

# 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	12
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 .....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	14
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	15
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>15</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	15
6.2 审计报告的基本内容 .....	15
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>17</b>
7.1 资产负债表 .....	17
7.2 利润表 .....	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	19
7.4 报表附注 .....	21

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>87</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	87
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	87
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	89
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	97
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	99
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	99
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	99
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	99
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	99
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	99
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	99
8.12 投资组合报告附注 .....	100
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>102</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	102
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	102
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	103
9.4 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 .....	103
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	103
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>103</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>103</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	103
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	103
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	104
11.4 基金投资策略的改变 .....	104
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	104
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	104
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	104
11.8 其他重大事件 .....	106
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>107</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	107
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	107
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>108</b>
13.1 备查文件目录 .....	108
13.2 存放地点 .....	108
13.3 查阅方式 .....	108

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安沪深 300ETF
场内简称	平安 300 (扩位证券简称: 平安沪深 300ETF)
基金主代码	510390
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 25 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	412,849,992.00 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	2018 年 1 月 26 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, 从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深 300 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	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	681,331,646.66	-38,262,094.70	-89,089,018.19
本期利润	691,675,407.64	1,653,009,165.18	-1,400,543,266.48
加权平均基金份额本期利润	1.1147	1.2454	-0.9307
本期加权平均净值利润率	25.26%	32.40%	-30.23%
本期基金份额净值增长率	32.74%	38.47%	-26.75%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	368,259,967.13	-120,440,643.74	-1,563,832,361.69

期末可供分配基金份额利润	0.8920	-0.0884	-1.1148
期末基金资产净值	2,207,521,458.82	5,780,232,352.10	4,298,376,811.45
期末基金份额净值	5.3470	4.2428	3.0640
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	34.77%	1.53%	-26.69%

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
过去三个月	14.12%	0.99%	13.60%	0.99%	0.52%	0.00%
过去六个月	29.57%	1.31%	25.15%	1.35%	4.42%	-0.04%
过去一年	32.74%	1.42%	27.21%	1.43%	5.53%	-0.01%
过去三年	34.65%	1.34%	29.28%	1.34%	5.37%	0.00%
自基金合同生效起至今	34.77%	1.33%	28.53%	1.34%	6.24%	-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

平安沪深300ETF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

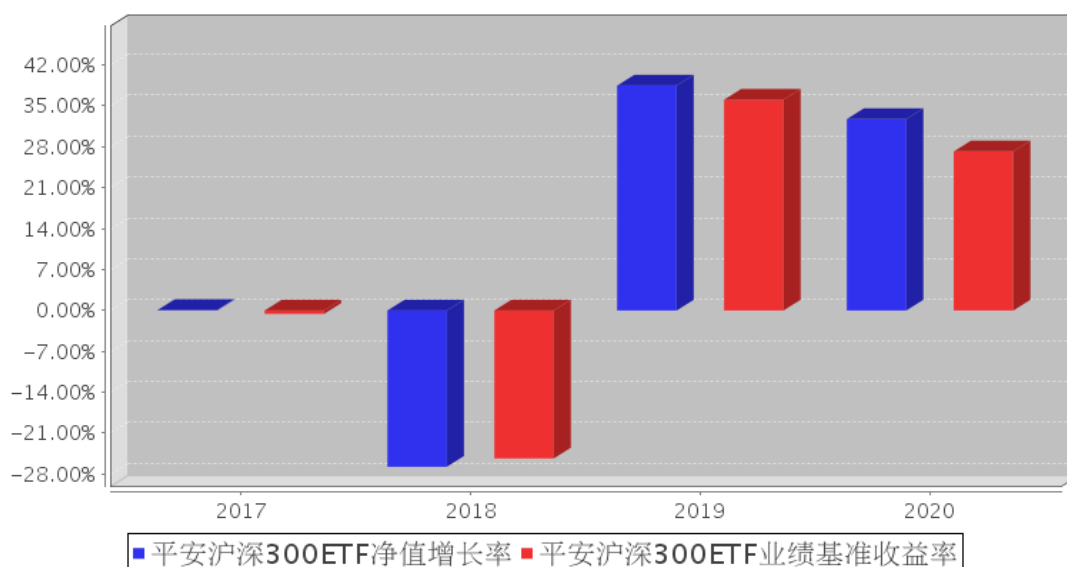


注：1、本基金基金合同于 2017 年 12 月 25 日正式生效；

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基金合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安沪深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 本基金合同于 2017 年 12 月 25 日正式生效。

2. 2017 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2020 年	2.7300	91,332,147.78	-	91,332,147.78	-
2019 年	-	-	-	-	-
2018 年	-	-	-	-	-
合计	2.7300	91,332,147.78	-	91,332,147.78	-

## § 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。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融平台，平安基金建立了以固定收益、主动权益、指数投资、资产配置、专户、ABS 为核心的六大业务板块。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2020 年 12 月 31 日，平安基金共管理 123 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,714 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 指数投资中心投资执行总经理，平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2017 年 12 月 25 日	-	10 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 指数投资中心投资执行总经理。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	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2018 年 10 月 16 日	2020 年 3 月 25 日	7 年	刘洁倩女士，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 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	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2019 年 7 月 22 日	-	3 年	董俊玲女士，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 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、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基金经理助理。
刘帆	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2019 年 12 月 12 日	2020 年 11 月 9 日	4 年	刘帆女士，南开大学硕士。2016 年 7 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心指数研究员。曾担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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基金经理助理。
王宁	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2020 年 11 月 18 日	-	3 年	王宁女士，法国雷恩高等商学院硕士，曾任平安道远投资管理（上海）有限公司量化投资部助理产品经理，2018 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现任 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 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 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、平安沪深 300 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联接基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，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。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析

评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人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。

##### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

作为一只投资于沪深 300 指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续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 1.30%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 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 5.3470 元；本报告期基金份额净值增长率为 32.74%，业绩比较基准收益率为 27.21%。

### 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 2021 年，海外方面，伴随着疫苗的使用，全球疫情有望得到控制，全球经济基本面有望逐渐向好；国内方面，中国经济已经基本全面恢复，整体来看，企业盈利有望得到改善，外部风

险因素有所降低，且货币政策预计仍将保持偏宽松的状态。综合考虑，我们对 2021 年权益资产的前景保持谨慎乐观。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、资本市场风险监控室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会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。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金进行了 1 次利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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、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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管过程中，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，平安沪深 300 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沪深 300 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 21167 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安沪深 300ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安沪深

	300ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>平安沪深 300ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安沪深 300ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算平安沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督平安沪深 300ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对平安沪深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致平安沪深 300ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,</p>



	并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	郭素宏	邓昭君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2021 年 3 月 23 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	21,660,136.06	7,423,664.96
结算备付金		3,114,791.01	4,503,922.29
存出保证金		3,019,212.13	1,379,737.40
交易性金融资产	7.4.7.2	2,183,066,779.59	5,765,486,844.86
其中：股票投资		2,183,066,779.59	5,765,486,844.86
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	8,000,000.00	-
应收证券清算款		6,187,886.53	9,766,613.45
应收利息	7.4.7.5	80,090.66	144,489.26
应收股利		-	321,926.90
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	45.00	36,469.15
资产总计		2,225,128,940.98	5,789,063,668.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2019 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		760,539.26	2,268,883.09
应付托管费		152,107.85	453,776.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	429,941.13	555,686.86
应交税费		101,833.34	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	16,163,060.58	5,552,969.58
负债合计		17,607,482.16	8,831,316.17
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,725,211,550.60	5,692,968,361.26
未分配利润	7.4.7.10	482,309,908.22	87,263,990.84
所有者权益合计		2,207,521,458.82	5,780,232,352.10
负债和所有者权益总计		2,225,128,940.98	5,789,063,668.27

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.3470 元，基金份额总额 412,849,992.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安沪深 300 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		715,856,835.27	1,689,156,454.54
1. 利息收入		3,879,398.61	779,059.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	252,540.26	219,234.14
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		267,562.37	128,437.00
证券出借利息收入		3,359,295.98	431,388.68
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		697,077,558.77	-3,367,214.48
其中：股票投资收益	7.4.7.12	633,329,091.81	-122,705,777.17
基金投资收益	-	-	-

债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	9,467,182.51	3,232,647.67
股利收益	7.4.7.16	54,281,284.45	116,105,915.02
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.17	10,343,760.98	1,691,271,259.88
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.18	4,556,116.91	473,349.32
减：二、费用		24,181,427.63	36,147,289.36
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	13,863,417.15	25,459,011.75
2. 托管费	7.4.10.2.2	2,772,683.37	5,091,802.38
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	6,226,080.87	3,417,172.23
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		34,081.86	12,749.19
7. 其他费用	7.4.7.20	1,285,164.38	2,166,553.81
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		691,675,407.64	1,653,009,165.18
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		691,675,407.64	1,653,009,165.18

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安沪深 300 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	5,692,968,361.26	87,263,990.84	5,780,232,352.10
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	691,675,407.64	691,675,407.64
三、本期基金份 额交易产生的基	-3,967,756,810.66	-205,297,342.48	-4,173,054,153.14

金净值变动数 (净值减少以 “-”号填列)			
其中: 1. 基金申 购款	1,579,580,910.36	125,738,079.87	1,705,318,990.23
2. 基金赎 回款	-5,547,337,721.02	-331,035,422.35	-5,878,373,143.37
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)	-	-91,332,147.78	-91,332,147.78
五、期末所有者 权益(基金净值)	1,725,211,550.60	482,309,908.22	2,207,521,458.82
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益(基金净值)	5,862,209,173.14	-1,563,832,361.69	4,298,376,811.45
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数(本期 利润)	-	1,653,009,165.18	1,653,009,165.18
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)	-169,240,811.88	-1,912,812.65	-171,153,624.53
其中: 1. 基金申 购款	1,820,278,953.82	-137,528,831.21	1,682,750,122.61
2. 基金赎 回款	-1,989,519,765.70	135,616,018.56	-1,853,903,747.14
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)	5,692,968,361.26	87,263,990.84	5,780,232,352.10

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

罗春风林婉文张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华沪深 300 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[2017]2055 号《关于准予平安大华沪深 300 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(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《平安大华沪深 300 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 5,721,050,037.00 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(2017)第 1086 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,723,055,617.00 份,其中认购资金利息折合 2,005,580.00 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[2018]15 号审核同意,本基金 1,369,549,992.000 份基金份额于 2018 年 1 月 26 日在上交所挂牌交易。

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》,平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安沪深 300 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沪深 300 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;此外,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、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)。本基金在履行适当程序后,参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资比例为:标的指数成份股、备选成份股的资产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%。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

本基金的基金管理人平安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“平安 300 ETF 联接基金”)。平安 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安沪深 300 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 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场, 采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时, 优先使用可观察输入值, 只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下, 才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项, 根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分, 将本金部分冲减资产支持证券投资成本, 并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 于处置时, 其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务, 是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向



中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券,证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为,基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬,故不终止确认该出借证券,仍按原金融资产类别进行后续计量,并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入,将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为:(1)基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时,基金管理人可进行收益分配;基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算,则以基金份额折算日为初始日重新计算);(2)在符合基金收益分配条件的前提下,本基金收益每年最多分配 4 次。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值;(3)本基金的收益分配均采用现金分红的方式;(4)《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;(5)每一基金份额享有同等分配权;(6)法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足

一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	21,660,136.06	7,423,664.96
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	21,660,136.06	7,423,664.96

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,793,923,534.02	2,183,066,779.59	389,143,245.57
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	1,793,923,534.02	2,183,066,779.59	389,143,245.57
项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,386,303,949.26	5,765,486,844.86	379,182,895.60
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	5,386,303,949.26	5,765,486,844.86	379,182,895.60

注：于2020年12月31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14,100.00元(2019年12月31日：-9,210.00元)。

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	22,284,108.00	-	-	
其中：股指	22,284,108.00	-	-	

期货投资				
其他衍生工具				
合计	22,284,108.00			
项目	上年度末 2019年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具				
货币衍生工具				
权益衍生工具	11,600,879.01			
股指期货	11,600,879.01			
其他衍生工具				
合计	11,600,879.01			

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	8,000,000.00	
银行间市场		
合计	8,000,000.00	
项目	上年度末 2019年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场		
银行间市场		
合计		

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	2,273.02	1,499.07
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	1,155.50	2,475.01
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	-6,394.52	-868.49
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	82,962.96	141,318.97
其他	93.70	64.70
合计	80,090.66	144,489.26

## 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
现金差额	-	36,469.15
可退替代款	45.00	-
合计	45.00	36,469.15

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	429,941.13	555,686.86
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	429,941.13	555,686.86

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31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	585,875.80	901,649.46
可退替代款	-	6,791.30
现金差额	452,248.38	-
应退退补款	15,124,936.40	4,644,528.82

合计	16,163,060.58	5,552,969.58
----	---------------	--------------

注：1. 应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

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

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,362,349,992.00	5,692,968,361.26
本期申购	378,000,000.00	1,579,580,910.36
本期赎回（以“-”号填列）	-1,327,500,000.00	-5,547,337,721.02
- 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	412,849,992.00	1,725,211,550.60

#### 7.4.7.10 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	-120,440,643.74	207,704,634.58	87,263,990.84
本期利润	681,331,646.66	10,343,760.98	691,675,407.64
本期基金份额交易产生的变动数	-101,298,888.01	-103,998,454.47	-205,297,342.48
其中：基金申购款	159,233,473.74	-33,495,393.87	125,738,079.87
基金赎回款	-260,532,361.75	-70,503,060.60	-331,035,422.35
本期已分配利润	-91,332,147.78	-	-91,332,147.78
本期末	368,259,967.13	114,049,941.09	482,309,908.22

#### 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
	活期存款利息收入	64,910.63
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	182,905.46	148,258.32
其他	4,724.17	2,303.14
合计	252,540.26	219,234.14

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	447,782,023.28	-111,748,768.72
股票投资收益——赎回差价收入	185,547,068.53	-10,957,008.45
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	633,329,091.81	-122,705,777.17

## 7.4.7.12.2 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	2,797,455,370.78	1,295,630,976.89
减：卖出股票成本总额	2,349,673,347.50	1,407,379,745.61
买卖股票差价收入	447,782,023.28	-111,748,768.72

## 7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	5,878,373,143.37	1,853,903,747.14
减：现金支付赎回款总额	2,066,206,908.37	580,029,277.14
减：赎回股票成本总额	3,626,619,166.47	1,284,831,478.45
赎回差价收入	185,547,068.53	-10,957,008.45



#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益-证券出借差价收入。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益—买卖债券差价收入。

##### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益—赎回差价收入。

##### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益—申购差价收入。

##### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

##### 7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

##### 7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

## 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

## 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益—买卖权证差价收入。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2019年1月1日至2019年12月31日
股指期货投资收益	9,467,182.51	3,232,647.67

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	54,281,284.45	116,105,915.02
其中：证券出借权益补偿收入	3,542,240.44	335,500.86
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	54,281,284.45	116,105,915.02

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	9,960,349.97	1,690,201,590.89
股票投资	9,960,349.97	1,690,201,590.89
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	383,411.01	1,069,668.99
权证投资	-	-

股指期货	-	1,069,668.99
期货	383,411.01	-
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	10,343,760.98	1,691,271,259.88

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 23,310.00 元(2019 年：-10,330.00 元)。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	4,556,116.91	473,349.32
合计	4,556,116.91	473,349.32

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	6,226,080.87	3,417,172.23
银行间市场交易费用	-	-
合计	6,226,080.87	3,417,172.23

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	1,149.07	1,223.44
指数使用费	831,804.98	1,527,540.70
上市费	-	60,000.00
其他	252,210.33	-
IOPV 计算费	-	47,789.67

登记结算费	-	300,000.00
合计	1,285,164.38	2,166,553.81

#### 7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人
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
平安 300ETF 联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安财产保险股份有限公司(“平安财险”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
平安证券	7,936,235.53	0.19	933,136,482.51	35.42

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
平安证券	34,000,000.00	1.19	68,000,000.00	5.27

#### 7.4.10.1.4 权证交易

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权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	5,644.85	0.19	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	663,745.13	35.42	329,356.56	59.27

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	13,863,417.15	25,459,011.75
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的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	2,772,683.37	5,091,802.38

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 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借 业务余额	期末应收利息余额
平安证券	27,722,006.00	33,095.30	1,276,400.00	1,041.43
上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日				

关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
	-	-	-	-

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年12月31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 300 ETF 联接基金	149,267,747.00	36.1554	148,356,386.00	10.8897
平安财险	10,482,938.00	2.5392	-	-
平安人寿	177,315,315.00	42.9491	909,184,306.00	66.7365

##### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期	21,660,136.06	64,910.63	7,423,664.96	68,672.68

注：1. 本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

##### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

##### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为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的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、基金管理人关联方平安银行发行的股票平安银行、本基金托管行发行的股票工商银行。

(1)于2020年12月31日，本基金持有3,895,400股工商银行的A股普通股，成本总额为人民币20,930,068.86元，估值总额为人民币19,438,046.00元，占基金资产净值的比例为0.88%(2019年12月31日：数量：8,993,700股；成本：54,055,518.52元；市值52,882,956.00元；占基金资产净值的比例为0.91%)。

(2)于2020年12月31日，本基金持有1,203,662股中国平安的A股普通股，成本总额为人民币93,270,664.23元，估值总额为人民币104,694,520.76元，占基金资产净值的比例为4.74%(2019年12月31日：数量：4,529,426股；成本：336,374,064.82元；市值：387,084,745.96元；占基金资产净值的比例：6.70%)。

(3)于2020年12月31日，本基金持有1,077,026股平安银行的A股普通股，成本总额为人民币16,096,562.21元，估值总额为人民币20,829,682.84元，占基金资产净值的比例为0.94%(2019年12月31日：数量：4,061,626股；成本：54,221,567.61元；市值：66,813,747.70元；占基金资产净值的比例：1.16%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2020年12月18日	-	2020年12月21日	2.7300	91,332,147.78	-	91,332,147.78	-
合计	-	-	-	2.7300	91,332,147.78	-	91,332,147.78	-

#### 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 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



003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300860	锋尚文化	2020年8月6日	2021年2月24日	新股锁定	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020年8月6日	2021年2月24日	新股锁定	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300873	海晨股份	2020年8月14日	2021年3月2日	新股锁定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88	-
300877	金春股份	2020年8月17日	2021年3月3日	新股锁定	30.54	50.85	569	17,377.26	28,933.65	-
300878	维康药业	2020年8月17日	2021年3月3日	新股锁定	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300881	盛德鑫泰	2020年8月25日	2021年3月5日	新股锁定	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300882	万胜智能	2020年8月27日	2021年3月10日	新股锁定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-
300887	谱尼测试	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	-
300888	稳健医疗	2020年9月9日	2021年3月17日	新股锁定	74.30	156.39	10,265	762,689.50	1,605,343.35	-
300889	爱克股份	2020年9月9日	2021年3月16日	新股锁定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020年9月10日	2021年3月18日	新股锁定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300891	惠云钛业	2020年9月	2021年3月	新股锁定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-

		10 日	17 日							
300892	品渥食品	2020 年 9 月 11 日	2021 年 03 月 30 日	新股锁定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300893	松原股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股锁定	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	-
300894	火星入	2020 年 12 月 24 日	2021 年 6 月 30 日	新股锁定	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300895	铜牛信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股锁定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	-
300896	爱美客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股锁定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300898	熊猫乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股锁定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	-
300900	广联航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股锁定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300909	汇创达	2020 年 11 月 11 日	2021 年 5 月 18 日	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
300911	亿田智能	2020 年 11 月 24 日	2021 年 6 月 3 日	新股锁定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300917	特发服务	2020 年 12 月 14 日	2021 年 6 月 21 日	新股锁定	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
300918	南山智尚	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 22 日	新股锁定	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 6 月 23 日	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-

		日								
300920	润阳科技	2020年12月17日	2021年6月25日	新股锁定	26.93	34.13	2,503	67,405.79	85,427.39	-
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股锁定	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股锁定	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股未上市	4.59	5.46	223,230	1,024,625.70	1,218,835.80	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688277	天智航	2020年6月24日	2021年1月7日	新股锁定	12.04	37.53	8,810	106,072.40	330,639.30	-
688286	敏芯股份	2020年7月31日	2021年2月10日	新股锁定	62.67	117.33	1,681	105,348.27	197,231.73	-
688336	三生国健	2020年7月15日	2021年1月22日	新股锁定	28.18	24.29	14,352	404,439.36	348,610.08	-
688418	震有科技	2020年7月15日	2021年1月22日	新股锁定	16.25	25.64	6,178	100,392.50	158,403.92	-
688488	艾迪药业	2020年7月9日	2021年1月20日	新股锁定	13.99	24.48	9,934	138,976.66	243,184.32	-

688508	芯朋微	2020年7月15日	2021年1月22日	新股锁定	28.30	91.91	3,729	105,530.70	342,732.39	-
688550	瑞联新材	2020年8月24日	2021年3月2日	新股锁定	113.72	84.08	2,539	288,735.08	213,479.12	-
688585	上纬新材	2020年9月21日	2021年3月29日	新股锁定	2.49	12.51	4,922	12,255.78	61,574.22	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有的暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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
2020	002415	海康威视	2020年12月	2021年1	48.51	10,000	485,100

1218 0000 1608			18 日	月 4 日			.00
2020 1218 0000 1816	601377	兴业证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	8.68	89,000	772,520 .00
2020 1218 0000 1859	600958	东方证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	11.63	23,300	270,979 .00
2020 1218 0000 2481	600104	上汽集团	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	24.44	15,000	366,600 .00
2020 1218 0000 3033	601669	中国电建	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	3.88	21,800	84,584. 00
2020 1218 0000 6511	601238	广汽集团	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	13.29	10,200	135,558 .00
2020 1218 0000 6513	600999	招商证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	23.34	28,800	672,192 .00
2020 1218 0000 6515	600085	同仁堂	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	23.90	12,400	296,360 .00
2020 1218 0000 6517	000768	中航西飞	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	36.68	21,700	795,956 .00
2020 1218 0000 6519	601933	永辉超市	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	7.18	32,700	234,786 .00
2020 1218 0000 6521	600705	中航资本	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	4.38	63,000	275,940 .00
2020 1218	002939	长城证券	2020 年 12 月 18 日	2021 年 1 月 4 日	12.87	11,200	144,144 .00

0000 6623							
2020 1218 0000 6961	600297	广汇汽车	2020年12月 18日	2021年1 月4日	2.86	62,200	177,892 .00
2020 1218 0000 6963	000963	华东医药	2020年12月 18日	2021年1 月4日	26.56	13,600	361,216 .00
2020 1218 0000 6965	601169	北京银行	2020年12月 18日	2021年1 月4日	4.84	232,300	1,124,3 32.00
2020 1218 0000 8025	000002	万科A	2020年12月 18日	2021年1 月4日	28.70	24,000	688,800 .00
2020 1218 0000 8027	000703	恒逸石化	2020年12月 18日	2021年1 月4日	12.80	10,000	128,000 .00
2020 1218 0000 8029	600018	上港集团	2020年12月 18日	2021年1 月4日	4.57	16,300	74,491. 00
2020 1218 0000 8031	600029	南方航空	2020年12月 18日	2021年1 月4日	5.96	32,800	195,488 .00
2020 1218 0000 8033	600068	葛洲坝	2020年12月 18日	2021年1 月4日	6.58	21,600	142,128 .00
2020 1218 0000 8035	601607	上海医药	2020年12月 18日	2021年1 月4日	19.20	14,200	272,640 .00
2020 1218 0000 8189	300015	爱尔眼科	2020年12月 18日	2021年1 月4日	74.89	12,900	966,081 .00
2020 1221 0000	000063	中兴通讯	2020年12月 21日	2021年1 月4日	33.65	20,100	676,365 .00

0800							
2020 1221 0000 1229	002311	海大集团	2020年12月 21日	2021年1 月4日	65.50	12,900	844,950 .00
2020 1221 0000 1445	601390	中国中铁	2020年12月 21日	2021年1 月4日	5.27	15,700	82,739. 00
2020 1221 0000 1915	600177	雅戈尔	2020年12月 21日	2021年1 月4日	7.19	10,000	71,900. 00
2020 1221 0000 1990	601012	隆基股份	2020年12月 21日	2021年1 月4日	92.20	10,400	958,880 .00
2020 1221 0000 4271	000783	长江证券	2020年12月 21日	2021年1 月4日	8.40	14,500	121,800 .00
2020 1221 0000 4279	600027	华电国际	2020年12月 21日	2021年1 月4日	3.40	36,000	122,400 .00
2020 1221 0000 4281	002736	国信证券	2020年12月 21日	2021年1 月4日	13.64	39,400	537,416 .00
2020 1221 0000 4283	600048	保利地产	2020年12月 21日	2021年1 月4日	15.82	22,400	354,368 .00
2020 1221 0000 4285	600061	国投资本	2020年12月 21日	2021年1 月4日	13.83	10,000	138,300 .00
2020 1221 0000 4287	600489	中金黄金	2020年12月 21日	2021年1 月4日	8.81	10,000	88,100. 00
2020 1221 0000 4289	600177	雅戈尔	2020年12月 21日	2021年1 月4日	7.19	13,400	96,346. 00

2020 1221 0000 4291	600606	绿地控股	2020年12月 21日	2021年1 月4日	5.83	10,900	63,547. 00
2020 1221 0000 4293	600637	东方明珠	2020年12月 21日	2021年1 月4日	8.94	10,300	92,082. 00
2020 1221 0000 4295	600655	豫园股份	2020年12月 21日	2021年1 月4日	8.89	10,000	88,900. 00
2020 1221 0000 4297	600958	东方证券	2020年12月 21日	2021年1 月4日	11.63	10,000	116,300 .00
2020 1221 0000 4299	601186	中国铁建	2020年12月 21日	2021年1 月4日	7.90	29,800	235,420 .00
2020 1221 0000 4301	601138	工业富联	2020年12月 21日	2021年1 月4日	13.69	22,500	308,025 .00
2020 1221 0000 4303	601006	大秦铁路	2020年12月 21日	2021年1 月4日	6.46	69,800	450,908 .00
2020 1221 0000 4305	601360	三六零	2020年12月 21日	2021年1 月4日	15.71	14,400	226,224 .00
2020 1221 0000 4307	601390	中国中铁	2020年12月 21日	2021年1 月4日	5.27	115,600	609,212 .00
2020 1221 0000 4309	601600	中国铝业	2020年12月 21日	2021年1 月4日	3.63	62,600	227,238 .00
2020 1221 0000 4313	601618	中国中冶	2020年12月 21日	2021年1 月4日	2.73	60,900	166,257 .00
2020	601669	中国电建	2020年12月	2021年1	3.88	88,400	342,992



1221 0000 4315			21 日	月 4 日			.00
2020 1221 0000 4387	002271	东方雨虹	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	38.80	16,000	620,800 .00
2020 1221 0000 4389	002008	大族激光	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	42.75	10,400	444,600 .00
2020 1221 0000 4391	002415	海康威视	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	48.51	10,000	485,100 .00
2020 1221 0000 4393	600570	恒生电子	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	104.90	10,000	1,049,0 00.00
2020 1221 0000 4395	000858	五 粮 液	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	291.85	15,700	4,582,0 45.00
2020 1221 0000 4397	002044	美年健康	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	11.33	10,000	113,300 .00
2020 1221 0000 4399	002607	中公教育	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	35.13	11,100	389,943 .00
2020 1221 0000 4401	600690	海尔智家	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	29.21	25,400	741,934 .00
2020 1221 0000 4403	603993	洛阳钼业	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	6.25	43,500	271,875 .00
2020 1221 0000 4405	601211	国泰君安	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	17.53	42,500	745,025 .00
2020 1221	000625	长安汽车	2020 年 12 月 21 日	2021 年 1 月 4 日	21.88	10,400	227,552 .00

0000 4695							
2020 1221 0000 4713	002673	西部证券	2020年12月 21日	2021年1 月4日	10.14	20,900	211,926 .00
2020 1221 0000 4715	000728	国元证券	2020年12月 21日	2021年1 月4日	8.96	32,200	288,512 .00
2020 1221 0000 4717	601398	工商银行	2020年12月 21日	2021年1 月4日	4.99	190,400	950,096 .00
2020 1221 0000 4719	601012	隆基股份	2020年12月 21日	2021年1 月4日	92.20	32,300	2,978,0 60.00
2020 1221 0000 4721	601988	中国银行	2020年12月 21日	2021年1 月4日	3.18	186,000	591,480 .00
2020 1221 0000 4723	600183	生益科技	2020年12月 21日	2021年1 月4日	28.16	13,800	388,608 .00
2020 1221 0000 4725	601328	交通银行	2020年12月 21日	2021年1 月4日	4.48	337,000	1,509,7 60.00
2020 1221 0000 4727	601231	环旭电子	2020年12月 21日	2021年1 月4日	19.34	14,100	272,694 .00
2020 1221 0000 4729	600886	国投电力	2020年12月 21日	2021年1 月4日	8.64	43,700	377,568 .00
2020 1221 0000 4915	600196	复星医药	2020年12月 21日	2021年1 月4日	53.99	13,300	718,067 .00
2020 1221 0000	601216	君正集团	2020年12月 21日	2021年1 月4日	4.95	23,700	117,315 .00

4917							
2020 1221 0000 4919	002415	海康威视	2020年12月 21日	2021年1 月4日	48.51	14,000	679,140 .00
2020 1221 0000 5799	300498	温氏股份	2020年12月 21日	2021年1 月4日	18.23	66,100	1,205,0 03.00
2020 1221 0000 6187	300408	三环集团	2020年12月 21日	2021年1 月4日	37.25	16,700	622,075 .00
2020 1221 0000 6189	300136	信维通信	2020年12月 21日	2021年1 月4日	35.88	12,600	452,088 .00
2020 1225 0000 6511	601186	中国铁建	2020年12月 25日	2021年1 月4日	7.90	10,000	79,000. 00
2020 1225 0000 6513	600031	三一重工	2020年12月 25日	2021年1 月4日	34.98	24,000	839,520 .00
2020 1225 0000 6521	601186	中国铁建	2020年12月 25日	2021年1 月4日	7.90	22,200	175,380 .00
2020 1222 0000 1997	002146	荣盛发展	2020年12月 22日	2021年1 月5日	6.53	28,200	184,146 .00
2020 1222 0000 2493	002601	龙鳞佰利	2020年12月 22日	2021年1 月5日	30.77	19,800	609,246 .00
2020 1222 0000 2859	600028	中国石化	2020年12月 22日	2021年1 月5日	4.03	10,000	40,300. 00
2020 1222 0000 3018	601555	东吴证券	2020年12月 22日	2021年1 月5日	9.86	10,000	98,600. 00

2020 1222 0000 3081	601198	东兴证券	2020年12月 22日	2021年1 月5日	13.32	12,300	163,836 .00
2020 1222 0000 3294	601668	中国建筑	2020年12月 22日	2021年1 月5日	4.97	10,000	49,700. 00
2020 1222 0000 3377	600482	中国动力	2020年12月 22日	2021年1 月5日	17.92	10,600	189,952 .00
2020 1222 0000 3969	601336	新华保险	2020年12月 22日	2021年1 月5日	57.97	13,600	788,392 .00
2020 1222 0000 4316	600031	三一重工	2020年12月 22日	2021年1 月5日	34.98	10,000	349,800 .00
2020 1222 0000 4408	600030	中信证券	2020年12月 22日	2021年1 月5日	29.40	34,400	1,011,3 60.00
2020 1222 0000 4519	600660	福耀玻璃	2020年12月 22日	2021年1 月5日	48.05	22,700	1,090,7 35.00
2020 1222 0000 8099	601628	中国人寿	2020年12月 22日	2021年1 月5日	38.39	16,800	644,952 .00
2020 1222 0000 8973	601398	工商银行	2020年12月 22日	2021年1 月5日	4.99	10,000	49,900. 00
2020 1222 0000 8975	600522	中天科技	2020年12月 22日	2021年1 月5日	10.84	11,100	120,324 .00
2020 1222 0000 8977	601600	中国铝业	2020年12月 22日	2021年1 月5日	3.63	16,500	59,895. 00
2020	002236	大华股份	2020年12月	2021年1	19.89	10,000	198,900

1222 0000 8979			22 日	月 5 日			.00
2020 1222 0000 8981	601988	中国银行	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	3.18	70,200	223,236 .00
2020 1222 0000 9017	002230	科大讯飞	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	40.87	18,900	772,443 .00
2020 1222 0000 9019	000063	中兴通讯	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	33.65	13,500	454,275 .00
2020 1222 0000 9429	000625	长安汽车	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	21.88	17,000	371,960 .00
2020 1222 0000 9921	002120	韵达股份	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	15.70	10,000	157,000 .00
2020 1222 0000 9923	000786	北新建材	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	40.05	10,000	400,500 .00
2020 1222 0000 9925	600004	白云机场	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	14.13	10,000	141,300 .00
2020 1222 0000 9927	600340	华夏幸福	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	12.93	10,000	129,300 .00
2020 1222 0000 9929	600369	西南证券	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	5.38	17,600	94,688. 00
2020 1222 0000 9931	601111	中国国航	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	7.49	12,400	92,876. 00
2020 1222	603288	海天味业	2020 年 12 月 22 日	2021 年 1 月 5 日	200.54	11,400	2,286,1 56.00

0000 9933							
2020 1222 0000 9935	603799	华友钴业	2020年12月 22日	2021年1 月5日	79.30	10,000	793,000 .00
2020 1222 0001 0577	300144	宋城演艺	2020年12月 22日	2021年1 月5日	17.72	17,900	317,188 .00
2020 1229 0000 6967	601229	上海银行	2020年12月 29日	2021年1 月5日	7.84	13,200	103,488 .00
2020 1229 0000 6969	600016	民生银行	2020年12月 29日	2021年1 月5日	5.20	20,000	104,000 .00
2020 1229 0000 6971	600340	华夏幸福	2020年12月 29日	2021年1 月5日	12.93	10,000	129,300 .00
2020 1229 0000 6973	001979	招商蛇口	2020年12月 29日	2021年1 月5日	13.29	10,000	132,900 .00
2020 1229 0000 6975	600050	中国联通	2020年12月 29日	2021年1 月5日	4.46	22,300	99,458. 00
2020 1229 0000 6977	601766	中国中车	2020年12月 29日	2021年1 月5日	5.31	19,200	101,952 .00
2020 1229 0000 6979	601668	中国建筑	2020年12月 29日	2021年1 月5日	4.97	20,400	101,388 .00
2020 1223 0000 1266	000625	长安汽车	2020年12月 23日	2021年1 月6日	21.88	12,800	280,064 .00
2020 1223 0000	002044	美年健康	2020年12月 23日	2021年1 月6日	11.33	39,600	448,668 .00

1613							
2020 1223 0000 2524	601919	中远海控	2020年12月 23日	2021年1 月6日	12.21	66,600	813,186 .00
2020 1223 0000 2604	600104	上汽集团	2020年12月 23日	2021年1 月6日	24.44	10,000	244,400 .00
2020 1223 0000 2680	601838	成都银行	2020年12月 23日	2021年1 月6日	10.67	39,400	420,398 .00
2020 1223 0000 2999	600297	广汇汽车	2020年12月 23日	2021年1 月6日	2.86	10,900	31,174. 00
2020 1223 0000 6656	600837	海通证券	2020年12月 23日	2021年1 月6日	12.86	118,400	1,522,6 24.00
2020 1223 0000 6658	002157	正邦科技	2020年12月 23日	2021年1 月6日	17.04	20,300	345,912 .00
2020 1223 0000 6660	600271	航天信息	2020年12月 23日	2021年1 月6日	12.60	13,500	170,100 .00
2020 1223 0000 6662	000977	浪潮信息	2020年12月 23日	2021年1 月6日	26.88	11,500	309,120 .00
2020 1223 0000 6664	600369	西南证券	2020年12月 23日	2021年1 月6日	5.38	22,700	122,126 .00
2020 1223 0000 6944	600795	国电电力	2020年12月 23日	2021年1 月6日	2.25	83,400	187,650 .00
2020 1223 0000 6946	601117	中国化学	2020年12月 23日	2021年1 月6日	5.87	12,000	70,440. 00

2020 1223 0000 6948	601901	方正证券	2020年12月 23日	2021年1 月6日	10.37	30,500	316,285 .00
2020 1230 0000 6203	601328	交通银行	2020年12月 30日	2021年1 月6日	4.48	36,800	164,864 .00
2020 1230 0000 6205	601766	中国中车	2020年12月 30日	2021年1 月6日	5.31	30,900	164,079 .00
2020 1230 0000 6207	601398	工商银行	2020年12月 30日	2021年1 月6日	4.99	33,200	165,668 .00
2020 1224 0000 1456	300498	温氏股份	2020年12月 24日	2021年1 月7日	18.23	15,000	273,450 .00
2020 1224 0000 1458	300413	芒果超媒	2020年12月 24日	2021年1 月7日	72.50	13,000	942,500 .00
2020 1224 0000 2888	002179	中航光电	2020年12月 24日	2021年1 月7日	78.29	10,000	782,900 .00
2020 1224 0000 3023	002236	大华股份	2020年12月 24日	2021年1 月7日	19.89	10,000	198,900 .00
2020 1224 0000 3791	002714	牧原股份	2020年12月 24日	2021年1 月7日	77.10	14,100	1,087,1 10.00
2020 1224 0000 3990	601229	上海银行	2020年12月 24日	2021年1 月7日	7.84	43,000	337,120 .00
2020 1224 0000 4077	600332	白云山	2020年12月 24日	2021年1 月7日	29.25	10,200	298,350 .00
2020	600050	中国联通	2020年12月	2021年1	4.46	56,600	252,436



1224 0000 4394			24 日	月 7 日			.00
2020 1224 0000 4409	601933	永辉超市	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	7.18	18,600	133,548 .00
2020 1224 0000 5389	601169	北京银行	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	4.84	37,000	179,080 .00
2020 1224 0000 6545	600547	山东黄金	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	23.62	14,200	335,404 .00
2020 1224 0001 2227	002714	牧原股份	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	77.10	20,000	1,542,0 00.00
2020 1224 0001 2563	600030	中信证券	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	29.40	22,000	646,800 .00
2020 1224 0001 2975	600795	国电电力	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	2.25	29,300	65,925. 00
2020 1224 0001 2977	002001	新 和 成	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	33.68	20,800	700,544 .00
2020 1224 0001 2979	002304	洋河股份	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	235.99	12,000	2,831,8 80.00
2020 1224 0001 3385	300014	亿纬锂能	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 7 日	81.50	14,900	1,214,3 50.00
2020 1225 0000 1900	002463	沪电股份	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	18.79	10,000	187,900 .00
2020 1225	600161	天坛生物	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 8 日	41.70	10,000	417,000 .00

0000 2163							
2020 1225 0000 2175	601727	上海电气	2020年12月 25日	2021年1 月8日	5.40	16,600	89,640. 00
2020 1225 0000 2263	601933	永辉超市	2020年12月 25日	2021年1 月8日	7.18	10,600	76,108. 00
2020 1225 0000 2598	601919	中远海控	2020年12月 25日	2021年1 月8日	12.21	14,200	173,382 .00
2020 1225 0000 3361	600703	三安光电	2020年12月 25日	2021年1 月8日	27.01	10,000	270,100 .00
2020 1225 0000 6223	601166	兴业银行	2020年12月 25日	2021年1 月8日	20.87	69,100	1,442,1 17.00
2020 1225 0000 6241	601788	光大证券	2020年12月 25日	2021年1 月8日	18.52	11,200	207,424 .00
2020 1228 0000 0625	300498	温氏股份	2020年12月 28日	2021年1 月11日	18.23	5,000	91,150. 00
2020 1228 0000 1200	002600	领益智造	2020年12月 28日	2021年1 月11日	11.99	21,300	255,387 .00
2020 1228 0000 4747	600522	中天科技	2020年12月 28日	2021年1 月11日	10.84	13,400	145,256 .00
2020 1228 0000 4749	600900	长江电力	2020年12月 28日	2021年1 月11日	19.16	38,200	731,912 .00
2020 1228 0000	600489	中金黄金	2020年12月 28日	2021年1 月11日	8.81	12,700	111,887 .00

6045							
2020 1228 0000 6049	601186	中国铁建	2020年12月 28日	2021年1 月11日	7.90	14,400	113,760 .00
2020 1228 0000 7105	002958	青农商行	2020年12月 28日	2021年1 月11日	5.09	16,800	85,512. 00
2020 1228 0000 7121	002463	沪电股份	2020年12月 28日	2021年1 月11日	18.79	14,200	266,818 .00
2020 1228 0000 7123	601555	东吴证券	2020年12月 28日	2021年1 月11日	9.86	23,600	232,696 .00
2020 1228 0000 7131	601727	上海电气	2020年12月 28日	2021年1 月11日	5.40	47,200	254,880 .00
2020 1228 0000 7231	601162	天风证券	2020年12月 28日	2021年1 月11日	6.10	39,200	239,120 .00
2020 1228 0000 7233	600029	南方航空	2020年12月 28日	2021年1 月11日	5.96	20,800	123,968 .00
2020 1228 0000 8387	300124	汇川技术	2020年12月 28日	2021年1 月11日	93.30	12,100	1,128,9 30.00
2020 1229 0000 1520	600741	华域汽车	2020年12月 29日	2021年1 月12日	28.82	20,300	585,046 .00
2020 1229 0000 2092	601800	中国交建	2020年12月 29日	2021年1 月12日	7.26	46,600	338,316 .00
2020 1229 0000 2682	600109	国金证券	2020年12月 29日	2021年1 月12日	16.27	30,100	489,727 .00

2020 1229 0000 5663	600584	长电科技	2020年12月 29日	2021年1 月12日	42.57	13,100	557,667 .00
2020 1229 0000 5667	601816	京沪高铁	2020年12月 29日	2021年1 月12日	5.66	40,900	231,494 .00
2020 1229 0000 6581	002352	顺丰控股	2020年12月 29日	2021年1 月12日	88.23	11,700	1,032,2 91.00
2020 1229 0000 6583	600487	亨通光电	2020年12月 29日	2021年1 月12日	13.99	16,400	229,436 .00
2020 1229 0000 6585	000066	中国长城	2020年12月 29日	2021年1 月12日	18.99	20,900	396,891 .00
2020 1229 0000 6587	002739	万达电影	2020年12月 29日	2021年1 月12日	18.08	10,600	191,648 .00
2020 1229 0000 6981	601288	农业银行	2020年12月 29日	2021年1 月12日	3.14	49,500	155,430 .00
2020 1216 0000 0963	300122	智飞生物	2020年12月 16日	2021年1 月13日	147.91	10,600	1,567,8 46.00
2020 1216 0000 0965	300003	乐普医疗	2020年12月 16日	2021年1 月13日	27.18	20,900	568,062 .00
2020 1216 0000 1027	000001	平安银行	2020年12月 16日	2021年1 月13日	19.34	80,500	1,556,8 70.00
2020 1216 0000 1119	000100	TCL 科技	2020年12月 16日	2021年1 月13日	7.08	72,800	515,424 .00
2020	000723	美锦能源	2020年12月	2021年1	6.68	17,900	119,572

1216 0000 1236			16 日	月 13 日			.00
2020 1216 0000 1294	000725	京东方 A	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	6.00	125,600	753,600 .00
2020 1216 0000 1302	000728	国元证券	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	8.96	11,200	100,352 .00
2020 1216 0000 1614	002202	金风科技	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	14.25	12,200	173,850 .00
2020 1216 0000 1758	002415	海康威视	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	48.51	23,100	1,120,5 81.00
2020 1216 0000 1791	002456	欧菲光	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	13.18	12,500	164,750 .00
2020 1216 0000 1814	002475	立讯精密	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	56.12	15,900	892,308 .00
2020 1216 0000 1953	002958	青农商行	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	5.09	13,500	68,715. 00
2020 1216 0000 1959	300059	东方财富	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	31.00	29,700	920,700 .00
2020 1216 0000 2023	601899	紫金矿业	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	9.29	59,400	551,826 .00
2020 1216 0000 2040	601939	建设银行	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	6.28	111,400	699,592 .00
2020 1216	601988	中国银行	2020 年 12 月 16 日	2021 年 1 月 13 日	3.18	93,500	297,330 .00

0000 2083							
2020 1216 0000 2130	600918	中泰证券	2020年12月 16日	2021年1 月13日	18.50	12,500	231,250 .00
2020 1216 0000 2171	601162	天风证券	2020年12月 16日	2021年1 月13日	6.10	16,100	98,210. 00
2020 1216 0000 2207	601398	工商银行	2020年12月 16日	2021年1 月13日	4.99	151,400	755,486 .00
2020 1216 0000 2268	601600	中国铝业	2020年12月 16日	2021年1 月13日	3.63	29,400	106,722 .00
2020 1216 0000 2340	601888	中国中免	2020年12月 16日	2021年1 月13日	282.45	16,200	4,575,6 90.00
2020 1216 0000 2365	601919	中远海控	2020年12月 16日	2021年1 月13日	12.21	21,000	256,410 .00
2020 1216 0000 2905	600150	中国船舶	2020年12月 16日	2021年1 月13日	17.69	10,900	192,821 .00
2020 1216 0000 3127	600109	国金证券	2020年12月 16日	2021年1 月13日	16.27	11,600	188,732 .00
2020 1216 0000 3133	601108	财通证券	2020年12月 16日	2021年1 月13日	12.65	10,900	137,885 .00
2020 1216 0000 3136	600111	北方稀土	2020年12月 16日	2021年1 月13日	13.09	19,700	257,873 .00
2020 1216 0000	601319	中国人保	2020年12月 16日	2021年1 月13日	6.57	10,800	70,956. 00

3139							
2020 1216 0000 3141	601216	君正集团	2020年12月 16日	2021年1 月13日	4.95	15,100	74,745. 00
2020 1216 0000 3143	601989	中国重工	2020年12月 16日	2021年1 月13日	4.19	40,400	169,276 .00
2020 1216 0000 3144	600118	中国卫星	2020年12月 16日	2021年1 月13日	32.18	10,000	321,800 .00
2020 1216 0000 3145	600010	包钢股份	2020年12月 16日	2021年1 月13日	1.17	98,400	115,128 .00
2020 1216 0000 3146	603369	今世缘	2020年12月 16日	2021年1 月13日	57.38	10,400	596,752 .00
2020 1230 0000 1227	000069	华侨城 A	2020年12月 30日	2021年1 月13日	7.09	48,700	345,283 .00
2020 1230 0000 1898	002007	华兰生物	2020年12月 30日	2021年1 月13日	42.24	10,000	422,400 .00
2020 1230 0000 2423	002384	东山精密	2020年12月 30日	2021年1 月13日	26.00	10,000	260,000 .00
2020 1230 0000 2609	002508	老板电器	2020年12月 30日	2021年1 月13日	40.78	10,000	407,800 .00
2020 1230 0000 2687	002594	比亚迪	2020年12月 30日	2021年1 月13日	194.30	22,100	4,294,0 30.00
2020 1230 0000 2985	600050	中国联通	2020年12月 30日	2021年1 月13日	4.46	34,200	152,532 .00

2020 1230 0000 3027	601225	陕西煤业	2020年12月 30日	2021年1 月13日	9.34	33,800	315,692 .00
2020 1230 0000 3059	601990	南京证券	2020年12月 30日	2021年1 月13日	12.27	10,000	122,700 .00
2020 1230 0000 3338	600705	中航资本	2020年12月 30日	2021年1 月13日	4.38	67,500	295,650 .00
2020 1230 0000 3379	601989	中国重工	2020年12月 30日	2021年1 月13日	4.19	15,900	66,621. 00
2020 1230 0000 3558	600208	新湖中宝	2020年12月 30日	2021年1 月13日	3.10	30,600	94,860. 00
2020 1230 0000 6971	002460	赣锋锂业	2020年12月 30日	2021年1 月13日	101.20	12,600	1,275,1 20.00
2020 1230 0000 7147	601668	中国建筑	2020年12月 30日	2021年1 月13日	4.97	10,000	49,700. 00
2020 1230 0000 7149	601360	三六零	2020年12月 30日	2021年1 月13日	15.71	19,100	300,061 .00
2020 1230 0000 8027	002202	金风科技	2020年12月 30日	2021年1 月13日	14.25	33,600	478,800 .00
2020 1230 0000 8029	601288	农业银行	2020年12月 30日	2021年1 月13日	3.14	302,600	950,164 .00
2020 1230 0000 8031	600498	烽火通信	2020年12月 30日	2021年1 月13日	24.08	13,800	332,304 .00
2020	601555	东吴证券	2020年12月	2021年1	9.86	12,900	127,194



1230 0000 8033			30 日	月 13 日			.00
2020 1230 0000 8209	600036	招商银行	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	43.95	148,400	6,522,1 80.00
2020 1230 0000 8211	000002	万 科 A	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	28.70	29,600	849,520 .00
2020 1230 0000 8213	601166	兴业银行	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	20.87	51,900	1,083,1 53.00
2020 1230 0000 8215	000001	平安银行	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 13 日	19.34	80,500	1,556,8 70.00
2020 1217 0000 1690	000100	TCL 科技	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	7.08	160,000	1,132,8 00.00
2020 1217 0000 1904	000651	格力电器	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	61.94	69,800	4,323,4 12.00
2020 1217 0000 3182	600362	江西铜业	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	19.95	17,600	351,120 .00
2020 1217 0000 3521	601318	中国平安	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	86.98	168,900	14,690, 922.00
2020 1217 0000 3872	600048	保利地产	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	15.82	31,300	495,166 .00
2020 1217 0000 4034	601166	兴业银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	20.87	105,100	2,193,4 37.00
2020 1217	601328	交通银行	2020 年 12 月 17 日	2021 年 1 月 14 日	4.48	119,000	533,120 .00

0000 5011							
2020 1217 0000 5152	600050	中国联通	2020年12月 17日	2021年1 月14日	4.46	30,400	135,584 .00
2020 1217 0000 5157	600276	恒瑞医药	2020年12月 17日	2021年1 月14日	111.46	20,000	2,229,2 00.00
2020 1217 0000 5160	603993	洛阳钼业	2020年12月 17日	2021年1 月14日	6.25	58,800	367,500 .00
2020 1231 0000 0321	000002	万科A	2020年12月 31日	2021年1 月14日	28.70	20,000	574,000 .00
2020 1231 0000 0419	002001	新和成	2020年12月 31日	2021年1 月14日	33.68	10,000	336,800 .00
2020 1231 0000 0513	002493	荣盛石化	2020年12月 31日	2021年1 月14日	27.61	11,600	320,276 .00
2020 1231 0000 0522	002673	西部证券	2020年12月 31日	2021年1 月14日	10.14	12,700	128,778 .00
2020 1231 0000 0821	601985	中国核电	2020年12月 31日	2021年1 月14日	4.92	134,000	659,280 .00
2020 1231 0000 0860	601872	招商轮船	2020年12月 31日	2021年1 月14日	5.65	38,700	218,655 .00
2020 1231 0000 1782	601998	中信银行	2020年12月 31日	2021年1 月14日	5.11	10,200	52,122. 00
2020 1231 0000	601727	上海电气	2020年12月 31日	2021年1 月14日	5.40	13,000	70,200. 00

2396							
2020 1231 0000 4940	600383	金地集团	2020年12月 31日	2021年1 月14日	13.50	37,400	504,900 .00
2020 1231 0000 4942	000671	阳光城	2020年12月 31日	2021年1 月14日	6.52	27,300	177,996 .00
2020 1231 0000 8894	601577	长沙银行	2020年12月 31日	2021年1 月14日	9.52	17,200	163,744 .00
2020 1231 0000 8896	001979	招商蛇口	2020年12月 31日	2021年1 月14日	13.29	28,400	377,436 .00
2020 1218 0000 3218	603993	洛阳钼业	2020年12月 18日	2021年1 月15日	6.25	14,900	93,125. 00
2020 1221 0000 1746	600309	万华化学	2020年12月 21日	2021年1 月18日	91.04	10,300	937,712 .00
2020 1221 0000 2081	600036	招商银行	2020年12月 21日	2021年1 月18日	43.95	29,600	1,300,9 20.00
2020 1221 0000 2135	600999	招商证券	2020年12月 21日	2021年1 月18日	23.34	31,200	728,208 .00
2020 1221 0000 2153	600887	伊利股份	2020年12月 21日	2021年1 月18日	44.37	31,100	1,379,9 07.00
2020 1221 0000 2240	601088	中国神华	2020年12月 21日	2021年1 月18日	18.01	43,000	774,430 .00
2020 1221 0000 2255	601633	长城汽车	2020年12月 21日	2021年1 月18日	37.81	20,100	759,981 .00

2020 1222 0000 1267	000333	美的集团	2020年12月 22日	2021年1 月19日	98.44	10,000	984,400 .00
2020 1222 0000 2606	300142	沃森生物	2020年12月 22日	2021年1 月19日	38.56	20,000	771,200 .00
2020 1222 0000 4533	600588	用友网络	2020年12月 22日	2021年1 月19日	43.87	10,000	438,700 .00
2020 1222 0000 4543	600111	北方稀土	2020年12月 22日	2021年1 月19日	13.09	16,000	209,440 .00
2020 1222 0000 4550	601216	君正集团	2020年12月 22日	2021年1 月19日	4.95	16,500	81,675. 00
2020 1223 0000 1141	000066	中国长城	2020年12月 23日	2021年1 月20日	18.99	11,000	208,890 .00
2020 1223 0000 1245	000568	泸州老窖	2020年12月 23日	2021年1 月20日	226.16	10,000	2,261,6 00.00
2020 1223 0000 1313	000708	中信特钢	2020年12月 23日	2021年1 月20日	21.79	18,100	394,399 .00
2020 1223 0000 1330	000725	京东方A	2020年12月 23日	2021年1 月20日	6.00	39,700	238,200 .00
2020 1223 0000 1595	002027	分众传媒	2020年12月 23日	2021年1 月20日	9.87	21,000	207,270 .00
2020 1223 0000 1706	002129	中环股份	2020年12月 23日	2021年1 月20日	25.50	10,400	265,200 .00
2020	002241	歌尔股份	2020年12月	2021年1	37.32	13,100	488,892

1223 0000 1785			23 日	月 20 日			.00
2020 1223 0000 1905	002414	高德红外	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 20 日	41.75	11,600	484,300 .00
2020 1223 0000 1907	002415	海康威视	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 20 日	48.51	10,300	499,653 .00
2020 1223 0000 2064	002673	西部证券	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 20 日	10.14	10,700	108,498 .00
2020 1223 0000 2123	300059	东方财富	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 20 日	31.00	8,100	251,100 .00
2020 1223 0000 2271	601872	招商轮船	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 20 日	5.65	13,300	75,145. 00
2020 1223 0000 2803	601933	永辉超市	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 20 日	7.18	17,900	128,522 .00
2020 1223 0000 3215	600703	三安光电	2020 年 12 月 23 日	2021 年 1 月 20 日	27.01	13,000	351,130 .00
2020 1224 0000 4581	601600	中国铝业	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 21 日	3.63	10,800	39,204. 00
2020 1225 0000 0880	300015	爱尔眼科	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 22 日	74.89	21,700	1,625,1 13.00
2020 1225 0000 1209	000723	美锦能源	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 22 日	6.68	15,800	105,544 .00
2020 1225	000725	京东方 A	2020 年 12 月 25 日	2021 年 1 月 22 日	6.00	386,700	2,320,2 00.00

0000 1213							
2020 1225 0000 1460	002027	分众传媒	2020年12月 25日	2021年1 月22日	9.87	30,100	297,087 .00
2020 1225 0000 1575	002129	中环股份	2020年12月 25日	2021年1 月22日	25.50	27,600	703,800 .00
2020 1225 0000 1706	002241	歌尔股份	2020年12月 25日	2021年1 月22日	37.32	34,600	1,291,2 72.00
2020 1225 0000 1737	002271	东方雨虹	2020年12月 25日	2021年1 月22日	38.80	10,000	388,000 .00
2020 1225 0000 1874	002456	欧菲光	2020年12月 25日	2021年1 月22日	13.18	32,800	432,304 .00
2020 1225 0000 2093	300059	东方财富	2020年12月 25日	2021年1 月22日	31.00	104,000	3,224,0 00.00
2020 1225 0000 2097	300433	蓝思科技	2020年12月 25日	2021年1 月22日	30.61	27,500	841,775 .00
2020 1225 0000 2098	002958	青农商行	2020年12月 25日	2021年1 月22日	5.09	10,400	52,936. 00
2020 1225 0000 2103	601985	中国核电	2020年12月 25日	2021年1 月22日	4.92	24,400	120,048 .00
2020 1225 0000 2106	600795	国电电力	2020年12月 25日	2021年1 月22日	2.25	80,700	181,575 .00
2020 1225 0000	601236	红塔证券	2020年12月 25日	2021年1 月22日	18.59	15,200	282,568 .00

2140							
2020 1225 0000 2300	601607	上海医药	2020年12月 25日	2021年1 月22日	19.20	10,000	192,000 .00
2020 1225 0000 2340	601600	中国铝业	2020年12月 25日	2021年1 月22日	3.63	18,200	66,066. 00
2020 1225 0000 2822	600655	豫园股份	2020年12月 25日	2021年1 月22日	8.89	12,000	106,680 .00
2020 1225 0000 2966	601012	隆基股份	2020年12月 25日	2021年1 月22日	92.20	12,600	1,161,7 20.00
2020 1225 0000 3013	601225	陕西煤业	2020年12月 25日	2021年1 月22日	9.34	10,000	93,400. 00
2020 1225 0000 3052	601211	国泰君安	2020年12月 25日	2021年1 月22日	17.53	10,000	175,300 .00
2020 1225 0000 3087	600547	山东黄金	2020年12月 25日	2021年1 月22日	23.62	12,400	292,888 .00
2020 1225 0000 3132	600438	通威股份	2020年12月 25日	2021年1 月22日	38.44	11,900	457,436 .00
2020 1225 0000 3197	601169	北京银行	2020年12月 25日	2021年1 月22日	4.84	41,200	199,408 .00
2020 1225 0000 3321	601881	中国银河	2020年12月 25日	2021年1 月22日	12.51	27,100	339,021 .00
2020 1225 0000 3404	600109	国金证券	2020年12月 25日	2021年1 月22日	16.27	10,600	172,462 .00

2020 1225 0000 3420	601878	浙商证券	2020年12月 25日	2021年1 月22日	15.30	38,000	581,400 .00
2020 1225 0000 3429	600584	长电科技	2020年12月 25日	2021年1 月22日	42.57	10,500	446,985 .00
2020 1225 0000 3435	601216	君正集团	2020年12月 25日	2021年1 月22日	4.95	15,900	78,705. 00
2020 1225 0000 3440	601989	中国重工	2020年12月 25日	2021年1 月22日	4.19	151,700	635,623 .00
2020 1225 0000 3442	601899	紫金矿业	2020年12月 25日	2021年1 月22日	9.29	211,600	1,965,7 64.00
2020 1225 0000 3443	600010	包钢股份	2020年12月 25日	2021年1 月22日	1.17	381,200	446,004 .00
2020 1225 0000 3444	600196	复星医药	2020年12月 25日	2021年1 月22日	53.99	12,000	647,880 .00
2020 1228 0000 0627	300347	泰格医药	2020年12月 28日	2021年1 月25日	161.61	10,000	1,616,1 00.00
2020 1228 0000 0724	000425	徐工机械	2020年12月 28日	2021年1 月25日	5.37	24,000	128,880 .00
2020 1228 0000 0782	000723	美锦能源	2020年12月 28日	2021年1 月25日	6.68	10,000	66,800. 00
2020 1228 0000 0784	000728	国元证券	2020年12月 28日	2021年1 月25日	8.96	13,400	120,064 .00
2020	000725	京东方A	2020年12月	2021年1	6.00	22,700	136,200



1228 0000 0791			28 日	月 25 日			.00
2020 1228 0000 0839	000860	顺鑫农业	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	72.54	11,100	805,194 .00
2020 1228 0000 1033	002202	金风科技	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	14.25	14,200	202,350 .00
2020 1228 0000 1088	002384	东山精密	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	26.00	11,800	306,800 .00
2020 1228 0000 1153	002493	荣盛石化	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	27.61	40,000	1,104,4 00.00
2020 1228 0000 1181	002555	三七互娱	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	31.23	14,100	440,343 .00
2020 1228 0000 1261	300142	沃森生物	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	38.56	13,500	520,560 .00
2020 1228 0000 1319	601939	建设银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	6.28	34,200	214,776 .00
2020 1228 0000 1337	601988	中国银行	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	3.18	105,700	336,126 .00
2020 1228 0000 1343	600588	用友网络	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	43.87	15,300	671,211 .00
2020 1228 0000 1419	601162	天风证券	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	6.10	17,100	104,310 .00
2020 1228	601390	中国中铁	2020 年 12 月 28 日	2021 年 1 月 25 日	5.27	88,300	465,341 .00

0000 1464							
2020 1228 0000 1495	600487	亨通光电	2020年12月 28日	2021年1 月25日	13.99	13,000	181,870 .00
2020 1228 0000 1618	600390	五矿资本	2020年12月 28日	2021年1 月25日	6.98	26,400	184,272 .00
2020 1228 0000 1883	600036	招商银行	2020年12月 28日	2021年1 月25日	43.95	89,700	3,942,3 15.00
2020 1228 0000 1955	600887	伊利股份	2020年12月 28日	2021年1 月25日	44.37	30,000	1,331,1 00.00
2020 1228 0000 1978	601328	交通银行	2020年12月 28日	2021年1 月25日	4.48	100,300	449,344 .00
2020 1228 0000 2004	601360	三六零	2020年12月 28日	2021年1 月25日	15.71	10,500	164,955 .00
2020 1228 0000 2058	600438	通威股份	2020年12月 28日	2021年1 月25日	38.44	31,900	1,226,2 36.00
2020 1228 0000 2063	600111	北方稀土	2020年12月 28日	2021年1 月25日	13.09	11,500	150,535 .00
2020 1228 0000 2067	603993	洛阳钼业	2020年12月 28日	2021年1 月25日	6.25	35,700	223,125 .00
2020 1228 0000 2069	601990	南京证券	2020年12月 28日	2021年1 月25日	12.27	14,700	180,369 .00
2020 1228 0000	601899	紫金矿业	2020年12月 28日	2021年1 月25日	9.29	26,800	248,972 .00

2071							
2020 1228 0000 2072	600031	三一重工	2020年12月 28日	2021年1 月25日	34.98	50,000	1,749,0 00.00
2020 1229 0000 1552	601398	工商银行	2020年12月 29日	2021年1 月26日	4.99	146,600	731,534 .00
2020 1229 0000 2770	601818	光大银行	2020年12月 29日	2021年1 月26日	3.99	346,000	1,380,5 40.00
2020 1229 0000 2996	601066	中信建投	2020年12月 29日	2021年1 月26日	42.00	20,700	869,400 .00
2020 1230 0000 1101	000001	平安银行	2020年12月 30日	2021年1 月27日	19.34	52,000	1,005,6 80.00
2020 1230 0000 1221	000066	中国长城	2020年12月 30日	2021年1 月27日	18.99	11,100	210,789 .00
2020 1230 0000 1271	000166	申万宏源	2020年12月 30日	2021年1 月27日	5.28	221,500	1,169,5 20.00
2020 1230 0000 1291	000333	美的集团	2020年12月 30日	2021年1 月27日	98.44	11,000	1,082,8 40.00
2020 1230 0000 1457	000625	长安汽车	2020年12月 30日	2021年1 月27日	21.88	14,000	306,320 .00
2020 1230 0000 1561	000725	京东方A	2020年12月 30日	2021年1 月27日	6.00	88,500	531,000 .00
2020 1230 0000 1621	000768	中航西飞	2020年12月 30日	2021年1 月27日	36.68	12,000	440,160 .00

2020 1230 0000 1692	000858	五 粮 液	2020年12月 30日	2021年1 月27日	291.85	32,000	9,339,2 00.00
2020 1230 0000 1698	000876	新 希 望	2020年12月 30日	2021年1 月27日	22.40	55,500	1,243,2 00.00
2020 1230 0000 2561	002475	立讯精密	2020年12月 30日	2021年1 月27日	56.12	30,000	1,683,6 00.00
2020 1230 0000 2802	002736	国信证券	2020年12月 30日	2021年1 月27日	13.64	31,100	424,204 .00
2020 1230 0000 2852	002958	青农商行	2020年12月 30日	2021年1 月27日	5.09	27,300	138,957 .00
2020 1230 0000 2874	601939	建设银行	2020年12月 30日	2021年1 月27日	6.28	18,800	118,064 .00
2020 1230 0000 2893	600745	闻泰科技	2020年12月 30日	2021年1 月27日	99.00	12,000	1,188,0 00.00
2020 1230 0000 2899	603288	海天味业	2020年12月 30日	2021年1 月27日	200.54	10,000	2,005,4 00.00
2020 1230 0000 2942	600068	葛洲坝	2020年12月 30日	2021年1 月27日	6.58	46,300	304,654 .00
2020 1230 0000 2972	601398	工商银行	2020年12月 30日	2021年1 月27日	4.99	98,800	493,012 .00
2020 1230 0000 3019	601318	中国平安	2020年12月 30日	2021年1 月27日	86.98	10,000	869,800 .00
2020	600660	福耀玻璃	2020年12月	2021年1	48.05	11,200	538,160

1230 0000 3034			30 日	月 27 日			.00
2020 1230 0000 3149	601989	中国重工	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	4.19	15,800	66,202. 00
2020 1230 0000 3167	601166	兴业银行	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	20.87	48,000	1,001,7 60.00
2020 1230 0000 3194	600703	三安光电	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	27.01	31,800	858,918 .00
2020 1230 0000 3323	601933	永辉超市	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	7.18	10,000	71,800. 00
2020 1230 0000 3452	600547	山东黄金	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	23.62	17,200	406,264 .00
2020 1230 0000 3468	600276	恒瑞医药	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	111.46	10,000	1,114,6 00.00
2020 1230 0000 3476	600837	海通证券	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	12.86	60,200	774,172 .00
2020 1230 0000 3499	603259	药明康德	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	134.72	10,000	1,347,2 00.00
2020 1230 0000 3548	601727	上海电气	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	5.40	12,000	64,800. 00
2020 1230 0000 3595	601319	中国人保	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	6.57	41,500	272,655 .00
2020 1230	603993	洛阳钼业	2020 年 12 月 30 日	2021 年 1 月 27 日	6.25	19,900	124,375 .00

0000 3601							
2020 1230 0000 3606	600760	中航沈飞	2020年12月 30日	2021年1 月27日	78.18	10,200	797,436 .00
2020 1230 0000 3609	601899	紫金矿业	2020年12月 30日	2021年1 月27日	9.29	38,800	360,452 .00
2020 1230 0000 3610	600010	包钢股份	2020年12月 30日	2021年1 月27日	1.17	79,800	93,366. 00
2020 1231 0000 0342	000703	恒逸石化	2020年12月 31日	2021年1 月28日	12.80	37,500	480,000 .00
2020 1231 0000 0370	000100	TCL 科技	2020年12月 31日	2021年1 月28日	7.08	124,300	880,044 .00
2020 1231 0000 0386	000725	京东方 A	2020年12月 31日	2021年1 月28日	6.00	27,400	164,400 .00
2020 1231 0000 0388	000786	北新建材	2020年12月 31日	2021年1 月28日	40.05	15,300	612,765 .00
2020 1231 0000 0411	000961	中南建设	2020年12月 31日	2021年1 月28日	8.83	48,600	429,138 .00
2020 1231 0000 0423	002007	华兰生物	2020年12月 31日	2021年1 月28日	42.24	18,200	768,768 .00
2020 1231 0000 0428	002027	分众传媒	2020年12月 31日	2021年1 月28日	9.87	123,000	1,214,0 10.00
2020 1231 0000	002142	宁波银行	2020年12月 31日	2021年1 月28日	35.34	76,200	2,692,9 08.00

0451							
2020 1231 0000 0454	002157	正邦科技	2020年12月 31日	2021年1 月28日	17.04	11,800	201,072 .00
2020 1231 0000 0455	002202	金风科技	2020年12月 31日	2021年1 月28日	14.25	10,800	153,900 .00
2020 1231 0000 0481	002422	科伦药业	2020年12月 31日	2021年1 月28日	19.44	25,100	487,944 .00
2020 1231 0000 0501	002624	完美世界	2020年12月 31日	2021年1 月28日	29.50	20,000	590,000 .00
2020 1231 0000 0515	002415	海康威视	2020年12月 31日	2021年1 月28日	48.51	27,700	1,343,7 27.00
2020 1231 0000 0528	002812	恩捷股份	2020年12月 31日	2021年1 月28日	141.78	10,000	1,417,8 00.00
2020 1231 0000 0558	300059	东方财富	2020年12月 31日	2021年1 月28日	31.00	29,200	905,200 .00
2020 1231 0000 0561	601628	中国人寿	2020年12月 31日	2021年1 月28日	38.39	21,600	829,224 .00
2020 1231 0000 0585	600872	中炬高新	2020年12月 31日	2021年1 月28日	66.65	10,000	666,500 .00
2020 1231 0000 0603	600031	三一重工	2020年12月 31日	2021年1 月28日	34.98	31,200	1,091,3 76.00
2020 1231 0000 0633	600061	国投资本	2020年12月 31日	2021年1 月28日	13.83	32,800	453,624 .00

2020 1231 0000 0735	601225	陕西煤业	2020年12月 31日	2021年1 月28日	9.34	58,600	547,324 .00
2020 1231 0000 0763	600585	海螺水泥	2020年12月 31日	2021年1 月28日	51.62	50,700	2,617,1 34.00
2020 1231 0000 0779	601216	君正集团	2020年12月 31日	2021年1 月28日	4.95	15,000	74,250. 00
2020 1231 0000 0796	601238	广汽集团	2020年12月 31日	2021年1 月28日	13.29	13,200	175,428 .00
2020 1231 0000 0837	600438	通威股份	2020年12月 31日	2021年1 月28日	38.44	10,600	407,464 .00
2020 1231 0000 0898	601108	财通证券	2020年12月 31日	2021年1 月28日	12.65	30,000	379,500 .00
2020 1231 0000 0905	600369	西南证券	2020年12月 31日	2021年1 月28日	5.38	44,400	238,872 .00
2020 1231 0000 0910	601901	方正证券	2020年12月 31日	2021年1 月28日	10.37	71,000	736,270 .00
2020 1231 0000 0913	601990	南京证券	2020年12月 31日	2021年1 月28日	12.27	13,200	161,964 .00
2020 1231 0000 0915	601633	长城汽车	2020年12月 31日	2021年1 月28日	37.81	10,900	412,129 .00
2020 1231 0000 0917	601698	中国卫通	2020年12月 31日	2021年1 月28日	18.14	11,100	201,354 .00
合计	-	-	-	-	-	14,272,6	253,902



						00	,848.00
--	--	--	--	--	--	----	---------

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人借券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。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管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券（上

年末：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

##### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：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。

##### 7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内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%，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该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，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。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	21,660,136.06	-	-	-	21,660,136.06
结算备付金	3,114,791.01	-	-	-	3,114,791.01
存出保证金	208,087.33	-	-	2,811,124.80	3,019,212.13
交易性金融资产	-	-	-	2,183,066,779.59	2,183,066,779.59
买入返售金融资产	8,000,000.00	-	-	-	8,000,000.00
应收利息	-	-	-	80,090.66	80,090.66
应收证券清算款	-	-	-	6,187,886.53	6,187,886.53
其他资产	-	-	-	45.00	45.00

资产总计	32,983,014.40	-	-	-2,192,145,926.58	2,225,128,940.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	760,539.26	760,539.26
应付托管费	-	-	-	152,107.85	152,107.85
应付交易费用	-	-	-	429,941.13	429,941.13
应交税费	-	-	-	101,833.34	101,833.34
其他负债	-	-	-	16,163,060.58	16,163,060.58
负债总计	-	-	-	17,607,482.16	17,607,482.16
利率敏感度缺口	32,983,014.40	-	-	-2,174,538,444.42	2,207,521,458.82
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	7,423,664.96	-	-	-	7,423,664.96
结算备付金	4,503,922.29	-	-	-	4,503,922.29
存出保证金	143,797.40	-	-	1,235,940.00	1,379,737.40
交易性金融资产	-	-	-	-5,765,486,844.86	5,765,486,844.86
应收证券清算款	-	-	-	9,766,613.45	9,766,613.45
应收利息	-	-	-	144,489.26	144,489.26
应收股利	-	-	-	321,926.90	321,926.90
其他资产	-	-	-	36,469.15	36,469.15
资产总计	12,071,384.65	-	-	-5,776,992,283.62	5,789,063,668.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,268,883.09	2,268,883.09
应付托管费	-	-	-	453,776.64	453,776.64
应付交易费用	-	-	-	555,686.86	555,686.86
其他负债	-	-	-	5,552,969.58	5,552,969.58
负债总计	-	-	-	8,831,316.17	8,831,316.17
利率敏感度缺口	12,071,384.65	-	-	-5,768,160,967.45	5,780,232,352.10

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金未持有债券资产(上年末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年末：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格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证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	2,183,066,779.59	98.89	5,765,486,844.86	99.74
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	2,183,066,779.59	98.89	5,765,486,844.86	99.74

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”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12月31日)	上年度末(2019年12月31日)	
分析	沪深 300 指数下降 5%	-109,020,825.38	-301,880,052.02
	沪深 300 指数上升 5%	109,020,825.38	301,880,052.02

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,177,333,268.97 元，属于第二层次的余额为 5,733,510.62 元，无属于第三层次的余额(2019 年 12 月 31 日：第一层次 5,752,889,641.76 元，第二层次 12,597,203.10 元，无第三层次)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

###### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

###### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2019 年 12 月 31 日：同)。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允

价值相差很小。

## (2) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 1,705,318,990.23 元(2019 年度：1,682,750,122.61 元)，其中包括以股票支付的申购款 1,052,421,290.69 元和以现金支付的申购款 652,897,699.54 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 1,134,296,876.49 元和以现金支付的申购款 548,453,246.12 元)。

(3)除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,183,066,779.59	98.11
	其中：股票	2,183,066,779.59	98.11
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	0.00	0.00
	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	8,000,000.00	0.36
	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	24,774,927.07	1.11
8	其他各项资产	9,287,234.32	0.42
9	合计	2,225,128,940.98	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、本基金本报告期末参与转融通证券出借业务融出证券市值为 253,902,848 元，占基金资产净值比例 11.5%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	25,079,564.34	1.14
B	采矿业	47,758,892.07	2.16
C	制造业	1,144,021,011.96	51.82
D	电力、热力、燃气	36,340,206.68	1.65

	及水生产和供应业		
E	建筑业	33,481,424.42	1.52
F	批发和零售业	15,621,968.96	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	57,486,744.84	2.60
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	67,595,857.50	3.06
J	金融业	577,035,656.02	26.14
K	房地产业	63,361,311.08	2.87
L	租赁和商务服务业	41,864,600.40	1.90
M	科学研究和技术服务业	21,989,044.80	1.00
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	2,705,010.00	0.12
Q	卫生和社会工作	33,394,203.32	1.51
R	文化、体育和娱乐业	10,703,278.80	0.48
S	综合	-	-
	合计	2,178,438,775.19	98.68

### 8.2.2 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	4,115,160.83	0.19
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	16,322.72	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	22,089.22	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	387,446.02	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服	15,649.20	0.00



	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	48,261.27	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,613,904.40	0.21

### 8.2.3 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 8.3.1 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	600519	贵州茅台	55,876	111,640,248.00	5.06
2	601318	中国平安	1,203,662	104,694,520.76	4.74
3	000858	五粮液	215,600	62,922,860.00	2.85
4	600036	招商银行	1,374,303	60,400,616.85	2.74
5	000333	美的集团	545,698	53,718,511.12	2.43
6	600276	恒瑞医药	414,695	46,221,904.70	2.09
7	601166	兴业银行	1,615,379	33,712,959.73	1.53
8	000651	格力电器	534,416	33,101,727.04	1.50
9	601888	中国中免	108,432	30,626,618.40	1.39
10	600887	伊利股份	676,097	29,998,423.89	1.36
11	600030	中信证券	944,892	27,779,824.80	1.26
12	601012	隆基股份	292,552	26,973,294.40	1.22
13	002475	立讯精密	464,865	26,088,223.80	1.18
14	300059	东方财富	764,531	23,700,461.00	1.07
15	600031	三一重工	658,800	23,044,824.00	1.04
16	000002	万科A	756,254	21,704,489.80	0.98
17	603288	海天味业	108,016	21,661,528.64	0.98
18	000001	平安银行	1,077,026	20,829,682.84	0.94
19	002415	海康威视	415,516	20,156,681.16	0.91
20	002594	比亚迪	100,700	19,566,010.00	0.89
21	601398	工商银行	3,895,400	19,438,046.00	0.88
22	600900	长江电力	1,007,398	19,301,745.68	0.87
23	603259	药明康德	141,940	19,122,156.80	0.87

24	000568	泸州老窖	81,700	18,477,272.00	0.84
25	000725	京东方A	3,002,700	18,016,200.00	0.82
26	002352	顺丰控股	202,490	17,865,692.70	0.81
27	002714	牧原股份	208,312	16,060,855.20	0.73
28	600309	万华化学	174,401	15,877,467.04	0.72
29	002304	洋河股份	66,881	15,783,247.19	0.71
30	601601	中国太保	380,327	14,604,556.80	0.66
31	600809	山西汾酒	38,700	14,523,723.00	0.66
32	601899	紫金矿业	1,524,950	14,166,785.50	0.64
33	000661	长春高新	31,510	14,145,154.10	0.64
34	600585	海螺水泥	265,989	13,730,352.18	0.62
35	300015	爱尔眼科	182,606	13,675,363.34	0.62
36	601328	交通银行	3,036,000	13,601,280.00	0.62
37	600048	保利地产	797,550	12,617,241.00	0.57
38	600000	浦发银行	1,302,875	12,611,830.00	0.57
39	600690	海尔智家	420,100	12,271,121.00	0.56
40	600016	民生银行	2,358,500	12,264,200.00	0.56
41	002142	宁波银行	333,804	11,796,633.36	0.53
42	601688	华泰证券	650,301	11,711,921.01	0.53
43	600438	通威股份	301,300	11,581,972.00	0.52
44	601668	中国建筑	2,324,100	11,550,777.00	0.52
45	002027	分众传媒	1,138,600	11,237,982.00	0.51
46	603501	韦尔股份	47,643	11,010,297.30	0.50
47	000100	TCL 科技	1,552,800	10,993,824.00	0.50
48	600837	海通证券	854,600	10,990,156.00	0.50
49	300124	汇川技术	114,600	10,692,180.00	0.48
50	300122	智飞生物	71,081	10,513,590.71	0.48
51	300014	亿纬锂能	126,722	10,327,843.00	0.47
52	000063	中兴通讯	301,300	10,138,745.00	0.46
53	601288	农业银行	3,176,400	9,973,896.00	0.45
54	600570	恒生电子	92,267	9,678,808.30	0.44
55	600999	招商证券	410,894	9,590,265.96	0.43
56	600104	上汽集团	390,206	9,536,634.64	0.43
57	002241	歌尔股份	253,818	9,472,487.76	0.43
58	300347	泰格医药	57,800	9,341,058.00	0.42
59	300498	温氏股份	494,718	9,018,709.14	0.41
60	600436	片仔癀	33,500	8,961,585.00	0.41
61	601211	国泰君安	499,400	8,754,482.00	0.40
62	601229	上海银行	1,101,470	8,635,524.80	0.39
63	002460	赣锋锂业	85,300	8,632,360.00	0.39
64	000338	潍柴动力	532,900	8,414,491.00	0.38
65	002410	广联达	105,446	8,302,818.04	0.38

66	600009	上海机场	106,117	8,028,812.22	0.36
67	600588	用友网络	181,071	7,943,584.77	0.36
68	601169	北京银行	1,639,454	7,934,957.36	0.36
69	002230	科大讯飞	193,503	7,908,467.61	0.36
70	600660	福耀玻璃	155,869	7,489,505.45	0.34
71	601988	中国银行	2,332,000	7,415,760.00	0.34
72	603986	兆易创新	37,038	7,315,005.00	0.33
73	600919	江苏银行	1,332,730	7,276,705.80	0.33
74	600196	复星医药	134,000	7,234,660.00	0.33
75	601766	中国中车	1,348,930	7,162,818.30	0.32
76	600893	航发动力	119,963	7,119,804.05	0.32
77	002271	东方雨虹	182,656	7,087,052.80	0.32
78	601628	中国人寿	184,200	7,071,438.00	0.32
79	601818	光大银行	1,769,900	7,061,901.00	0.32
80	600763	通策医疗	25,000	6,913,000.00	0.31
81	600406	国电南瑞	257,974	6,854,369.18	0.31
82	002812	恩捷股份	48,200	6,833,796.00	0.31
83	600703	三安光电	247,322	6,680,167.22	0.30
84	300142	沃森生物	172,400	6,647,744.00	0.30
85	300601	康泰生物	38,000	6,631,000.00	0.30
86	601088	中国神华	365,100	6,575,451.00	0.30
87	601919	中远海控	537,400	6,561,654.00	0.30
88	600346	恒力石化	233,080	6,519,247.60	0.30
89	000538	云南白药	56,700	6,441,120.00	0.29
90	002049	紫光国微	47,000	6,289,070.00	0.28
91	002493	荣盛石化	224,750	6,205,347.50	0.28
92	603799	华友钴业	76,924	6,100,073.20	0.28
93	600028	中国石化	1,482,300	5,973,669.00	0.27
94	601390	中国中铁	1,124,900	5,928,223.00	0.27
95	600019	宝钢股份	988,638	5,882,396.10	0.27
96	002311	海大集团	89,100	5,836,050.00	0.26
97	300413	芒果超媒	80,236	5,817,110.00	0.26
98	000876	新希望	252,300	5,651,520.00	0.26
99	000768	中航西飞	151,969	5,574,222.92	0.25
100	000895	双汇发展	117,110	5,497,143.40	0.25
101	600745	闻泰科技	55,411	5,485,689.00	0.25
102	600958	东方证券	463,200	5,387,016.00	0.24
103	601009	南京银行	666,300	5,383,704.00	0.24
104	000625	长安汽车	245,037	5,361,409.56	0.24
105	600584	长电科技	125,900	5,359,563.00	0.24
106	601336	新华保险	92,300	5,350,631.00	0.24
107	000776	广发证券	326,700	5,318,676.00	0.24

108	000166	申万宏源	1,002,761	5,294,578.08	0.24
109	002007	华兰生物	122,630	5,179,891.20	0.23
110	601377	兴业证券	592,500	5,142,900.00	0.23
111	601633	长城汽车	134,800	5,096,788.00	0.23
112	002129	中环股份	199,500	5,087,250.00	0.23
113	600741	华域汽车	175,367	5,054,076.94	0.23
114	002371	北方华创	27,900	5,042,646.00	0.23
115	000157	中联重科	507,400	5,023,260.00	0.23
116	601100	恒立液压	43,456	4,910,528.00	0.22
117	002821	凯莱英	16,381	4,900,212.34	0.22
118	600926	杭州银行	328,300	4,898,236.00	0.22
119	603993	洛阳钼业	782,100	4,888,125.00	0.22
120	002050	三花智控	197,617	4,871,259.05	0.22
121	002001	新和成	142,611	4,803,138.48	0.22
122	002179	中航光电	61,210	4,792,130.90	0.22
123	600547	山东黄金	202,540	4,783,994.80	0.22
124	601877	正泰电器	120,885	4,733,856.60	0.21
125	001979	招商蛇口	352,722	4,687,675.38	0.21
126	601939	建设银行	743,921	4,671,823.88	0.21
127	600176	中国巨石	232,200	4,634,712.00	0.21
128	600050	中国联通	1,035,600	4,618,776.00	0.21
129	601901	方正证券	441,500	4,578,355.00	0.21
130	300408	三环集团	122,635	4,568,153.75	0.21
131	000786	北新建材	112,700	4,513,635.00	0.20
132	601857	中国石油	1,078,800	4,477,020.00	0.20
133	300433	蓝思科技	144,638	4,427,369.18	0.20
134	601066	中信建投	104,900	4,405,800.00	0.20
135	002202	金风科技	307,848	4,386,834.00	0.20
136	002555	三七互娱	140,300	4,381,569.00	0.20
137	600109	国金证券	268,200	4,363,614.00	0.20
138	002736	国信证券	319,300	4,355,252.00	0.20
139	002841	视源股份	37,858	4,354,805.74	0.20
140	601006	大秦铁路	663,757	4,287,870.22	0.19
141	600015	华夏银行	683,200	4,270,000.00	0.19
142	601989	中国重工	1,012,870	4,243,925.30	0.19
143	000860	顺鑫农业	57,862	4,197,309.48	0.19
144	688008	澜起科技	50,200	4,160,576.00	0.19
145	601225	陕西煤业	445,300	4,159,102.00	0.19
146	002601	龙蟠佰利	135,100	4,157,027.00	0.19
147	600872	中炬高新	61,900	4,125,635.00	0.19
148	002008	大族激光	94,600	4,044,150.00	0.18
149	601788	光大证券	218,100	4,039,212.00	0.18

150	603160	汇顶科技	25,955	4,037,300.25	0.18
151	601186	中国铁建	510,400	4,032,160.00	0.18
152	603369	今世缘	69,772	4,003,517.36	0.18
153	600600	青岛啤酒	39,900	3,966,060.00	0.18
154	002236	大华股份	197,700	3,932,253.00	0.18
155	600352	浙江龙盛	287,500	3,915,750.00	0.18
156	002938	鹏鼎控股	78,500	3,899,095.00	0.18
157	603019	中科曙光	111,940	3,831,706.20	0.17
158	002624	完美世界	129,750	3,827,625.00	0.17
159	300003	乐普医疗	140,040	3,806,287.20	0.17
160	002600	领益智造	313,900	3,763,661.00	0.17
161	688012	中微公司	23,680	3,731,731.20	0.17
162	003816	中国广核	1,314,000	3,705,480.00	0.17
163	000066	中国长城	194,300	3,689,757.00	0.17
164	603899	晨光文具	41,600	3,684,096.00	0.17
165	600760	中航沈飞	46,589	3,642,328.02	0.16
166	000783	长江证券	427,800	3,593,520.00	0.16
167	600183	生益科技	127,325	3,585,472.00	0.16
168	601360	三六零	225,622	3,544,521.62	0.16
169	601108	财通证券	278,300	3,520,495.00	0.16
170	002044	美年健康	305,806	3,464,781.98	0.16
171	601155	新城控股	99,400	3,462,102.00	0.16
172	000596	古井贡酒	12,700	3,454,400.00	0.16
173	002384	东山精密	132,700	3,450,200.00	0.16
174	601555	东吴证券	346,660	3,418,067.60	0.15
175	600383	金地集团	253,100	3,416,850.00	0.15
176	601985	中国核电	688,700	3,388,404.00	0.15
177	601669	中国电建	852,000	3,305,760.00	0.15
178	000938	紫光股份	161,473	3,302,122.85	0.15
179	000069	华侨城 A	455,900	3,232,331.00	0.15
180	002024	苏宁易购	414,000	3,191,940.00	0.14
181	600111	北方稀土	240,600	3,149,454.00	0.14
182	002456	欧菲光	238,300	3,140,794.00	0.14
183	300144	宋城演艺	175,140	3,103,480.80	0.14
184	300136	信维通信	86,381	3,099,350.28	0.14
185	601878	浙商证券	199,100	3,046,230.00	0.14
186	601138	工业富联	221,800	3,036,442.00	0.14
187	300529	健帆生物	44,600	3,024,772.00	0.14
188	601933	永辉超市	420,500	3,019,190.00	0.14
189	000977	浪潮信息	112,008	3,010,775.04	0.14
190	600161	天坛生物	71,500	2,981,550.00	0.14
191	300033	同花顺	23,960	2,970,560.80	0.13

192	600010	包钢股份	2,533,100	2,963,727.00	0.13
193	002602	世纪华通	414,127	2,944,442.97	0.13
194	002414	高德红外	70,500	2,943,375.00	0.13
195	600522	中天科技	271,500	2,943,060.00	0.13
196	600795	国电电力	1,305,700	2,937,825.00	0.13
197	600029	南方航空	491,300	2,928,148.00	0.13
198	300676	华大基因	22,300	2,866,888.00	0.13
199	601800	中国交建	394,400	2,863,344.00	0.13
200	000425	徐工机械	522,400	2,805,288.00	0.13
201	688036	传音控股	17,850	2,715,699.00	0.12
202	002607	中公教育	77,000	2,705,010.00	0.12
203	600886	国投电力	309,900	2,677,536.00	0.12
204	603833	欧派家居	19,774	2,659,603.00	0.12
205	000703	恒逸石化	206,790	2,646,912.00	0.12
206	601600	中国铝业	726,400	2,636,832.00	0.12
207	000728	国元证券	289,370	2,592,755.20	0.12
208	600705	中航资本	591,086	2,588,956.68	0.12
209	600061	国投资本	186,190	2,575,007.70	0.12
210	000963	华东医药	96,920	2,574,195.20	0.12
211	601838	成都银行	240,300	2,564,001.00	0.12
212	000656	金科股份	358,300	2,540,347.00	0.12
213	002463	沪电股份	133,800	2,514,102.00	0.11
214	601111	中国国航	331,100	2,479,939.00	0.11
215	600066	宇通客车	146,320	2,475,734.40	0.11
216	601607	上海医药	128,768	2,472,345.60	0.11
217	000708	中信特钢	109,630	2,388,837.70	0.11
218	002157	正邦科技	139,600	2,378,784.00	0.11
219	600606	绿地控股	406,800	2,371,644.00	0.11
220	002916	深南电路	21,796	2,355,275.76	0.11
221	600362	江西铜业	117,500	2,344,125.00	0.11
222	600115	东方航空	497,900	2,330,172.00	0.11
223	601021	春秋航空	41,100	2,278,173.00	0.10
224	601162	天风证券	370,150	2,257,915.00	0.10
225	600340	华夏幸福	174,240	2,252,923.20	0.10
226	002252	上海莱士	301,300	2,229,620.00	0.10
227	600177	雅戈尔	308,705	2,219,588.95	0.10
228	600011	华能国际	492,200	2,205,056.00	0.10
229	300628	亿联网络	30,101	2,200,985.12	0.10
230	603658	安图生物	15,113	2,194,105.34	0.10
231	601727	上海电气	405,700	2,190,780.00	0.10
232	600487	亨通光电	156,409	2,188,161.91	0.10
233	601618	中国中冶	793,054	2,165,037.42	0.10

234	601816	京沪高铁	381,400	2,158,724.00	0.10
235	002508	老板电器	52,071	2,123,455.38	0.10
236	002422	科伦药业	109,200	2,122,848.00	0.10
237	600118	中国卫星	63,500	2,043,430.00	0.09
238	002120	韵达股份	129,871	2,038,974.70	0.09
239	600637	东方明珠	227,245	2,031,570.30	0.09
240	600068	葛洲坝	307,900	2,025,982.00	0.09
241	601990	南京证券	164,900	2,023,323.00	0.09
242	601198	东兴证券	151,048	2,011,959.36	0.09
243	002773	康弘药业	41,510	1,998,706.50	0.09
244	600369	西南证券	368,300	1,981,454.00	0.09
245	600845	宝信软件	28,500	1,965,930.00	0.09
246	002673	西部证券	193,000	1,957,020.00	0.09
247	600489	中金黄金	217,500	1,916,175.00	0.09
248	600498	烽火通信	79,300	1,909,544.00	0.09
249	000961	中南建设	211,400	1,866,662.00	0.08
250	600004	白云机场	131,600	1,859,508.00	0.08
251	601216	君正集团	375,000	1,856,250.00	0.08
252	601658	邮储银行	374,000	1,787,720.00	0.08
253	601881	中国银河	142,616	1,784,126.16	0.08
254	002739	万达电影	98,600	1,782,688.00	0.08
255	600332	白云山	60,717	1,775,972.25	0.08
256	600018	上港集团	388,600	1,775,902.00	0.08
257	601998	中信银行	343,800	1,756,818.00	0.08
258	600390	五矿资本	250,135	1,745,942.30	0.08
259	688009	中国通号	284,620	1,667,873.20	0.08
260	600233	圆通速递	140,300	1,613,450.00	0.07
261	601117	中国化学	274,300	1,610,141.00	0.07
262	600918	中泰证券	86,500	1,600,250.00	0.07
263	600271	航天信息	125,100	1,576,260.00	0.07
264	002558	巨人网络	90,297	1,573,876.71	0.07
265	002958	青农商行	308,300	1,569,247.00	0.07
266	601319	中国人保	236,767	1,555,559.19	0.07
267	600655	豫园股份	174,600	1,552,194.00	0.07
268	600998	九州通	84,076	1,526,820.16	0.07
269	000723	美锦能源	227,900	1,522,372.00	0.07
270	601236	红塔证券	81,400	1,513,226.00	0.07
271	601916	浙商银行	370,700	1,512,456.00	0.07
272	600208	新湖中宝	475,067	1,472,707.70	0.07
273	601231	环旭电子	75,500	1,460,170.00	0.07
274	603156	养元饮品	55,112	1,424,094.08	0.06
275	002032	苏泊尔	18,100	1,411,619.00	0.06

276	600085	同仁堂	59,000	1,410,100.00	0.06
277	601238	广汽集团	102,140	1,357,440.60	0.06
278	600150	中国船舶	75,900	1,342,671.00	0.06
279	603195	公牛集团	6,500	1,334,385.00	0.06
280	002939	长城证券	102,800	1,323,036.00	0.06
281	600482	中国动力	73,817	1,322,800.64	0.06
282	600848	上海临港	64,700	1,295,294.00	0.06
283	600297	广汇汽车	449,400	1,285,284.00	0.06
284	601872	招商轮船	226,500	1,279,725.00	0.06
285	002146	荣盛发展	191,200	1,248,536.00	0.06
286	600027	华电国际	362,400	1,232,160.00	0.06
287	000671	阳光城	182,900	1,192,508.00	0.05
288	002153	石基信息	36,600	1,137,894.00	0.05
289	601577	长沙银行	115,300	1,097,656.00	0.05
290	000627	天茂集团	219,700	1,069,939.00	0.05
291	603392	万泰生物	5,300	1,068,109.00	0.05
292	601696	中银证券	35,500	982,640.00	0.04
293	600989	宝丰能源	82,500	965,250.00	0.04
294	603087	甘李药业	6,800	899,096.00	0.04
295	600025	华能水电	200,000	892,000.00	0.04
296	601698	中国卫通	48,600	881,604.00	0.04
297	601077	渝农商行	193,500	870,750.00	0.04
298	601808	中海油服	64,101	818,569.77	0.04
299	002945	华林证券	30,100	453,607.00	0.02
300	600299	安迪苏	33,600	386,736.00	0.02

### 8.3.2 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	300888	稳健医疗	10,265	1,605,343.35	0.07
2	688336	三生国健	14,352	348,610.08	0.02
3	688508	芯朋微	3,729	342,732.39	0.02
4	688277	天智航	8,810	330,639.30	0.01
5	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
6	688488	艾迪药业	9,934	243,184.32	0.01
7	688550	瑞联新材	2,539	213,479.12	0.01
8	688286	敏芯股份	1,681	197,231.73	0.01
9	688418	震有科技	6,178	158,403.92	0.01
10	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.01
11	300920	润阳科技	2,503	85,427.39	0.00
12	688585	上纬新材	4,922	61,574.22	0.00



13	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
14	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
15	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
16	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
17	300877	金春股份	686	35,121.78	0.00
18	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
19	300878	维康药业	506	24,817.17	0.00
20	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
21	300873	海晨股份	533	22,089.22	0.00
22	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
23	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
24	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
25	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
26	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
27	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
28	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
29	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
30	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
31	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
32	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
33	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
34	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
35	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
36	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
37	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
38	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
39	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
40	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
41	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
42	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
43	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
44	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
45	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	40,881,350.12	0.71
2	000333	美的集团	37,413,261.87	0.65
3	000651	格力电器	33,278,333.28	0.58
4	000002	万科A	24,838,337.57	0.43
5	002916	深南电路	23,162,628.86	0.40

6	603160	汇顶科技	22,477,030.01	0.39
7	002475	立讯精密	21,478,346.68	0.37
8	000596	古井贡酒	18,634,705.55	0.32
9	002352	顺丰控股	18,258,210.42	0.32
10	603501	韦尔股份	18,033,140.68	0.31
11	000001	平安银行	17,580,097.49	0.30
12	000725	京东方A	17,045,298.00	0.29
13	300059	东方财富	16,730,563.70	0.29
14	002304	洋河股份	16,208,068.00	0.28
15	601398	工商银行	16,175,078.00	0.28
16	002415	海康威视	15,870,469.75	0.27
17	603986	兆易创新	15,343,245.00	0.27
18	600519	贵州茅台	15,214,767.00	0.26
19	002714	牧原股份	15,088,298.58	0.26
20	002371	北方华创	14,894,404.00	0.26

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超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	000858	五粮液	129,783,099.84	2.25
2	000651	格力电器	124,346,485.78	2.15
3	000333	美的集团	123,385,117.92	2.13
4	600519	贵州茅台	77,846,737.49	1.35
5	000002	万科A	75,731,011.53	1.31
6	002475	立讯精密	73,611,666.76	1.27
7	000001	平安银行	61,942,363.71	1.07
8	002415	海康威视	56,134,676.94	0.97
9	000725	京东方A	51,257,074.27	0.89
10	300498	温氏股份	49,867,487.08	0.86
11	300059	东方财富	49,754,855.53	0.86
12	000063	中兴通讯	44,457,064.81	0.77
13	002714	牧原股份	44,300,281.05	0.77
14	688981	中芯国际	40,092,179.94	0.69
15	000661	长春高新	35,936,813.24	0.62
16	002304	洋河股份	35,756,509.42	0.62
17	002142	宁波银行	35,359,657.95	0.61
18	000100	TCL科技	34,030,347.45	0.59
19	000568	泸州老窖	30,847,329.63	0.53
20	000338	潍柴动力	30,053,539.51	0.52

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,331,490,808.04
卖出股票收入（成交）总额	2,797,455,370.78

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2103	IF2103	13	20,325,240.00	1,013,532.00	-
IF2106	IF2106	2	3,100,800.00	128,400.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,141,932.00
股指期货投资本期收益（元）					9,467,182.51
股指期货投资本期公允价值变动（元）					383,411.01

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金以套期保值为目的开展股指期货投资，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

中国银保监会福建监管局于 2020 年 8 月 31 日做出闽银保监罚决字（2020）24 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司：同业投资用途不合规、授信管理不尽职、采用不正当手段吸收存款、理财资金间接投资本行信贷资产收益权、非洁净转让信贷资产、违规接受地方财政部门担保。根据相关规定对公司没收违法所得 6,361,807.97 元，并合计处以罚款 15,961,807.97 元。

中国人民银行福州中心支行于 2020 年 9 月 4 日做出福银罚字（2020）35 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司：1. 为无证机构提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性的规定；2. 为支付机构超范围（超业务、超地域）经营提供支付服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；3. 违规连通上、下游支付机构，提供转接清算服务，且未落实交易信息真实性、完整性、可追溯性及支付全流程中的一致性；4. 违反银行卡收单外包管理规定；5. 未按规定履行客户身份识别义务。根据相关规定给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

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。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,019,212.13
2	应收证券清算款	6,187,886.53
3	应收股利	-
4	应收利息	80,090.66
5	应收申购款	-

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	45.00
9	合计	9,287,234.32

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	601318	中国平安	15,560,722.00	0.70	转融通流通受限
2	000858	五粮液	13,921,245.00	0.63	转融通流通受限
3	600036	招商银行	11,765,415.00	0.53	转融通流通受限
4	601166	兴业银行	5,720,467.00	0.26	转融通流通受限
5	601888	中国中免	4,575,690.00	0.21	转融通流通受限
6	000651	格力电器	4,323,412.00	0.20	转融通流通受限
7	600276	恒瑞医药	3,343,800.00	0.15	转融通流通受限
8	600887	伊利股份	2,711,007.00	0.12	转融通流通受限
9	000333	美的集团	2,067,240.00	0.09	转融通流通受限

##### 8.12.5.2 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	300888	稳健医疗	1,605,343.35	0.07	新股锁定
2	688336	三生国健	348,610.08	0.02	新股锁定
3	688508	芯朋微	342,732.39	0.02	新股锁定
4	688277	天智航	330,639.30	0.01	新股锁定
5	300896	爱美客	285,389.28	0.01	新股锁定

## 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
2,224	185,633.99	400,160,952.00	96.93	12,689,040.00	3.07

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
平安沪深 300ETF 联接基金	149,267,747.00	36.16

### 9.2 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	中国平安人寿保险股份 有限公司-万能-个 险万能	177,315,315.00	42.95
2	中信建投证券股份有 限公司	15,612,600.00	3.78
3	中国平安财产保险股 份有限公司-传统-普 通保险产品	10,482,938.00	2.54
4	中信证券股份有限公司 融券专用证券账户	9,900,000.00	2.40
5	广发证券股份有限公司	7,840,056.00	1.90
6	广发证券股份有限公司 融券专用证券账户	5,287,494.00	1.28
7	国信证券股份有限公 司	4,285,000.00	1.04
8	中国中金财富证券有 限公司转融通担保证 券明细账户	3,811,600.00	0.92
9	中国国际金融股份有 限公司	3,600,000.00	0.87
10	国盛证券有限责任公 司	3,068,800.00	0.74

11	平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	149,267,747.00	36.16
----	-------------------------------	----------------	-------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	300.00	0.0001

### 9.4 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

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2017年12月25日）基金份额总额	5,723,055,617.00
本报告期期初基金份额总额	1,362,349,992.00
本报告期基金总申购份额	378,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,327,500,000.00
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	412,849,992.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、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，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 80,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、本报告期内，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定，对相关责任人采取监管谈话措施。公司高度重视，及时向监管机构提交整改报告并完成整改。

2、本报告期内，本基金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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	1,180,662,201.07	28.88%	839,809.64	28.88%	新增
国盛证券	1	973,890,855.85	23.82%	692,730.46	23.82%	-
招商证券	3	714,213,726.05	17.47%	508,023.04	17.47%	-
海通证券	4	566,382,979.76	13.85%	402,850.02	13.85%	-
广发证券	2	308,228,347.84	7.54%	219,239.91	7.54%	-
中信建投证券	2	240,452,482.26	5.88%	171,022.40	5.88%	-
中泰证券	2	96,326,993.85	2.36%	68,519.79	2.36%	-
平安证券	2	7,936,235.53	0.19%	5,644.85	0.19%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证	3	-	-	-	-	-



券						
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	2	-	-	-	-	退租
长城证券	2	-	-	-	-	退租
东方财富 证券	2	-	-	-	-	新增

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	44,000,000.00	1.54%	-	-
海通证券	-	-	1,382,100,000.00	48.26%	-	-
广发证券	-	-	784,000,000.00	27.37%	-	-
中信建投 证券	-	-	65,000,000.00	2.27%	-	-
中泰证券	-	-	555,000,000.00	19.38%	-	-
平安证券	-	-	34,000,000.00	1.19%	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-

东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安沪深 300 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 01 月 17 日
2	平安沪深 300 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 01 月 17 日
3	平安沪深 300 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 01 月 17 日
4	平安沪深 300 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 01 月 17 日
5	关于平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同、托管协议调整申购赎回相关条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 01 月 17 日
6	平安沪深 300 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 01 月 20 日
7	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 02 月 29 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 03 月 14 日
9	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 03 月 27 日
10	平安沪深 300 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 04 月 22 日
11	平安沪深 300 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 04 月 30 日
12	平安基金管理有限公司关于提醒投资者完善身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 05 月 28 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增中信证券华南股份有限公司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 07 月 03 日
14	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 07 月 21 日
15	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（摘要）更新	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 08 月 06 日
16	平安沪深 300 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 08 月 06 日
17	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金	中国证监会规定报刊及	2020 年 08 月 25 日

	投资基金基金产品资料概要（更新）	网站	
18	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 08 月 28 日
19	平安基金管理有限公司关于提醒投资者警惕冒用本公司名称虚假宣传的提示公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 10 月 24 日
20	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 10 月 28 日
21	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 12 月 15 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 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--2020/07/01	586,000,091.00	-	586,000,091.00	-	-
	2	2020/01/01--2020/12/31	323,184,215.00	-	145,868,900.00	177,315,315.00	42.95
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2020/07/06--2020/12/31	148,356,386.00	84,777,910.00	83,866,549.00	149,267,747.00	36.16

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 13.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日