

平安深证 300 指数增强型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	49
7.12 投资组合报告附注	49
§ 8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	50
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	51
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	51
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	56
12.3 查阅方式	56

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	平安深证 300 指数增强
基金主代码	700002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 20 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	43,286,277.48 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪深证 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过全样本复制的方式拟合、跟踪深证 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理。以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。其中指数复制策略采用全样本复制的方式，即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上，辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资，以求获取超越标的指数的收益率表现。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	许俊
	联系电话	0755-22626828	010-66594319
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 1 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	5033 号平安金融中心 34 层	
邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	刘连舸

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021 年 1 月 1 日-2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	9,298,871.32
本期利润	14,929,232.74
加权平均基金份额本期利润	0.3610
本期加权平均净值利润率	12.98%
本期基金份额净值增长率	12.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	56,374,520.95
期末可供分配基金份额利润	1.3024
期末基金资产净值	131,675,292.18
期末基金份额净值	3.042
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	227.94%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

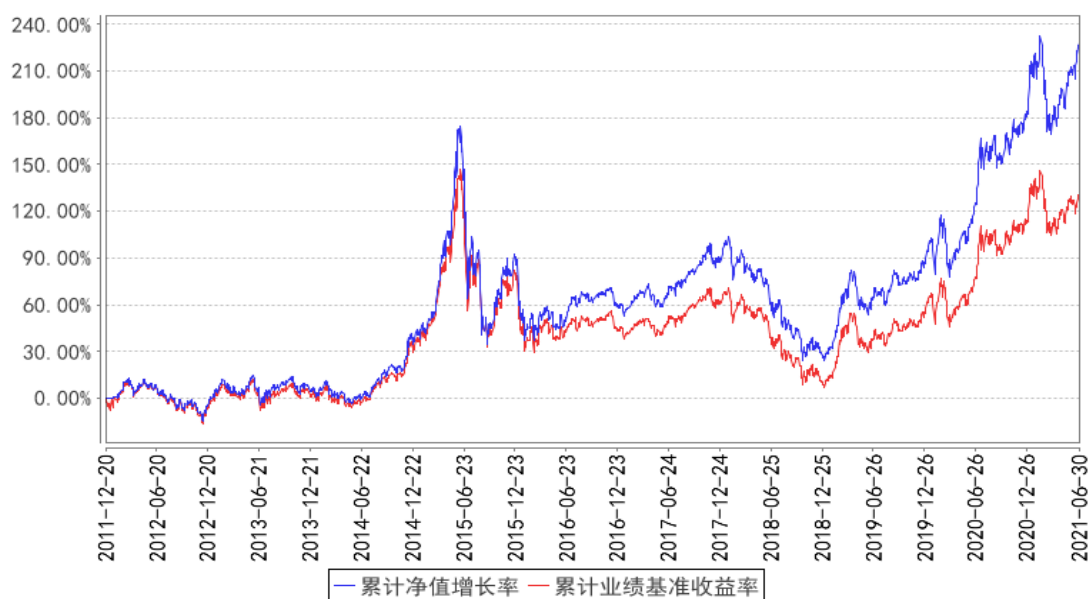
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.11%	1.05%	0.73%	1.00%	4.38%	0.05%
过去三个月	17.54%	1.14%	9.78%	1.09%	7.76%	0.05%
过去六个月	12.25%	1.57%	4.59%	1.45%	7.66%	0.12%
过去一年	43.15%	1.51%	28.15%	1.44%	15.00%	0.07%
过去三年	102.80%	1.51%	65.86%	1.50%	36.94%	0.01%
自基金合同生效起至今	227.94%	1.54%	130.81%	1.52%	97.13%	0.02%

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

平安深证300指数增强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 2011 年 12 月 20 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。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。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优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块。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 2021 年 6 月 30 日，平安基金共管理 138 只公募基金，公募资产管理总规模约为 3,831 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		
毛时超	平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金经理	2020 年 5 月 9 日	-	4 年	毛时超先生，中山大学硕士。2016 年 7 月加入平安基金管理有限公司，曾任衍生品投资中心衍生品研究员、基金经理助理。现担任平安安享灵活配置混合型证券投资基金、平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安量化精选混合型发起式证券投资基金、平安估值优势灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.3 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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，中国股市历经较大幅度的波动，不同行业出现显著的分化走势。以锂电池、新能源汽车、光伏等新经济成长型产业，由于政策支持、符合未来发展方向，并且产业景气度持续提升，具有很大的预期发展空间，在年初调整一段时间之后，大幅反弹领涨全市场。去年表现较好的大盘龙头股票，经过春节之前大幅上涨之后，估值处于历史相对高位，加上部分个股因为原材料成本上升或者消费需求下降，导致增速下滑业绩压力较大，在反弹行情中相比去年表现较差。

本基金采用量化多因子投资策略，从盈利成长、盈利质量、价格动量、分析师预期等维度，构建有效的选股阿尔法因子，控制相对基准指数的风险敞口与跟踪误差，最大化预期收益求解得到目标组合，并通过组合交易模型降低交易成本。由于是从公司基本面角度进行选股，相对基准

指数的行业和风格偏离较小，所以本基金的股票交易换手率较低，通过长期持有优质个股，有效地降低了交易成本，在控制跟踪误差较小的同时，争取实现较高的超额收益与信息比率，给投资者带来相对基准指数更好的回报。此外本基金积极参与主板和创业板新股询价申购，增厚基金的投资收益。

本基金跟踪的深证 300 指数，整体偏向医药、电子、电力新能源、食品饮料、家电等行业，且以深市较大市值股票为主。报告期内，受益于重仓行业和个股的反弹领涨，本基金收益表现较好，相比基准指数做出了一定的超额收益，实现了既定的投资目标。

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 3.042 元，本报告期基金份额净值增长率为 12.25%，业绩比较基准收益率为 4.59%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，大盘股票在过去两年大幅上涨、今年出现一定的调整之后，估值水平已经具有一定的吸引力，加上公司经营基本面良好、长期来看业绩保持增长，所以继续看好未来的收益表现。本基金跟踪的深证 300 指数，以深市偏成长行业的大市值、基本面优良股票为主，随着中国经济稳步向前发展，依然具有较大的上涨空间，叠加指数增强基金稳健的超额收益，长期来看具有较好的投资价值。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安深证 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安深证 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,415,388.41	5,830,121.83
结算备付金		40,829.69	37,574.46
存出保证金		8,189.03	6,069.70
交易性金融资产	6.4.7.2	124,764,396.59	102,645,358.08
其中：股票投资		124,718,770.76	102,645,358.08
基金投资		-	-

债券投资		45,625.83	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		72,011.01	99,117.46
应收利息	6.4.7.5	668.71	596.35
应收股利		-	-
应收申购款		370,922.63	388,276.68
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		133,672,406.07	109,007,114.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,724,658.47	415,171.12
应付管理人报酬		92,436.09	74,086.98
应付托管费		16,312.25	13,074.17
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	39,339.06	16,024.03
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	124,368.02	230,698.39
负债合计		1,997,113.89	749,054.69
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	43,286,277.48	39,940,297.62
未分配利润	6.4.7.10	88,389,014.70	68,317,762.25
所有者权益合计		131,675,292.18	108,258,059.87
负债和所有者权益总计		133,672,406.07	109,007,114.56

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 3.042 元，基金份额总额 43,286,277.48 份。

6.2 利润表

会计主体：平安深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
-----	-----	----	---------

		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		15,756,224.04	16,760,926.96
1. 利息收入		12,336.38	15,211.67
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,287.90	15,193.82
债券利息收入		48.48	17.85
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		10,030,444.62	5,774,738.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,369,961.28	5,050,432.33
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	67,632.13	12,441.99
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	592,851.21	711,864.12
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,630,361.42	10,891,430.09
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	83,081.62	79,546.76
减：二、费用		826,991.30	664,895.57
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	486,225.67	354,549.87
2. 托管费	6.4.10.2.2	85,804.50	62,567.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	91,203.67	84,727.07
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.07	0.08
7. 其他费用	6.4.7.20	163,757.39	163,050.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,929,232.74	16,096,031.39
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,929,232.74	16,096,031.39

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	39,940,297.62	68,317,762.25	108,258,059.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,929,232.74	14,929,232.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	3,345,979.86	5,142,019.71	8,487,999.57
其中：1. 基金申购款	25,996,620.65	46,969,066.86	72,965,687.51
2. 基金赎回款	-22,650,640.79	-41,827,047.15	-64,477,687.94
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）	43,286,277.48	88,389,014.70	131,675,292.18
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	47,316,663.25	36,034,525.63	83,351,188.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,096,031.39	16,096,031.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-3,910,816.20	-3,297,029.94	-7,207,846.14

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	30,218,327.81	25,623,563.92	55,841,891.73
2. 基金赎回款	-34,129,144.01	-28,920,593.86	-63,049,737.87
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)	43,405,847.05	48,833,527.08	92,239,374.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安深证 300 指数增强型证券投资基金(原名为平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]1689 号《关于核准平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》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《平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 417,679,038.56 元,业经安永华明会计师事务所安永华明(2011)验字第 60937497_H02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 20 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 417,710,046.22 份基金份额,其中认购资金利息折合 31,007.66 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安深证 300 指数增强型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金合

同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 90%-95%，其中投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-10%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为深证 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号年度报告和中期报告》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	8,415,388.41
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	8,415,388.41

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	86,094,661.99	124,718,770.76	38,624,108.77
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	45,625.83	3,625.83
	银行间市场	-	-
	合计	45,625.83	3,625.83
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	86,136,661.99	124,764,396.59	38,627,734.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	644.26
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	16.47
应收债券利息	4.65
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	3.33
合计	668.71

6.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	39,339.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	39,339.06

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	6,191.08
应付证券出借违约金	-
预提费用	110,499.25
其他	7,677.69
合计	124,368.02

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,940,297.62	39,940,297.62
本期申购	25,996,620.65	25,996,620.65

本期赎回（以“-”号填列）	-22,650,640.79	-22,650,640.79
- 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	43,286,277.48	43,286,277.48

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	43,303,967.36	25,013,794.89	68,317,762.25
本期利润	9,298,871.32	5,630,361.42	14,929,232.74
本期基金份额交易产生的变动数	3,771,682.27	1,370,337.44	5,142,019.71
其中：基金申购款	30,393,277.05	16,575,789.81	46,969,066.86
基金赎回款	-26,621,594.78	-15,205,452.37	-41,827,047.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	56,374,520.95	32,014,493.75	88,389,014.70

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
活期存款利息收入	11,912.45
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	318.30
其他	57.15
合计	12,287.90

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	9,369,961.28
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	9,369,961.28

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	30,909,211.76
减：卖出股票成本总额	21,539,250.48
买卖股票差价收入	9,369,961.28

6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于股票投资产生的证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	67,632.13
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	67,632.13

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	494,476.62
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	426,798.94
减：应收利息总额	45.55
买卖债券差价收入	67,632.13

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	592,851.21
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	592,851.21
----	------------

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	5,630,361.42
股票投资	5,626,735.59
债券投资	3,625.83
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,630,361.42

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	82,900.97
基金转换费收入	180.65
合计	83,081.62

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	91,203.67
银行间市场交易费用	-
合计	91,203.67

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	20,827.67
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	3,258.14
指数使用费	100,000.00
合计	163,757.39

6.4.7.21 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	486,225.67	354,549.87
其中：支付销售机构的客户维护费	135,861.51	86,941.31

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 0.85% 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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.85\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,804.50	62,567.61

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
基金合同生效日（2011年12月20日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	5,499,000.00	9,999,000.00
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	5,499,000.00	9,999,000.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	12.7038%	23.0361%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投份额。

2、基金管理人平安基金投资本基金适用的认（申）购/赎回费按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行-活期	8,415,388.41	11,912.45	4,791,093.92	14,756.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
平安证券股份有限公司	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	303	2,784.57	12,235.14	-
300926	博俊科技	2020年12月	2021年07月	新股锁定	10.76	22.20	272	2,926.72	6,038.40	-

		月 29 日	月 12 日							
300931	通用 电梯	2021 年 1 月 13 日	2021 年 7 月 21 日	新股锁 定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300937	药易 购	2021 年 1 月 20 日	2021 年 7 月 27 日	新股锁 定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极 光	2021 年 1 月 27 日	2021 年 8 月 3 日	新股锁 定	12.76	43.38	255	3,253.80	11,061.90	-
300945	曼卡 龙	2021 年 2 月 3 日	2021 年 8 月 10 日	新股锁 定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中 生态	2021 年 2 月 18 日	2021 年 8 月 25 日	新股锁 定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固 特	2021 年 2 月 24 日	2021 年 9 月 3 日	新股锁 定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300955	嘉亨 家化	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 24 日	新股锁 定	16.53	46.07	180	2,975.40	8,292.60	-
300956	英力 股份	2021 年 3 月 16 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁 定	12.85	25.80	282	3,623.70	7,275.60	-
300957	贝泰 妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁 定	47.33	251.96	78	3,691.74	19,652.88	-
300960	通业 科技	2021 年 3 月 22 日	2021 年 9 月 29 日	新股锁 定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水 海纳	2021 年 3 月 23 日	2021 年 9 月 30 日	新股锁 定	8.48	22.07	305	2,586.40	6,731.35	-
300962	中金 辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同 药业	2021 年 3 月 31 日	2021 年 10 月 11 日	新股锁 定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣	2021	2021	新股锁	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

	股份	年 4 月 2 日	年 10 月 13 日	定						
300968	格林 精密	2021 年 4 月 6 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	6.87	12.07	478	3,283.86	5,769.46	-
300971	博亚 精工	2021 年 4 月 7 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	18.24	28.29	204	3,720.96	5,771.16	-
300973	立高 食品	2021 年 4 月 8 日	2021 年 10 月 15 日	新股锁 定	28.28	115.71	102	2,884.56	11,802.42	-
300975	商络 电子	2021 年 4 月 14 日	2021 年 10 月 21 日	新股锁 定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭 科技	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定	8.42	13.60	445	3,746.90	6,052.00	-
300979	华利 集团	2021 年 4 月 15 日	2021 年 10 月 26 日	新股锁 定	33.22	87.50	139	4,617.58	12,162.50	-
300981	中红 医疗	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	48.59	90.39	91	4,421.69	8,225.49	-
300982	苏文 电能	2021 年 4 月 19 日	2021 年 10 月 27 日	新股锁 定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300986	志特 新材	2021 年 4 月 21 日	2021 年 11 月 1 日	新股锁 定	14.79	30.57	179	2,647.41	5,472.03	-
300987	川网 传媒	2021 年 4 月 28 日	2021 年 11 月 11 日	新股锁 定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益 通	2021 年 5 月	2021 年 11	新股锁 定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-

		12 日	月 22 日							
300993	玉马遮阳	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 24 日	新股锁定	12.10	19.29	339	4,101.90	6,539.31	-
300995	奇德新材	2021 年 5 月 17 日	2021 年 11 月 26 日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021 年 5 月 26 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	4.94	13.05	594	2,934.36	7,751.70	-
300998	宁波方正	2021 年 5 月 25 日	2021 年 12 月 2 日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021 年 5 月 27 日	2021 年 12 月 7 日	新股锁定	18.71	57.62	155	2,900.05	8,931.10	-
301007	德迈仕	2021 年 6 月 4 日	2021 年 12 月 16 日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021 年 6 月 8 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定	12.54	27.89	381	4,777.74	10,626.09	-
301010	晶雪节能	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 20 日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021 年 6 月 9 日	2021 年 12 月 17 日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021 年 6 月 15 日	2021 年 12 月 22 日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021 年 6 月 21 日	2021 年 12 月 29 日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋	2021	2021	新股锁	7.64	38.83	411	3,140.04	15,959.13	-

	医药	年 6 月 22 日	年 12 月 30 日	定						
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	239	3,286.25	7,882.22	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	8.29	8.29	6,574	54,498.46	54,498.46	-
301018	申菱环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	8.29	8.29	731	6,059.99	6,059.99	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	10.64	10.64	3,613	38,442.32	38,442.32	-
301020	密封科技	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	10.64	10.64	402	4,277.28	4,277.28	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
600905	三峡能源	2021 年 6 月 2 日	2021 年 12 月 10 日	新股锁定	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605287	德才股份	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300919	中伟股份	2020 年 12 月 15 日	2021 年 7 月 2 日	新股锁定	24.60	163.00	119	2,927.40	19,397.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
123117	健帆转债	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 12 日	新债未上市	100.00	100.00	90	9,000.00	9,000.00	-
127037	银轮	2021	2021	新债未	100.00	100.00	104	10,400.00	10,400.00	-

	转债	年 6 月 7 日	年 07 月 09 日	上市						
127038	国微 转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 7 月 14 日	新债未 上市	100.00	100.00	109	10,900.00	10,900.00	-

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. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.03%（上年末：无）。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,415,388.41	-	-	-	8,415,388.41
结算备付金	40,829.69	-	-	-	40,829.69
存出保证金	8,189.03	-	-	-	8,189.03
交易性金融资产	45,625.83	-	-	-124,718,770.76	124,764,396.59
应收利息	-	-	-	668.71	668.71
应收申购款	-	-	-	370,922.63	370,922.63
应收证券清算款	-	-	-	72,011.01	72,011.01
资产总计	8,510,032.96	-	-	-125,162,373.11	133,672,406.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,724,658.47	1,724,658.47
应付管理人报酬	-	-	-	92,436.09	92,436.09
应付托管费	-	-	-	16,312.25	16,312.25
应付交易费用	-	-	-	39,339.06	39,339.06
其他负债	-	-	-	124,368.02	124,368.02
负债总计	-	-	-	1,997,113.89	1,997,113.89
利率敏感度缺口	8,510,032.96	-	-	-123,165,259.22	131,675,292.18
上年度末 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	5,830,121.83	-	-	-	5,830,121.83
结算备付金	37,574.46	-	-	-	37,574.46
存出保证金	6,069.70	-	-	-	6,069.70
交易性金融资产	-	-	-	-102,645,358.08	102,645,358.08
应收利息	-	-	-	596.35	596.35
应收申购款	-	-	-	388,276.68	388,276.68
应收证券清算款	-	-	-	99,117.46	99,117.46
资产总计	5,873,765.99	-	-	-103,133,348.57	109,007,114.56

负债					
应付赎回款	-	-	-	415,171.12	415,171.12
应付管理人报酬	-	-	-	74,086.98	74,086.98
应付托管费	-	-	-	13,074.17	13,074.17
应付交易费用	-	-	-	16,024.03	16,024.03
其他负债	-	-	-	230,698.39	230,698.39
负债总计	-	-	-	749,054.69	749,054.69
利率敏感度缺口	5,873,765.99	-	-	-102,384,293.88	108,258,059.87

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净值的比例为 0.03% (上年末：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (上年末：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	124,718,770.76	94.72	102,645,358.08	94.82
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	124,718,770.76	94.72	102,645,358.08	94.82

6.4.13.4.3.2 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（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	7,452,009.93	5,790,978.03
	沪深 300 指数下降 5%	-7,452,009.93	-5,790,978.03

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	124,718,770.76	93.30
	其中：股票	124,718,770.76	93.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	45,625.83	0.03
	其中：债券	45,625.83	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	8,456,218.10	6.33
8	其他各项资产	451,791.38	0.34
9	合计	133,672,406.07	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	2,276,981.84	1.73
B	采矿业	644,979.60	0.49
C	制造业	80,034,467.16	60.78
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,252,450.00	0.95
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,135,664.40	3.90
J	金融业	7,415,622.08	5.63
K	房地产业	2,671,609.00	2.03
L	租赁和商务服务业	952,514.00	0.72
M	科学研究和技术服务业	1,122,177.00	0.85
N	水利、环境和公共设施管理业	166,941.00	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	277,837.00	0.21
Q	卫生和社会工作	3,709,399.62	2.82
R	文化、体育和娱乐业	696,318.00	0.53
S	综合	-	-
	合计	106,356,960.70	80.77

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	5,850.78	0.00
B	采矿业	292,731.00	0.22
C	制造业	7,854,541.63	5.97
D	电力、热力、燃气	5,151,678.21	3.91

	及水生产和供应业		
E	建筑业	25,371.37	0.02
F	批发和零售业	350,693.05	0.27
G	交通运输、仓储和邮政业	64,788.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	166,798.99	0.13
J	金融业	2,216,805.10	1.68
K	房地产业	342,816.00	0.26
L	租赁和商务服务业	330,110.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	551,552.36	0.42
N	水利、环境和公共设施管理业	169,485.57	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	838,588.00	0.64
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,361,810.06	13.94

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	11,300	6,043,240.00	4.59
2	000858	五粮液	20,200	6,017,378.00	4.57
3	000333	美的集团	53,800	3,839,706.00	2.92
4	000568	泸州老窖	12,300	2,902,062.00	2.20
5	002415	海康威视	43,300	2,792,850.00	2.12
6	300059	东方财富	83,752	2,746,228.08	2.09
7	300015	爱尔眼科	34,819	2,471,452.62	1.88
8	002475	立讯精密	53,712	2,470,752.00	1.88
9	002142	宁波银行	62,200	2,423,934.00	1.84
10	300760	迈瑞医疗	5,000	2,400,250.00	1.82

11	000651	格力电器	45,800	2,386,180.00	1.81
12	300124	汇川技术	24,450	1,815,657.00	1.38
13	000002	万科A	75,900	1,807,179.00	1.37
14	002594	比亚迪	7,000	1,757,000.00	1.33
15	002714	牧原股份	28,772	1,749,913.04	1.33
16	300274	阳光电源	14,600	1,679,876.00	1.28
17	000725	京东方A	259,600	1,619,904.00	1.23
18	300014	亿纬锂能	15,306	1,590,752.58	1.21
19	000661	长春高新	3,700	1,431,900.00	1.09
20	002352	顺丰控股	18,500	1,252,450.00	0.95
21	300782	卓胜微	2,260	1,214,750.00	0.92
22	300347	泰格医药	5,900	1,140,470.00	0.87
23	002812	恩捷股份	4,600	1,076,860.00	0.82
24	002460	赣锋锂业	8,700	1,053,483.00	0.80
25	002821	凯莱英	2,800	1,043,280.00	0.79
26	300122	智飞生物	5,500	1,027,015.00	0.78
27	002241	歌尔股份	23,500	1,004,390.00	0.76
28	300496	中科创达	6,000	942,360.00	0.72
29	002271	东方雨虹	16,700	923,844.00	0.70
30	000063	中兴通讯	27,300	907,179.00	0.69
31	300433	蓝思科技	29,300	861,713.00	0.65
32	000625	长安汽车	31,300	822,564.00	0.62
33	000776	广发证券	53,900	816,046.00	0.62
34	002027	分众传媒	84,300	793,263.00	0.60
35	002311	海大集团	9,700	791,520.00	0.60
36	000338	潍柴动力	43,700	780,919.00	0.59
37	002709	天赐材料	7,010	747,125.80	0.57
38	300316	晶盛机电	14,700	742,350.00	0.56
39	000932	华菱钢铁	107,600	710,160.00	0.54
40	000157	中联重科	76,400	705,936.00	0.54
41	002601	龙佰集团	20,100	695,058.00	0.53
42	002049	紫光国微	4,500	693,855.00	0.53
43	300759	康龙化成	3,100	672,669.00	0.51
44	002129	中环股份	17,100	660,060.00	0.50
45	300454	深信服	2,500	648,700.00	0.49
46	002371	北方华创	2,300	637,974.00	0.48
47	300529	健帆生物	7,230	624,382.80	0.47
48	002410	广联达	9,000	613,800.00	0.47
49	300595	欧普康视	5,920	613,016.00	0.47
50	002007	华兰生物	16,500	605,220.00	0.46
51	300408	三环集团	14,100	598,122.00	0.45
52	300558	贝达药业	5,500	595,320.00	0.45

53	000786	北新建材	14,100	553,425.00	0.42
54	002459	晶澳科技	10,900	534,100.00	0.41
55	300142	沃森生物	8,600	530,620.00	0.40
56	000100	TCL 科技	67,900	519,435.00	0.39
57	000596	古井贡酒	2,100	502,950.00	0.38
58	002304	洋河股份	2,400	497,280.00	0.38
59	002179	中航光电	6,200	489,924.00	0.37
60	300253	卫宁健康	29,190	474,921.30	0.36
61	300699	光威复材	6,100	463,295.00	0.35
62	000783	长江证券	62,000	453,840.00	0.34
63	300450	先导智能	7,540	453,455.60	0.34
64	300012	华测检测	14,100	449,508.00	0.34
65	300413	芒果超媒	6,400	439,040.00	0.33
66	002001	新 和 成	15,240	437,083.20	0.33
67	002690	美亚光电	7,300	407,048.00	0.31
68	002230	科大讯飞	6,000	405,480.00	0.31
69	002185	华天科技	25,600	393,984.00	0.30
70	300136	信维通信	12,700	392,176.00	0.30
71	300498	温氏股份	27,040	388,564.80	0.30
72	002916	深南电路	3,460	384,509.80	0.29
73	300207	欣旺达	11,700	380,952.00	0.29
74	002555	三七互娱	15,600	374,712.00	0.28
75	002624	完美世界	15,450	369,409.50	0.28
76	000876	新 希 望	24,200	355,014.00	0.27
77	000166	申万宏源	75,800	354,744.00	0.27
78	300661	圣邦股份	1,400	353,822.00	0.27
79	002236	大华股份	16,700	352,370.00	0.27
80	000768	中航西飞	13,200	346,896.00	0.26
81	000547	航天发展	17,900	337,773.00	0.26
82	002568	百润股份	3,560	337,452.40	0.26
83	002841	视源股份	2,700	335,583.00	0.25
84	002493	荣盛石化	19,300	333,311.00	0.25
85	300037	新宙邦	3,300	330,330.00	0.25
86	002050	三花智控	13,200	316,536.00	0.24
87	000961	中南建设	52,100	308,432.00	0.23
88	002602	世纪华通	47,680	306,105.60	0.23
89	000895	双汇发展	9,400	298,920.00	0.23
90	000708	中信特钢	13,600	283,424.00	0.22
91	300601	康泰生物	1,900	283,100.00	0.21
92	002439	启明星辰	9,700	281,397.00	0.21
93	000938	紫光股份	12,840	280,939.20	0.21
94	000807	云铝股份	23,500	279,650.00	0.21

95	300285	国瓷材料	5,700	277,875.00	0.21
96	002607	中公教育	13,300	277,837.00	0.21
97	002414	高德红外	9,900	273,042.00	0.21
98	002353	杰瑞股份	6,100	272,670.00	0.21
99	000656	金科股份	47,000	272,130.00	0.21
100	000977	浪潮信息	9,584	269,597.92	0.20
101	300628	亿联网络	3,200	268,160.00	0.20
102	000538	云南白药	2,300	266,156.00	0.20
103	002508	老板电器	5,700	265,050.00	0.20
104	000983	山西焦煤	31,800	264,258.00	0.20
105	002080	中材科技	10,000	261,700.00	0.20
106	300251	光线传媒	23,800	257,278.00	0.20
107	002064	华峰化学	17,700	251,340.00	0.19
108	002223	鱼跃医疗	6,500	247,845.00	0.19
109	300003	乐普医疗	7,600	244,112.00	0.19
110	002078	太阳纸业	17,900	238,965.00	0.18
111	002444	巨星科技	7,000	238,560.00	0.18
112	000066	中国长城	16,300	237,980.00	0.18
113	002156	通富微电	9,800	235,592.00	0.18
114	002384	东山精密	11,300	235,492.00	0.18
115	002572	索菲亚	9,400	227,480.00	0.17
116	002242	九阳股份	6,800	220,932.00	0.17
117	002736	国信证券	19,800	212,850.00	0.16
118	002385	大北农	31,200	212,160.00	0.16
119	002013	中航机电	21,000	211,470.00	0.16
120	300888	稳健医疗	1,700	210,154.00	0.16
121	002511	中顺洁柔	7,600	209,380.00	0.16
122	002373	千方科技	12,500	208,750.00	0.16
123	002128	露天煤业	19,800	206,118.00	0.16
124	002110	三钢闽光	30,000	202,200.00	0.15
125	002600	领益智造	20,700	190,233.00	0.14
126	000425	徐工机械	29,500	187,915.00	0.14
127	002925	盈趣科技	4,560	177,429.60	0.13
128	002901	大博医疗	2,400	174,936.00	0.13
129	300841	康华生物	650	174,720.00	0.13
130	000975	银泰黄金	18,360	174,603.60	0.13
131	000967	盈峰环境	24,300	166,941.00	0.13
132	300271	华宇软件	8,600	165,550.00	0.13
133	002157	正邦科技	13,600	162,520.00	0.12
134	300724	捷佳伟创	1,400	162,414.00	0.12
135	002127	南极电商	16,300	159,251.00	0.12
136	002938	鹏鼎控股	4,400	157,872.00	0.12

137	001979	招商蛇口	14,000	153,300.00	0.12
138	300463	迈克生物	3,600	151,524.00	0.12
139	300033	同花顺	1,300	146,614.00	0.11
140	002926	华西证券	14,700	141,561.00	0.11
141	002138	顺络电子	3,600	139,572.00	0.11
142	002299	圣农发展	5,800	138,504.00	0.11
143	002791	坚朗五金	700	135,835.00	0.10
144	001914	招商积余	7,600	130,568.00	0.10
145	000878	云南铜业	10,100	129,583.00	0.10
146	002032	苏泊尔	1,900	121,201.00	0.09
147	002430	杭氧股份	3,500	121,065.00	0.09
148	002019	亿帆医药	7,000	120,750.00	0.09
149	002966	苏州银行	16,300	119,805.00	0.09
150	300618	寒锐钴业	1,500	118,260.00	0.09
151	000860	顺鑫农业	2,800	118,104.00	0.09
152	000738	航发控制	5,600	116,648.00	0.09
153	002340	格林美	12,000	112,200.00	0.09
154	002372	伟星新材	5,400	111,618.00	0.08
155	002463	沪电股份	6,900	106,743.00	0.08
156	300418	昆仑万维	6,500	106,470.00	0.08
157	002065	东华软件	13,300	105,469.00	0.08
158	000799	酒鬼酒	400	102,240.00	0.08
159	002382	蓝帆医疗	4,900	102,165.00	0.08
160	002044	美年健康	10,700	97,477.00	0.07
161	002532	天山铝业	11,500	96,485.00	0.07
162	000951	中国重汽	2,800	75,768.00	0.06
163	300188	美亚柏科	3,900	67,860.00	0.05
164	002920	德赛西威	600	66,048.00	0.05
165	002405	四维图新	4,400	64,680.00	0.05
166	300088	长信科技	7,300	60,298.00	0.05
167	002705	新宝股份	2,000	52,500.00	0.04
168	300832	新产业	700	43,120.00	0.03
169	000581	威孚高科	2,000	41,660.00	0.03
170	300896	爱美客	52	41,021.76	0.03
171	300999	金龙鱼	400	33,984.00	0.03
172	002216	三全食品	1,850	30,469.50	0.02
173	002056	横店东磁	2,000	26,000.00	0.02
174	002557	洽洽食品	600	25,860.00	0.02
175	002507	涪陵榨菜	500	18,830.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	3.91
2	600926	杭州银行	66,000	973,500.00	0.74
3	601012	隆基股份	8,080	717,827.20	0.55
4	600763	通策医疗	1,100	452,100.00	0.34
5	600809	山西汾酒	1,000	448,000.00	0.34
6	600276	恒瑞医药	6,480	440,445.60	0.33
7	603259	药明康德	2,604	407,760.36	0.31
8	600346	恒力石化	14,500	380,480.00	0.29
9	603456	九洲药业	7,107	345,258.06	0.26
10	601888	中国中免	1,100	330,110.00	0.25
11	603501	韦尔股份	1,000	322,000.00	0.24
12	000516	国际医学	16,300	306,603.00	0.23
13	603986	兆易创新	1,552	291,620.80	0.22
14	600563	法拉电子	1,800	285,048.00	0.22
15	600048	保利地产	23,200	279,328.00	0.21
16	600030	中信证券	11,000	274,340.00	0.21
17	601688	华泰证券	17,000	268,600.00	0.20
18	688002	睿创微纳	2,500	249,575.00	0.19
19	600862	中航高科	8,000	246,240.00	0.19
20	601799	星宇股份	1,000	225,720.00	0.17
21	301015	百洋医药	4,101	223,189.53	0.17
22	601211	国泰君安	12,700	217,678.00	0.17
23	603659	璞泰来	1,480	202,168.00	0.15
24	603129	春风动力	1,600	198,528.00	0.15
25	601808	中海油服	13,600	195,296.00	0.15
26	688200	华峰测控	400	189,332.00	0.14
27	600745	闻泰科技	1,800	174,420.00	0.13
28	300502	新易盛	5,441	170,031.25	0.13
29	600183	生益科技	7,100	166,211.00	0.13
30	600765	中航重机	7,000	158,550.00	0.12
31	300685	艾德生物	1,500	156,120.00	0.12
32	002876	三利谱	2,200	142,340.00	0.11
33	600323	瀚蓝环境	6,500	141,635.00	0.11
34	600919	江苏银行	18,400	130,640.00	0.10
35	601336	新华保险	2,700	123,957.00	0.09
36	300115	长盈精密	6,000	123,600.00	0.09
37	600060	海信视像	7,100	119,990.00	0.09
38	688093	世华科技	3,000	119,280.00	0.09
39	688396	华润微	1,300	118,326.00	0.09
40	603416	信捷电气	1,800	114,246.00	0.09
41	603005	晶方科技	1,880	111,352.40	0.08
42	603444	吉比特	200	106,000.00	0.08

43	688007	光峰科技	2,500	104,700.00	0.08
44	603018	华设集团	12,560	99,852.00	0.08
45	603883	老百姓	1,880	99,038.40	0.08
46	600988	赤峰黄金	6,500	97,435.00	0.07
47	600999	招商证券	5,100	97,002.00	0.07
48	603218	日月股份	3,500	94,780.00	0.07
49	605288	凯迪股份	900	94,032.00	0.07
50	603027	千禾味业	3,520	92,540.80	0.07
51	603686	龙马环卫	6,000	91,260.00	0.07
52	603882	金域医学	500	79,885.00	0.06
53	603737	三棵树	420	73,920.00	0.06
54	601100	恒立液压	796	68,392.32	0.05
55	603713	密尔克卫	600	64,788.00	0.05
56	600383	金地集团	6,200	63,488.00	0.05
57	000636	风华高科	2,100	63,462.00	0.05
58	301018	申菱环境	7,305	60,558.45	0.05
59	603899	晨光文具	700	59,192.00	0.04
60	002100	天康生物	6,600	58,806.00	0.04
61	600031	三一重工	2,000	58,140.00	0.04
62	600742	一汽富维	5,300	54,007.00	0.04
63	601658	邮储银行	10,600	53,212.00	0.04
64	002949	华阳国际	2,600	43,940.00	0.03
65	600380	健康元	3,200	43,936.00	0.03
66	601615	明阳智能	2,700	43,713.00	0.03
67	601166	兴业银行	2,100	43,155.00	0.03
68	301020	密封科技	4,015	42,719.60	0.03
69	688599	天合光能	1,500	42,525.00	0.03
70	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.03
71	600845	宝信软件	650	33,085.00	0.03
72	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.02
73	002318	久立特材	2,200	26,444.00	0.02
74	600741	华域汽车	1,000	26,270.00	0.02
75	603317	天味食品	840	24,721.20	0.02
76	603338	浙江鼎力	400	23,476.00	0.02
77	001207	联科科技	682	22,581.02	0.02
78	600761	安徽合力	2,000	22,120.00	0.02
79	603866	桃李面包	700	21,840.00	0.02
80	300957	贝泰妮	78	19,652.88	0.01
81	300919	中伟股份	119	19,397.00	0.01
82	300894	火星人	285	19,380.00	0.01
83	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
84	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
85	300937	药易购	244	13,105.24	0.01

86	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
87	300614	百川畅银	303	12,235.14	0.01
88	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
89	300979	华利集团	139	12,162.50	0.01
90	300973	立高食品	102	11,802.42	0.01
91	300940	南极光	255	11,061.90	0.01
92	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
93	301009	可靠股份	381	10,626.09	0.01
94	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.01
95	300966	共同药业	286	9,020.44	0.01
96	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.01
97	301002	崧盛股份	155	8,931.10	0.01
98	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.01
99	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.01
100	300950	德固特	219	8,569.47	0.01
101	300955	嘉亨家化	180	8,292.60	0.01
102	300981	中红医疗	91	8,225.49	0.01
103	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.01
104	301016	雷尔伟	239	7,882.22	0.01
105	300997	欢乐家	594	7,751.70	0.01
106	300925	法本信息	282	7,413.78	0.01
107	300956	英力股份	282	7,275.60	0.01
108	300918	南山智尚	663	6,901.83	0.01
109	300991	创益通	254	6,733.54	0.01
110	300961	深水海纳	305	6,731.35	0.01
111	300993	玉马遮阳	339	6,539.31	0.00
112	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
113	300978	东箭科技	445	6,052.00	0.00
114	300926	博俊科技	272	6,038.40	0.00
115	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
116	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
117	300971	博亚精工	204	5,771.16	0.00
118	300968	格林精密	478	5,769.46	0.00
119	300986	志特新材	179	5,472.03	0.00
120	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
121	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
122	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
123	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
124	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
125	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
126	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600905	三峡能源	3,436,527.95	3.17
2	000858	五粮液	1,285,946.58	1.19
3	000333	美的集团	1,145,717.00	1.06
4	300750	宁德时代	816,441.00	0.75
5	002415	海康威视	806,678.00	0.75
6	002475	立讯精密	634,730.00	0.59
7	600276	恒瑞医药	627,822.00	0.58
8	300059	东方财富	619,750.00	0.57
9	000002	万科A	602,395.00	0.56
10	002142	宁波银行	580,710.00	0.54
11	000568	泸州老窖	571,567.00	0.53
12	300760	迈瑞医疗	490,131.00	0.45
13	300782	卓胜微	473,989.00	0.44
14	000725	京东方A	450,473.00	0.42
15	300014	亿纬锂能	438,754.00	0.41
16	000651	格力电器	429,811.00	0.40
17	000776	广发证券	394,164.00	0.36
18	300122	智飞生物	393,578.00	0.36
19	600048	保利地产	369,559.00	0.34
20	002230	科大讯飞	354,716.00	0.33

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600905	三峡能源	1,784,978.00	1.65
2	000858	五粮液	762,607.00	0.70
3	000333	美的集团	724,640.00	0.67
4	000568	泸州老窖	494,966.58	0.46
5	002475	立讯精密	482,623.00	0.45
6	000651	格力电器	453,072.00	0.42
7	300274	阳光电源	421,311.00	0.39
8	300015	爱尔眼科	393,971.00	0.36
9	000002	万科A	320,002.00	0.30
10	300124	汇川技术	319,254.00	0.29
11	601818	光大银行	315,194.00	0.29
12	002594	比亚迪	280,349.00	0.26
13	002415	海康威视	277,389.00	0.26

14	000069	华侨城 A	273,385.00	0.25
15	300059	东方财富	270,467.00	0.25
16	600926	杭州银行	228,763.00	0.21
17	002714	牧原股份	221,393.00	0.20
18	600519	贵州茅台	219,595.00	0.20
19	300496	中科创达	213,837.00	0.20
20	002142	宁波银行	213,066.00	0.20

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	37,985,927.57
卖出股票收入（成交）总额	30,909,211.76

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	45,625.83	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	45,625.83	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	127036	三花转债	117	15,325.83	0.01
2	127038	国微转债	109	10,900.00	0.01
3	127037	银轮转债	104	10,400.00	0.01
4	123117	健帆转债	90	9,000.00	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细**

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	8,189.03
2	应收证券清算款	72,011.01
3	应收股利	-
4	应收利息	668.71
5	应收申购款	370,922.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	451,791.38

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	3.91	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
6,410	6,752.93	5,503,112.96	12.71	37,783,164.52	87.29

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	34,109.64	0.0788

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2011 年 12 月 20 日)	417,710,046.22
----------------------------	----------------

基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	39,940,297.62
本报告期基金总申购份额	25,996,620.65
减：本报告期基金总赎回份额	22,650,640.79
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	43,286,277.48

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2021 年 3 月 2 日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中国国际金	2	30,201,507.30	47.60%	28,127.31	51.46%	-

融股份有限 公司						
华泰证券	3	7,104,793.15	11.20%	5,053.79	9.25%	-
中信建投证 券	1	6,349,416.21	10.01%	4,643.27	8.50%	-
方正证券	1	5,135,809.94	8.09%	4,782.95	8.75%	-
招商证券	2	3,584,288.78	5.65%	3,337.97	6.11%	-
长江证券	1	2,957,601.33	4.66%	2,754.44	5.04%	-
兴业证券	2	2,160,640.22	3.41%	1,539.75	2.82%	-
安信证券	4	1,969,461.21	3.10%	1,440.23	2.64%	-
东方证券	3	1,940,127.00	3.06%	1,418.91	2.60%	-
中泰证券	1	896,856.00	1.41%	637.89	1.17%	-
国泰君安证 券	2	686,855.00	1.08%	488.56	0.89%	-
广发证券	3	389,949.45	0.61%	363.17	0.66%	-
申万宏源证 券	1	72,089.50	0.11%	67.13	0.12%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
上海华信证 券	2	-	-	-	-	-
申银万国证 券	1	-	-	-	-	-
西藏东财证 券	2	-	-	-	-	-

西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财 富证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、本报告期内停止租用交易单元：方正证券 1 个，湘财证券 1 个。

2、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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国国际金融股份有限公司	150,679.76	30.47%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	269,831.00	54.57%	-	-	-	-
方正证券	15,114.00	3.06%	-	-	-	-
招商证券	58,851.86	11.90%	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
上海华信 证券	-	-	-	-	-	-
申银万国 证券	-	-	-	-	-	-
西藏东财 证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中国中金 财富证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 01 日
2	平安深证 300 指数增强型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 20 日
3	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
4	平安基金管理有限公司关于暂停部分销售机构办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 05 日
5	平安深证 300 指数增强型证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 29 日
6	平安深证 300 指数增强型证券投资基	中国证监会规定报刊及	2021 年 03 月 31 日

	金基金产品资料概要（更新）	网站	
7	平安深证 300 指数增强型证券投资基金招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
8	平安基金管理有限公司关于公司旗下部分指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
9	平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
10	平安深证 300 指数增强型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 20 日
11	平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
12	平安深证 300 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整风险等级的通知	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 01 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增嘉实财富管理有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 02 日
15	平安基金管理有限公司关于暂停北京加和基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 21 日
16	平安基金管理有限公司关于旗下基金所持恩捷股份（股票代码：002812）估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 23 日
17	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 24 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海爱建基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日
19	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 25 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》和相关基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，平安基金管理有限公司

（以下简称“本公司”）对本基金基金合同有关条款进行修订。修订自 2021 年 3 月 31 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 3 月 31 日发布的《平安基金管理有限公司关于公司旗下部分指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- （1）中国证监会核准平安深证 300 指数增强型证券投资基金募集的文件
- （2）平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- （3）平安深证 300 指数增强型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

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

- （1）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，客户服务热线：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日