司关于平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》，本基金自 2020 年 7 月 2 日(含)起进入基金财产清算期。本基金进入清算程序后，停止收取基金托管费，因此本基金 2020 年 7 月 1 日(基金最后运作日)按照 2020 年 6 月 30 日基金资产净值 0.20%的年费率计提托管费后停止计提托管费。

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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 (%)
平安汇通初创	812,951.29	11.3983	-	-
深圳鑫橙	3,264,709.14	45.7739	-	-

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行-活期	708,303.11	3,262.74	1,011,255.77	3,792.98

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金未从事证券银行间债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金未从事证券交易所债券正回购交易，无质押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

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

及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流

通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于报告期末日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于报告期末，本基金确认的净赎回申请未超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	708,303.11	-	-	-	708,303.11
存出保证金	5,618.35	-	-	-	5,618.35
交易性金融资产	-	-	-	6,362,634.08	6,362,634.08
应收利息	-	-	-	94.38	94.38
应收股利	-	-	-	8,361.31	8,361.31
资产总计	713,921.46	-	-	6,371,089.77	7,085,011.23
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,569.43	4,569.43
应付管理人报酬	-	-	-	4,143.89	4,143.89
应付托管费	-	-	-	828.78	828.78
应付证券清算款	-	-	-	0.19	0.19
应付交易费用	-	-	-	8,462.84	8,462.84
其他负债	-	-	-	135,011.30	135,011.30
负债总计	-	-	-	153,016.43	153,016.43
利率敏感度缺口	713,921.46	-	-	6,218,073.34	6,931,994.80
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	1,062,603.87	-	-	-	1,062,603.87
结算备付金	298,341.35	-	-	-	298,341.35

存出保证金	62,609.79	-	-	-	62,609.79
交易性金融资产	-	-	-	12,683,708.21	12,683,708.21
应收利息	-	-	-	342.88	342.88
应收股利	-	-	-	5,161.34	5,161.34
应收申购款	-	-	-	2,696.76	2,696.76
应收证券清算款	-	-	-	281,441.94	281,441.94
资产总计	1,423,555.01	-	-	12,973,351.13	14,396,906.14
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	9,357.63	9,357.63
应付管理人报酬	-	-	-	11,582.13	11,582.13
应付托管费	-	-	-	2,316.41	2,316.41
应付证券清算款	-	-	-	274,640.53	274,640.53
应付交易费用	-	-	-	13,575.87	13,575.87
其他负债	-	-	-	139,519.22	139,519.22
负债总计	-	-	-	450,991.79	450,991.79
利率敏感度缺口	1,423,555.01	-	-	12,522,359.34	13,945,914.35

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于报告期末，本基金未持有交易性债券（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇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	所有外币相对于人	41,809.06	215,307.17

	民币升值 5%		
	所有外币相对于人 民币贬值 5%	-41,809.06	-215,307.17

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票组合的资产占基金资产的比例不低于 90%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	6,362,634.08	91.79	12,683,708.21	90.95
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	6,362,634.08	91.79	12,683,708.21	90.95

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%	367,209.40	436,764.38
	2. 业绩比较基准减少 5%	-367,209.40	-436,764.38

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	6,362,634.08	89.80
	其中：股票	6,362,634.08	89.80
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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	708,303.11	10.00
8	其他各项资产	14,074.04	0.20
9	合计	7,085,011.23	100.00

注：本基金本报告期末通过沪港通交易机制投资的港股市值为人民币 776,898.98 元，占基金资产净值比例 11.21%；通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 59,282.26 元，占基金资产净值比例 0.86%

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	276,775.00	3.99
C	制造业	4,551,658.34	65.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	432,745.50	6.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,234.00	1.39
J	金融业	142,070.00	2.05
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	26,970.00	0.39
S	综合	-	-
	合计	5,526,452.84	79.72

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

注：本基金本报告期末持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
原材料	199,851.53	2.88
周期性消费品	-	-
非周期性消费品	106,547.30	1.54
能源	44,283.57	0.64
金融	194,767.33	2.81
医疗	44,347.51	0.64
工业	110,718.06	1.60
地产业	89,336.26	1.29
信息技术	-	-
电信服务	46,329.68	0.67
公用事业	-	-
合计	836,181.24	12.06

注：以上分类采用全球行业分类标准。

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	600507	方大特钢	39,981.00	207,501.39	2.99
2	601088	中国神华	13,500.00	193,860.00	2.80
3	600114	东睦股份	16,800.00	174,384.00	2.52
4	002110	三钢闽光	22,600.00	150,516.00	2.17
5	002233	塔牌集团	12,100.00	145,563.00	2.10
6	002756	永兴材料	7,500.00	143,175.00	2.07
7	300298	三诺生物	4,400.00	141,416.00	2.04
8	000789	万年青	10,900.00	140,283.00	2.02
9	002626	金达威	5,300.00	137,588.00	1.98
10	000429	粤高速 A	19,100.00	133,509.00	1.93
11	300121	阳谷华泰	15,200.00	124,944.00	1.80
12	601006	大秦铁路	17,400.00	122,496.00	1.77
13	600585	海螺水泥	2,300.00	121,693.00	1.76
14	600377	宁沪高速	12,200.00	119,682.00	1.73
15	002001	新 和 成	4,100.00	119,310.00	1.72
16	601003	柳钢股份	26,300.00	116,509.00	1.68
17	600563	法拉电子	1,800.00	111,240.00	1.60
18	600566	济川药业	3,700.00	94,202.00	1.36
19	002737	葵花药业	6,000.00	87,780.00	1.27
20	002478	常宝股份	17,900.00	86,457.00	1.25
21	600801	华新水泥	3,600.00	85,356.00	1.23
22	600479	千金药业	9,200.00	85,100.00	1.23

23	300206	理邦仪器	4,600.00	83,904.00	1.21
24	002381	双箭股份	9,100.00	83,811.00	1.21
25	601225	陕西煤业	11,500.00	82,915.00	1.20
26	002597	金禾实业	3,600.00	82,692.00	1.19
27	600529	山东药玻	1,400.00	81,200.00	1.17
28	002734	利民股份	5,410.00	80,987.70	1.17
29	002099	海翔药业	9,500.00	75,145.00	1.08
30	002572	索菲亚	3,000.00	72,510.00	1.05
31	300230	永利股份	16,700.00	72,478.00	1.05
32	000877	天山股份	4,700.00	70,970.00	1.02
33	000672	上峰水泥	3,000.00	70,830.00	1.02
34	002440	闰土股份	7,600.00	69,464.00	1.00
35	01313	华润水泥控股	8,000.00	69,348.36	1.00
36	002677	浙江美大	6,000.00	67,680.00	0.98
37	600750	江中药业	5,320.00	67,244.80	0.97
38	000636	风华高科	2,300.00	67,137.00	0.97
39	600449	宁夏建材	5,400.00	65,988.00	0.95
40	600987	航民股份	11,975.00	64,066.25	0.92
41	000568	泸州老窖	700	63,784.00	0.92
42	601601	中国太保	2,300.00	62,675.00	0.90
43	002191	劲嘉股份	7,000.00	62,370.00	0.90
44	000898	鞍钢股份	25,200.00	61,740.00	0.89
45	002007	华兰生物	1,200.00	60,132.00	0.87
46	002056	横店东磁	5,300.00	59,625.00	0.86
47	002803	吉宏股份	2,350.00	58,609.00	0.85
48	600486	扬农化工	700	57,750.00	0.83
49	600703	三安光电	2,300.00	57,500.00	0.83
50	01999	敏华控股	8,400.00	56,856.16	0.82
51	300547	川环科技	7,000.00	54,670.00	0.79
52	600305	恒顺醋业	2,924.00	54,240.20	0.78
53	002643	万润股份	3,100.00	53,227.00	0.77
54	000786	北新建材	2,400.00	51,192.00	0.74
55	601318	中国平安	700	49,980.00	0.72
56	002032	苏泊尔	700	49,700.00	0.72
57	600160	巨化股份	7,000.00	48,230.00	0.70
58	00914	海螺水泥	1,000.00	47,681.57	0.69
59	00799	IGG	8,000.00	46,329.68	0.67
60	00014	希慎兴业	2,000.00	45,397.97	0.65
61	02689	玖龙纸业	7,000.00	44,822.50	0.65
62	01088	中国神华	4,000.00	44,283.57	0.64
63	002223	鱼跃医疗	1,200.00	43,680.00	0.63

64	603866	桃李面包	800	40,712.00	0.59
65	300408	三环集团	1,400.00	38,780.00	0.56
66	02314	理文造纸	10,000.00	37,999.10	0.55
67	002468	申通快递	2,300.00	37,743.00	0.54
68	300349	金卡智能	2,500.00	37,625.00	0.54
69	03360	远东宏信	6,000.00	36,062.61	0.52
70	002757	南兴股份	2,100.00	35,805.00	0.52
71	00011	恒生银行	300	35,651.56	0.51
72	02318	中国平安	500	35,395.80	0.51
73	603658	安图生物	200	32,488.00	0.47
74	300575	中旗股份	800	31,592.00	0.46
75	00656	复星国际	3,500.00	31,522.81	0.45
76	00388	香港交易所	100	30,143.52	0.43
77	00586	海螺创业	1,000.00	29,869.49	0.43
78	600643	爱建集团	3,700.00	29,415.00	0.42
79	000910	大亚圣象	1,800.00	27,972.00	0.40
80	601858	中国科传	3,000.00	26,970.00	0.39
81	00694	北京首都机场股份	6,000.00	26,581.10	0.38
82	02601	中国太保	1,400.00	26,471.49	0.38
83	600230	沧州大化	3,100.00	26,195.00	0.38
84	02313	申洲国际	300	25,594.59	0.37
85	01972	太古地产	1,400.00	25,167.10	0.36
86	00867	康哲药业	3,000.00	25,019.12	0.36
87	600426	华鲁恒升	1,400.00	24,752.00	0.36
88	600231	凌钢股份	10,900.00	24,198.00	0.35
89	300637	扬帆新材	2,500.00	23,425.00	0.34
90	00001	长和	500	22,744.66	0.33
91	02005	石四药集团	4,000.00	19,328.39	0.28
92	002120	韵达股份	790	19,315.50	0.28
93	603579	荣泰健康	700	18,774.00	0.27
94	00019	太古股份公司 A	500	18,771.19	0.27
95	03908	中金公司	1,200.00	16,683.07	0.24
96	00806	惠理集团	4,000.00	14,359.28	0.21
97	01448	福寿园	2,000.00	12,952.58	0.19
98	00175	吉利汽车	1,000.00	11,143.97	0.16

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

注：本基金本报告期末持有积极投资的境内股票。

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	600114	东睦股份	364,883.00	2.62
2	601088	中国神华	262,356.00	1.88
3	600507	方大特钢	185,445.00	1.33
4	300547	川环科技	146,523.00	1.05
5	002737	葵花药业	144,116.00	1.03
6	002110	三钢闽光	102,636.00	0.74
7	002233	塔牌集团	96,156.00	0.69
8	000789	万年青	94,115.00	0.67
9	300298	三诺生物	90,267.00	0.65
10	000429	粤高速 A	86,816.00	0.62
11	002756	永兴材料	85,209.00	0.61
12	002626	金达威	83,830.00	0.60
13	600585	海螺水泥	81,527.00	0.58
14	601006	大秦铁路	80,623.00	0.58
15	600377	宁沪高速	80,046.00	0.57
16	601003	柳钢股份	78,746.00	0.56
17	300121	阳谷华泰	76,301.00	0.55
18	002001	新和成	72,476.00	0.52
19	002757	南兴股份	66,511.00	0.48
20	600563	法拉电子	64,281.00	0.46

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600507	方大特钢	314,756.57	2.26
2	601088	中国神华	290,110.00	2.08
3	01888	建滔积层板	259,088.18	1.86
4	002110	三钢闽光	246,507.00	1.77
5	01313	华润水泥控股	243,969.72	1.75
6	002233	塔牌集团	210,999.00	1.51
7	600114	东睦股份	206,121.00	1.48
8	000429	粤高速 A	199,508.00	1.43
9	601003	柳钢股份	196,689.00	1.41
10	000789	万年青	195,832.00	1.40
11	01088	中国神华	169,534.46	1.22
12	600377	宁沪高速	165,722.00	1.19
13	601006	大秦铁路	159,811.00	1.15

14	002756	永兴材料	156,156.00	1.12
15	600585	海螺水泥	154,041.00	1.10
16	300121	阳谷华泰	147,958.00	1.06
17	02689	玖龙纸业	146,386.85	1.05
18	01999	敏华控股	146,007.66	1.05
19	002626	金达威	138,919.00	1.00
20	00914	海螺水泥	132,177.10	0.95

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	4,214,607.50
卖出股票收入（成交）总额	10,081,646.18

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：本基金本报告期末未持有债券投资。

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：本基金本报告期末未持有债券投资。

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方大特钢，因未依法履行其他职责，南昌市应急管理局于 2019 年 11 月 6 日依据相关法规给予公开处罚处分决定。

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	5,618.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	8,361.31
4	应收利息	94.38
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,074.04

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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
375	19,019.32	4,077,660.43	57.17	3,054,583.22	42.83

8.2 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	594.12	0.0083

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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(2017年1月25日) 基金份额总额	249,314,243.26
本报告期期初基金份额总额	13,787,732.73
本报告期基金总申购份额	4,841,006.53
减：本报告期基金总赎回份额	11,496,495.61
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	7,132,243.65

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

根据市场环境变化，为保护基金份额持有人的利益，保护基金份额持有人的利益，平安基

金管理有限公司（以下简称“本基金管理人”）根据相关规定，经与基金托管人平安银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）协商一致，决定自 2020 年 6 月 19 日至 2020 年 6 月 29 日期间，以通讯方式召开平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金的基金份额持有人大会，会议审议通过了关于终止平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同及进行基金财产清算的议案》，本次大会决议自 2020 年 6 月 30 日起生效。详细内容请阅读本公司于 2020 年 7 月 1 日发布的《平安基金管理有限公司关于平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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	

天风证券	2	4,988,813.84	34.90%	3,547.52	37.29%	-
平安证券	4	3,179,206.27	22.24%	1,604.20	16.86%	-
华泰证券	2	2,878,226.57	20.13%	2,048.67	21.54%	-
华创证券	2	1,476,834.00	10.33%	1,051.09	11.05%	-
光大证券	2	963,140.00	6.74%	684.89	7.20%	-
兴业证券	1	419,324.00	2.93%	298.29	3.14%	-
国信证券	2	266,706.00	1.87%	189.71	1.99%	-
申万宏源证 券	2	54,296.00	0.38%	38.65	0.41%	-
国盛证券	1	46,221.00	0.32%	32.88	0.35%	-
海通证券	2	23,486.00	0.16%	16.70	0.18%	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	7	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	已退 租
国联证券	2	-	-	-	-	已退 租
恒泰证券	4	-	-	-	-	-

华宝证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	已退租
申港证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	已退租
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券 成交总额的 比例	成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	成交金额	占当期权 证 成交总额的 比例
天风证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
广发华福 证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-

申港证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-

注：本基金租用的证券公司交易单元本期无其他证券投资。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增浙江同花顺基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月10日
2	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月17日
3	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金因非港股通交易日暂停及恢复申购、赎回等业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年1月30日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月24日
5	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增和耕传承基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年2月28日
6	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
7	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
8	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定投起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020年4月7日
9	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020年4月21日
10	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信期货为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的	中国证监会规定报刊及网站	2020年4月27日

	公告		
11	平安基金管理有限公司关于暂停扬州国信嘉利基金销售有限公司代销旗下基金业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 28 日
12	平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金 2019 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 29 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中信证券华南为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 6 日
14	平安基金管理有限公司关于暂停深圳盈信基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 13 日
15	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增招商银行股份有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 22 日
16	平安基金管理有限公司关于召开平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 28 日
17	平安基金管理有限公司关于召开平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 5 月 29 日
18	平安基金管理有限公司关于召开平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金份额持有人大会（通讯方式）的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 6 月 1 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2020/06/15--2020/06/30	-	3,264,709.14	-	3,264,709.14	45.77
个人	1	2020/01/01--2020/05/19	10,011,200.00	-	10,011,200.00	-	-

产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。

在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金设立的文件；
- 2、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金基金合同；
- 3、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金托管协议；
- 4、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在规定报刊以及规定网站上披露的各项公告。

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

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

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

平安基金管理有限公司

2020 年 8 月 29 日