

# 平安中证 500 指数增强型发起式证券投资 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

<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 主要财务指标和基金净值表现</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
<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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>38</b>
7.1 期末基金资产组合情况	38
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	40
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 .....	49
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>58</b>
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 .....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	58
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	平安中证 500 指数增强	
基金主代码	009336	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 27 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	29,014,631.25 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	009336	009337
报告期末下属分级基金的份额总额	12,634,352.04 份	16,380,279.21 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的组合管理与严格的风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。力争控制本基金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%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金为增强型指数产品，在参考标的指数成份股权重的基础上根据量化模型对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票指数增强型基金，其预期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，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，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
	联系电话	0755-22626828
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
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	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	5033 号平安金融中心 34 层	
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 1 号
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	证券日报
登载基金中期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)		
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C	
本期已实现收益	1,275,992.97	2,079,996.78	
本期利润	1,135,878.78	1,692,045.64	
加权平均基金份 额本期利润	0.0896	0.1150	
本期加权平均净 值利润率	7.24%	9.29%	
本期基金份额净 值增长率	7.07%	6.80%	
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	2,815,031.90	3,533,426.54
	期末可供分配基 金份额利润	0.2228	0.2157

期末基金资产净值	16,561,604.17	21,355,132.89
期末基金份额净值	1.3108	1.3037
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	31.08%	30.37%

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

平安中证 500 指数增强 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	3.19%	0.88%	1.12%	0.69%	2.07%	0.19%
过去三个月	11.15%	0.86%	8.41%	0.65%	2.74%	0.21%
过去六个月	7.07%	1.20%	6.61%	0.94%	0.46%	0.26%
过去一年	22.07%	1.36%	15.35%	1.19%	6.72%	0.17%
自基金合同生效起至今	31.08%	1.32%	24.33%	1.16%	6.75%	0.16%

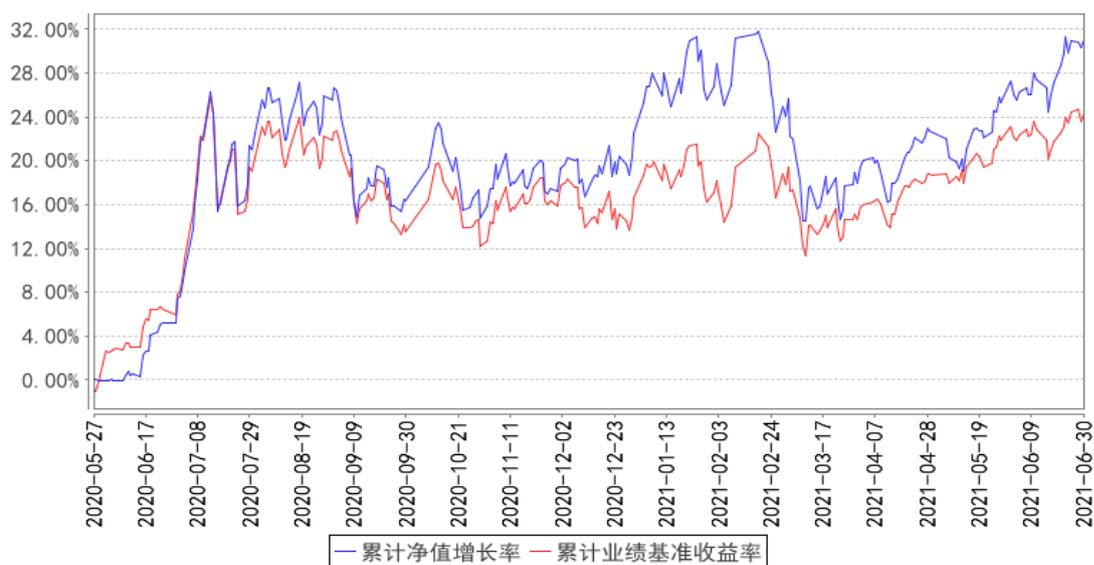
平安中证 500 指数增强 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

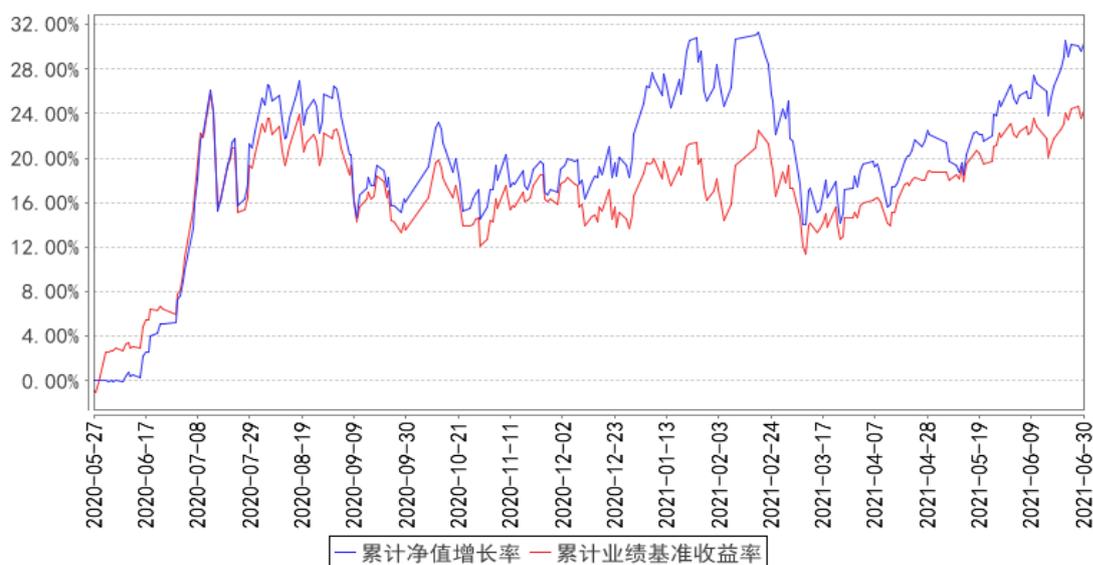
过去一个月	3.16%	0.88%	1.12%	0.69%	2.04%	0.19%
过去三个月	11.02%	0.86%	8.41%	0.65%	2.61%	0.21%
过去六个月	6.80%	1.20%	6.61%	0.94%	0.19%	0.26%
过去一年	21.47%	1.36%	15.35%	1.19%	6.12%	0.17%
自基金合同生效起 至今	30.37%	1.32%	24.33%	1.16%	6.04%	0.16%

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

平安中证500指数增强A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



平安中证500指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金合同于 2020 年 05 月 27 日生效；

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

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
毛时超	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金经理	2020 年 6 月 1 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

注：无。

#### 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，最大化预期收益求得目标组合，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。

本基金跟踪的中证 500 指数，整体偏向医药、电子、电力新能源、基础化工等行业，以沪深两市盘中市值股票为主。报告期内，基准指数的估值处于历史低位，加上公司业绩出现一定的改善，得到市场资金的认可，相比过去两年和大盘指数表现较好，所以本基金整体业绩表现不错。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安中证 500 指数增强 A 的基金份额净值 1.3108 元，本报告期基金份额净值增长率为 7.07%，同期业绩比较基准收益率为 6.61%；截至本报告期末平安中证 500 指数增强 C 的基金份额净值 1.3037 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.80%，同期业绩比较基准收益率为 6.61%。

## 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，以锂电池、新能源汽车、光伏、半导体等成长型产业，得到政策的支持，景气度持续提升，符合的长期发展方向，未来依然具有较好的收益预期。本基金跟踪的中证 500 指数，由于行业权重分布均衡，在上述产业中均有一定比例的公司，导致整体营收利润增速较高，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

不适用。

### § 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”）在平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金（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：平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	489,703.04	1,977,966.29
结算备付金		2,868.62	4,576.89
存出保证金		3,167.86	10,364.22
交易性金融资产	6.4.7.2	35,689,317.86	33,728,996.58
其中：股票投资		35,684,717.86	33,726,996.58
基金投资		-	-
债券投资		4,600.00	2,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		5,357,894.28	32,461.30
应收利息	6.4.7.5	385.58	190.31
应收股利		-	-
应收申购款		79,164.82	54,242.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		41,622,502.06	35,808,798.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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	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		3,374,652.79	399,732.83
应付管理人报酬		42,357.65	29,737.74
应付托管费		6,353.66	4,460.69
应付销售服务费		14,526.87	8,259.86

应付交易费用	6.4.7.7	75,722.75	17,147.77
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	192,151.28	135,000.00
负债合计		3,705,765.00	594,338.89
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	29,014,631.25	28,808,591.79
未分配利润	6.4.7.10	8,902,105.81	6,405,867.60
所有者权益合计		37,916,737.06	35,214,459.39
负债和所有者权益总计		41,622,502.06	35,808,798.28

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 29,014,631.25 份，其中平安中证 500 指数增强 A 基金份额总额 12,634,352.04 份，基金份额净值 1.3108 元。平安中证 500 指数增强 C 基金份额总额 16,380,279.21 份，基金份额净值 1.3037 元。

## 6.2 利润表

会计主体：平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 5 月 27 日（基金合 同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		3,358,591.58	2,757,229.47
1. 利息收入		5,028.41	11,517.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	5,017.07	4,199.47
债券利息收入		11.34	0.86
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	7,316.98
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,879,796.35	163,185.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,532,807.06	6,237.97
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	6,442.38	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-

衍生工具收益	6.4.7.15	-	51,533.98
股利收益	6.4.7.16	340,546.91	105,413.13
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-528,065.33	2,582,527.08
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	1,832.15	-
减：二、费用		530,667.16	111,139.47
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	168,727.56	34,058.28
2. 托管费	6.4.10.2.2	25,309.10	5,108.74
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	45,385.34	11,344.72
4. 交易费用	6.4.7.19	146,277.95	35,122.52
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	185.52
7. 其他费用	6.4.7.20	144,967.21	25,319.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,827,924.42	2,646,090.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,827,924.42	2,646,090.00

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金

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）	28,808,591.79	6,405,867.60	35,214,459.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,827,924.42	2,827,924.42
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）	206,039.46	-331,686.21	-125,646.75
其中：1. 基金申	48,063,522.37	12,164,794.58	60,228,316.95

购款			
2. 基金赎回款	-47,857,482.91	-12,496,480.79	-60,353,963.70
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）	29,014,631.25	8,902,105.81	37,916,737.06
项目	上年度可比期间 2020 年 5 月 27 日（基金合同生效日）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）	35,994,872.07	-	35,994,872.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,646,090.00	2,646,090.00
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	35,994,872.07	2,646,090.00	38,640,962.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2064 号《关于准予平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 指数增强型发起式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 35,985,005.35 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0333 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2020 年 5 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 35,994,872.07 份基金份额,其中认购资金利息折合 9,866.72 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”)。

本基金为发起式基金,发起资金认购部分为 10,002,250.23 份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于 3 年。

根据《平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额类别,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 指数增强型发起式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,包括标的指数成分股、备选成分股、其他国内依法发行上市的股票(包括主板、中小板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、衍生工具(股指期货、国债期货、股票期权等)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券、分离交易可转换债券、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、地方政府债券、政府支持机构债券、政府支持债券等中国证监会允许投资的债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、现金等,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。基金的投资组合比例为:本基金的股票资产占基

金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券。现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为中证 500 指数收益率 $\times$ 95%+同期银行活期存款利率(税后) $\times$ 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》、《平安中证 500 指数增强型发起式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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	489,703.04

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	489,703.04

#### 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	32,260,697.02	35,684,717.86	3,424,020.84
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	4,600.00	4,600.00
	银行间市场	-	-
	合计	4,600.00	4,600.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	32,265,297.02	35,689,317.86	3,424,020.84

#### 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	382.99
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	0.99
应收债券利息	0.34

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	1.26
合计	385.58

#### 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	75,722.75
银行间市场应付交易费用	-
合计	75,722.75

#### 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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	192,151.28
合计	192,151.28

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

##### 平安中证 500 指数增强 A

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	13,185,767.78	13,185,767.78
本期申购	1,274,633.63	1,274,633.63
本期赎回(以“-”号填列)	-1,826,049.37	-1,826,049.37
-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	12,634,352.04	12,634,352.04

##### 平安中证 500 指数增强 C

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	15,622,824.01	15,622,824.01
本期申购	46,788,888.74	46,788,888.74
本期赎回 (以“-”号填列)	-46,031,433.54	-46,031,433.54
-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	16,380,279.21	16,380,279.21

## 6.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

平安中证 500 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,617,427.86	1,340,640.09	2,958,067.95
本期利润	1,275,992.97	-140,114.19	1,135,878.78
本期基金份额交易产生的变动数	-78,388.93	-88,305.67	-166,694.60
其中: 基金申购款	195,534.69	137,589.65	333,124.34
基金赎回款	-273,923.62	-225,895.32	-499,818.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,815,031.90	1,112,220.23	3,927,252.13

平安中证 500 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,860,357.44	1,587,442.21	3,447,799.65
本期利润	2,079,996.78	-387,951.14	1,692,045.64
本期基金份额交易产生的变动数	-406,927.68	241,936.07	-164,991.61
其中: 基金申购款	7,526,105.46	4,305,564.78	11,831,670.24
基金赎回款	-7,933,033.14	-4,063,628.71	-11,996,661.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,533,426.54	1,441,427.14	4,974,853.68

## 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	4,857.91
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	127.36
其他	31.80
合计	5,017.07

## 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	3,532,807.06
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	3,532,807.06

## 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	52,533,777.92
减：卖出股票成本总额	49,000,970.86
买卖股票差价收入	3,532,807.06

## 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	6,442.38
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	6,442.38

#### 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	70,453.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	64,000.00
减：应收利息总额	11.22
买卖债券差价收入	6,442.38

#### 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	340,546.91
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	340,546.91

**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	-528,065.33
股票投资	-528,065.33
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-528,065.33

**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	1,732.86
基金转换费收入	99.29
合计	1,832.15

#### 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	146,277.95
银行间市场交易费用	-
合计	146,277.95

#### 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	17,356.09
信息披露费	24,795.19
证券出借违约金	-
银行费用	2,415.93
指数使用费	100,000.00
其他	400.00
合计	144,967.21

#### 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
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
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
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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年5月27日(基金合同生效日) 至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
平安证券	-	-	33,469,859.50	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年5月27日(基金合同生效日) 至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
平安证券	-	-	110,700,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年5月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	31,170.63	100.00	31,170.63	100.00

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。

#### 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5月27日（基金合 同生效日）至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	168,727.56	34,058.28
其中：支付销售机构的客户维护费	43,896.76	9,866.82

注：支付基金管理人平安基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.00\% / \text{当年天数}。$$

##### 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	上年度可比期间 2020年5月27日（基金合
----	------------------------	---------------------------

	月 30 日	同生效日) 至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	25,309.10	5,108.74

注：支付基金托管行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

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C	合计
陆金所	-	620.65	620.65
平安基金	-	467.57	467.57
平安人寿	-	22,707.99	22,707.99
平安银行	-	2,286.54	2,286.54
平安证券	-	168.07	168.07
中国银行	-	329.66	329.66
合计	-	26,580.48	26,580.48
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020 年 5 月 27 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C	合计
陆金所	-	4.76	4.76
平安人寿	-	8,053.50	8,053.50
平安证券	-	25.21	25.21
中国银行	-	0.34	0.34
合计	-	8,083.81	8,083.81

注：支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额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，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资

产净值×0.50%/当年天数。

#### 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	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2020年5月27日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,002,250.23	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	10,002,250.23	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	79.1671%	-
项目	上年度可比期间	上年度可比期间
	2020年5月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日	2020年5月27日（基金合同生效日）至2020年6月30日
	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日（2020年5	10,002,250.23	-

月 27 日) 持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减: 报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,002,250.23	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	83.2591%	-

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 5 月 27 日 (基金合同生效日) 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	489,703.04	4,857.91	2,038,885.82	3,772.10

注: 本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管, 按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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 5 月 27 日 (基金合同生效日) 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
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	416,058	1,102,553.70	2,359,048.86	-
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	-
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	21	2,100.00	2,100.00	-
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	25	2,500.00	2,500.00	-

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，锁定期限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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	800	34,487.00	45,080.00	-

#### 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：本基金本报告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对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发行的证券，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 0.01%（上年末：0.01%）。

#### 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，并按照合约

规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	489,703.04	-	-	-	489,703.04
结算备付金	2,868.62	-	-	-	2,868.62
存出保证金	3,167.86	-	-	-	3,167.86
交易性金融资产	4,600.00	-	-	35,684,717.86	35,689,317.86
应收利息	-	-	-	385.58	385.58
应收申购款	-	-	-	79,164.82	79,164.82
应收证券清算款	-	-	-	5,357,894.28	5,357,894.28
资产总计	500,339.52	-	-	41,122,162.54	41,622,502.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,374,652.79	3,374,652.79
应付管理人报酬	-	-	-	42,357.65	42,357.65
应付托管费	-	-	-	6,353.66	6,353.66
应付销售服务费	-	-	-	14,526.87	14,526.87
应付交易费用	-	-	-	75,722.75	75,722.75
其他负债	-	-	-	192,151.28	192,151.28
负债总计	-	-	-	3,705,765.00	3,705,765.00
利率敏感度缺口	500,339.52	-	-	37,416,397.54	37,916,737.06
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	1,977,966.29	-	-	-	1,977,966.29
结算备付金	4,576.89	-	-	-	4,576.89
存出保证金	10,364.22	-	-	-	10,364.22
交易性金融资产	2,000.00	-	-	33,726,996.58	33,728,996.58
应收利息	-	-	-	190.31	190.31
应收申购款	-	-	-	54,242.69	54,242.69
应收证券清算款	-	-	-	32,461.30	32,461.30
资产总计	1,994,907.40	-	-	33,813,890.88	35,808,798.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	399,732.83	399,732.83
应付管理人报酬	-	-	-	29,737.74	29,737.74
应付托管费	-	-	-	4,460.69	4,460.69
应付销售服务费	-	-	-	8,259.86	8,259.86
应付交易费用	-	-	-	17,147.77	17,147.77
其他负债	-	-	-	135,000.00	135,000.00
负债总计	-	-	-	594,338.89	594,338.89
利率敏感度缺口	1,994,907.40	-	-	33,219,551.99	35,214,459.39

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 0.01%(上年末：0.01%)，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

##### 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	35,684,717.86	94.11	33,726,996.58	95.78
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	35,684,717.86	94.11	33,726,996.58	95.78
----	---------------	-------	---------------	-------

#### 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%	1,167,765.00	815,045.96
	沪深 300 指数下降 5%	-1,167,765.00	-815,045.96

#### 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	35,684,717.86	85.73
	其中：股票	35,684,717.86	85.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,600.00	0.01
	其中：债券	4,600.00	0.01
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	492,571.66	1.18
8	其他各项资产	5,440,612.54	13.07
9	合计	41,622,502.06	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	244,088.00	0.64
B	采矿业	1,008,857.00	2.66

C	制造业	19,464,616.27	51.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	374,192.00	0.99
E	建筑业	645,126.00	1.70
F	批发和零售业	711,915.00	1.88
G	交通运输、仓储和邮政业	174,456.00	0.46
H	住宿和餐饮业	288,147.00	0.76
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,017,542.10	5.32
J	金融业	1,633,026.10	4.31
K	房地产业	528,197.00	1.39
L	租赁和商务服务业	78,160.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	293,194.50	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	161,817.50	0.43
R	文化、体育和娱乐业	404,586.00	1.07
S	综合	188,181.00	0.50
	合计	28,216,101.47	74.42

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	111,518.00	0.29
C	制造业	3,630,496.95	9.57
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,363,710.86	6.23
E	建筑业	11,014.44	0.03
F	批发和零售业	87,587.40	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	132,988.00	0.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	288,704.40	0.76
J	金融业	270,980.66	0.71
K	房地产业	120,929.00	0.32

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	187,859.68	0.50
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	180,507.00	0.48
R	文化、体育和娱乐业	82,320.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	7,468,616.39	19.70

### 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	603444	吉比特	800	424,000.00	1.12
2	600563	法拉电子	2,300	364,228.00	0.96
3	002709	天赐材料	3,340	355,977.20	0.94
4	300316	晶盛机电	6,500	328,250.00	0.87
5	002648	卫星石化	7,960	311,952.40	0.82
6	000932	华菱钢铁	45,700	301,620.00	0.80
7	603486	科沃斯	1,300	296,504.00	0.78
8	600885	宏发股份	4,700	294,690.00	0.78
9	300207	欣旺达	8,900	289,784.00	0.76
10	601233	桐昆股份	11,900	286,671.00	0.76
11	002353	杰瑞股份	6,400	286,080.00	0.75
12	002185	华天科技	18,400	283,176.00	0.75
13	300285	国瓷材料	5,700	277,875.00	0.73
14	002138	顺络电子	7,000	271,390.00	0.72
15	688002	睿创微纳	2,471	246,679.93	0.65
16	002385	大北农	35,500	241,400.00	0.64
17	002080	中材科技	9,000	235,530.00	0.62
18	600486	扬农化工	2,100	234,717.00	0.62
19	600779	水井坊	1,800	227,430.00	0.60
20	002511	中顺洁柔	8,100	223,155.00	0.59
21	002056	横店东磁	17,000	221,000.00	0.58

22	000807	云铝股份	18,500	220,150.00	0.58
23	002156	通富微电	9,100	218,764.00	0.58
24	002078	太阳纸业	15,700	209,595.00	0.55
25	300699	光威复材	2,700	205,065.00	0.54
26	300115	长盈精密	9,920	204,352.00	0.54
27	300463	迈克生物	4,800	202,032.00	0.53
28	600188	兖州煤业	13,100	201,216.00	0.53
29	603568	伟明环保	8,750	199,762.50	0.53
30	002444	巨星科技	5,800	197,664.00	0.52
31	000547	航天发展	10,400	196,248.00	0.52
32	002572	索菲亚	8,100	196,020.00	0.52
33	600782	新钢股份	35,100	195,858.00	0.52
34	002507	涪陵榨菜	5,200	195,832.00	0.52
35	601198	东兴证券	17,800	194,554.00	0.51
36	002690	美亚光电	3,400	189,584.00	0.50
37	600732	爱旭股份	13,600	189,312.00	0.50
38	300618	寒锐钴业	2,400	189,216.00	0.50
39	000009	中国宝安	10,300	188,181.00	0.50
40	600754	锦江酒店	3,300	187,935.00	0.50
41	603638	艾迪精密	4,380	187,770.60	0.50
42	000636	风华高科	6,200	187,364.00	0.49
43	002281	光迅科技	7,600	186,960.00	0.49
44	600039	四川路桥	29,700	186,219.00	0.49
45	002028	思源电气	6,000	184,740.00	0.49
46	601615	明阳智能	11,400	184,566.00	0.49
47	600549	厦门钨业	8,800	183,304.00	0.48
48	002013	中航机电	18,200	183,274.00	0.48
49	603737	三棵树	1,040	183,040.00	0.48
50	000039	中集集团	10,000	181,800.00	0.48
51	600862	中航高科	5,900	181,602.00	0.48
52	300037	新宙邦	1,800	180,180.00	0.48
53	603605	珀莱雅	900	177,039.00	0.47
54	000983	山西焦煤	20,800	172,848.00	0.46
55	600739	XD 辽宁成	8,200	170,642.00	0.45
56	000825	太钢不锈	22,700	170,023.00	0.45
57	601636	旗滨集团	9,100	168,896.00	0.45
58	600507	方大特钢	24,900	168,822.00	0.45
59	688099	晶晨股份	1,500	168,300.00	0.44
60	000830	鲁西化工	8,800	164,824.00	0.43
61	002373	千方科技	9,700	161,990.00	0.43
62	300244	迪安诊断	4,225	161,817.50	0.43
63	600803	新奥股份	9,800	161,798.00	0.43

64	002340	格林美	17,300	161,755.00	0.43
65	000686	东北证券	19,100	161,395.00	0.43
66	002092	中泰化学	15,500	159,185.00	0.42
67	601577	长沙银行	17,800	159,132.00	0.42
68	600765	中航重机	7,000	158,550.00	0.42
69	601928	凤凰传媒	22,100	157,794.00	0.42
70	600409	三友化工	15,600	157,716.00	0.42
71	600089	特变电工	12,200	156,770.00	0.41
72	600219	南山铝业	43,400	156,240.00	0.41
73	002030	达安基因	7,276	154,542.24	0.41
74	300418	昆仑万维	9,400	153,972.00	0.41
75	002901	大博医疗	2,100	153,069.00	0.40
76	002299	圣农发展	6,400	152,832.00	0.40
77	300253	卫宁健康	9,350	152,124.50	0.40
78	000581	威孚高科	7,300	152,059.00	0.40
79	600201	生物股份	8,700	151,815.00	0.40
80	600316	洪都航空	3,900	150,072.00	0.40
81	601128	常熟银行	24,200	150,040.00	0.40
82	000739	普洛药业	5,100	149,940.00	0.40
83	002250	联化科技	5,200	145,080.00	0.38
84	600271	航天信息	11,000	143,330.00	0.38
85	601598	中国外运	28,200	142,410.00	0.38
86	600988	赤峰黄金	9,300	139,407.00	0.37
87	002074	国轩高科	3,200	139,392.00	0.37
88	600380	健康元	10,000	137,300.00	0.36
89	002966	苏州银行	18,500	135,975.00	0.36
90	603866	桃李面包	4,340	135,408.00	0.36
91	600884	杉杉股份	5,800	135,256.00	0.36
92	002557	洽洽食品	3,100	133,610.00	0.35
93	002925	盈趣科技	3,390	131,904.90	0.35
94	000738	航发控制	6,300	131,229.00	0.35
95	601117	中国化学	14,900	130,524.00	0.34
96	002926	华西证券	13,400	129,042.00	0.34
97	300271	华宇软件	6,700	128,975.00	0.34
98	002048	宁波华翔	6,600	128,700.00	0.34
99	600908	无锡银行	22,100	128,180.00	0.34
100	000799	酒鬼酒	500	127,800.00	0.34
101	000750	国海证券	30,100	127,624.00	0.34
102	300308	中际旭创	3,300	127,116.00	0.34
103	000623	吉林敖东	8,200	127,018.00	0.33
104	300146	汤臣倍健	3,800	125,020.00	0.33
105	603707	健友股份	2,980	124,415.00	0.33

106	001914	招商积余	7,200	123,696.00	0.33
107	601689	拓普集团	3,300	123,519.00	0.33
108	000062	深圳华强	7,300	123,443.00	0.33
109	601997	贵阳银行	17,100	122,436.00	0.32
110	002439	启明星辰	4,200	121,842.00	0.32
111	603786	科博达	1,600	120,800.00	0.32
112	600909	华安证券	21,630	120,479.10	0.32
113	688088	虹软科技	2,100	117,075.00	0.31
114	000717	韶钢松山	25,500	117,045.00	0.31
115	601168	西部矿业	9,800	116,914.00	0.31
116	002372	伟星新材	5,600	115,752.00	0.31
117	600985	淮北矿业	9,400	114,774.00	0.30
118	600068	葛洲坝	15,300	114,597.00	0.30
119	000488	晨鸣纸业	14,000	113,960.00	0.30
120	000690	宝新能源	22,200	113,442.00	0.30
121	300630	普利制药	2,097	109,882.80	0.29
122	603589	口子窖	1,600	108,304.00	0.29
123	002019	亿帆医药	6,200	106,950.00	0.28
124	300482	万孚生物	1,630	105,444.70	0.28
125	002985	北摩高科	1,060	103,350.00	0.27
126	600325	华发股份	15,000	101,100.00	0.27
127	300002	神州泰岳	20,700	100,395.00	0.26
128	600258	首旅酒店	4,200	100,212.00	0.26
129	002124	天邦股份	14,020	98,280.20	0.26
130	002242	九阳股份	3,000	97,470.00	0.26
131	603712	七一二	2,700	97,470.00	0.26
132	603290	斯达半导	300	96,000.00	0.25
133	002244	滨江集团	22,900	95,951.00	0.25
134	688208	道通科技	1,100	95,689.00	0.25
135	000090	天健集团	17,200	95,116.00	0.25
136	000975	银泰黄金	10,000	95,100.00	0.25
137	600895	张江高科	5,200	95,004.00	0.25
138	603883	老百姓	1,800	94,824.00	0.25
139	600373	中文传媒	9,600	94,656.00	0.25
140	300212	易华录	3,500	94,185.00	0.25
141	000967	盈峰环境	13,600	93,432.00	0.25
142	002603	以岭药业	3,200	93,312.00	0.25
143	600066	宇通客车	7,400	92,426.00	0.24
144	600064	南京高科	9,900	91,971.00	0.24
145	600598	北大荒	6,100	91,256.00	0.24
146	002595	豪迈科技	3,400	90,780.00	0.24
147	600998	九州通	5,900	90,683.00	0.24

148	600827	百联股份	4,500	90,675.00	0.24
149	300383	光环新网	6,300	90,657.00	0.24
150	000877	天山股份	6,900	89,907.00	0.24
151	300357	我武生物	1,400	89,768.00	0.24
152	601098	中南传媒	10,000	88,200.00	0.23
153	002705	新宝股份	3,300	86,625.00	0.23
154	600970	中材国际	9,400	86,198.00	0.23
155	600801	华新水泥	4,900	86,093.00	0.23
156	603260	合盛硅业	1,100	84,601.00	0.22
157	600155	华创阳安	7,900	84,530.00	0.22
158	600153	建发股份	10,000	81,000.00	0.21
159	002065	东华软件	10,100	80,093.00	0.21
160	601717	郑煤机	6,800	79,084.00	0.21
161	000878	云南铜业	6,100	78,263.00	0.21
162	002127	南极电商	8,000	78,160.00	0.21
163	002423	中粮资本	8,500	76,925.00	0.20
164	002128	露天煤业	7,000	72,870.00	0.19
165	603198	迎驾贡酒	1,600	70,880.00	0.19
166	600216	浙江医药	4,400	70,444.00	0.19
167	600141	兴发集团	3,700	69,671.00	0.18
168	600392	盛和资源	3,900	67,704.00	0.18
169	300088	长信科技	8,000	66,080.00	0.17
170	000598	兴蓉环境	12,600	65,646.00	0.17
171	000012	南玻A	6,400	65,536.00	0.17
172	002212	天融信	3,300	65,241.00	0.17
173	000930	中粮科技	7,100	63,971.00	0.17
174	300133	华策影视	10,800	63,936.00	0.17
175	002683	宏大爆破	2,300	63,871.00	0.17
176	000630	铜陵有色	23,300	63,376.00	0.17
177	000400	许继电气	5,000	63,300.00	0.17
178	000401	冀东水泥	5,100	62,985.00	0.17
179	002831	裕同科技	2,100	62,349.00	0.16
180	002532	天山铝业	7,400	62,086.00	0.16
181	600859	王府井	2,100	60,648.00	0.16
182	603317	天味食品	2,060	60,625.80	0.16
183	002368	太极股份	2,960	59,377.60	0.16
184	002396	星网锐捷	2,700	57,645.00	0.15
185	002387	维信诺	5,200	54,236.00	0.14
186	002408	齐翔腾达	4,100	50,922.00	0.13
187	002701	奥瑞金	9,500	48,830.00	0.13
188	002180	纳思达	1,500	48,300.00	0.13
189	600126	杭钢股份	9,400	48,222.00	0.13

190	600529	山东药玻	1,400	47,530.00	0.13
191	600038	中直股份	900	47,466.00	0.13
192	002233	塔牌集团	4,600	47,288.00	0.12
193	600460	士兰微	800	45,080.00	0.12
194	000528	柳工	5,400	44,280.00	0.12
195	002110	三钢闽光	6,400	43,136.00	0.11
196	601099	太平洋	12,600	42,714.00	0.11
197	002867	周大生	2,150	42,505.50	0.11
198	002223	鱼跃医疗	1,100	41,943.00	0.11
199	603893	瑞芯微	300	41,838.00	0.11
200	000513	丽珠集团	800	40,016.00	0.11
201	603000	人民网	2,000	34,380.00	0.09
202	002429	兆驰股份	5,600	33,992.00	0.09
203	002563	森马服饰	2,800	33,460.00	0.09
204	601778	晶科科技	6,100	33,306.00	0.09
205	000997	新大陆	2,000	33,180.00	0.09
206	601568	北元集团	3,800	32,528.00	0.09
207	002081	金螳螂	4,100	32,472.00	0.09
208	600060	海信视像	1,900	32,110.00	0.08
209	603885	吉祥航空	2,100	32,046.00	0.08
210	600968	海油发展	12,300	31,857.00	0.08
211	600398	海澜之家	4,400	31,856.00	0.08
212	603888	新华网	1,500	31,755.00	0.08
213	002434	万里扬	3,900	31,629.00	0.08
214	300474	景嘉微	300	29,376.00	0.08
215	600177	雅戈尔	4,400	28,996.00	0.08
216	600639	浦东金桥	1,500	20,475.00	0.05
217	003022	联泓新科	500	15,350.00	0.04

### 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	416,058	2,359,048.86	6.22
2	688139	海尔生物	1,500	157,650.00	0.42
3	300274	阳光电源	1,300	149,578.00	0.39
4	300496	中科创达	900	141,354.00	0.37
5	002459	晶澳科技	2,800	137,200.00	0.36
6	603806	福斯特	1,280	134,566.40	0.35
7	002460	赣锋锂业	1,100	133,199.00	0.35
8	601377	兴业证券	13,400	129,444.00	0.34
9	603345	安井食品	500	127,010.00	0.33

10	600926	杭州银行	8,500	125,375.00	0.33
11	600143	金发科技	5,600	116,816.00	0.31
12	002821	凯莱英	300	111,780.00	0.29
13	002568	百润股份	1,100	104,269.00	0.27
14	002064	华峰化学	7,300	103,660.00	0.27
15	600845	宝信软件	1,950	99,255.00	0.26
16	601865	福莱特	2,500	98,825.00	0.26
17	300014	亿纬锂能	943	98,005.99	0.26
18	002414	高德红外	3,540	97,633.20	0.26
19	300558	贝达药业	900	97,416.00	0.26
20	603882	金城医学	600	95,862.00	0.25
21	300529	健帆生物	1,100	94,996.00	0.25
22	603338	浙江鼎力	1,580	92,730.20	0.24
23	601799	星宇股份	400	90,288.00	0.24
24	300595	欧普康视	860	89,053.00	0.23
25	000708	中信特钢	4,200	87,528.00	0.23
26	300012	华测检测	2,700	86,076.00	0.23
27	000516	国际医学	4,500	84,645.00	0.22
28	300413	芒果超媒	1,200	82,320.00	0.22
29	600426	华鲁恒升	2,610	80,779.50	0.21
30	601966	玲珑轮胎	1,800	78,732.00	0.21
31	002311	海大集团	900	73,440.00	0.19
32	603456	九洲药业	1,500	72,870.00	0.19
33	603259	药明康德	452	70,778.68	0.19
34	600745	闻泰科技	700	67,830.00	0.18
35	300502	新易盛	2,081	65,031.25	0.17
36	600521	华海药业	3,100	64,728.00	0.17
37	603501	韦尔股份	200	64,400.00	0.17
38	601012	隆基股份	720	63,964.80	0.17
39	600346	恒力石化	2,400	62,976.00	0.17
40	000951	中国重汽	2,300	62,238.00	0.16
41	603816	顾家家居	800	61,824.00	0.16
42	601808	中海油服	4,300	61,748.00	0.16
43	002049	紫光国微	400	61,676.00	0.16
44	600048	保利地产	5,100	61,404.00	0.16
45	000002	万科A	2,500	59,525.00	0.16
46	002791	坚朗五金	300	58,215.00	0.15
47	002493	荣盛石化	3,300	56,991.00	0.15
48	603659	璞泰来	400	54,640.00	0.14
49	603713	密尔克卫	500	53,990.00	0.14
50	601919	中远海控	1,700	51,918.00	0.14
51	688122	西部超导	800	51,896.00	0.14
52	601666	平煤股份	7,000	49,770.00	0.13

53	000733	振华科技	800	48,856.00	0.13
54	000625	长安汽车	1,600	42,048.00	0.11
55	002430	杭氧股份	1,100	38,049.00	0.10
56	300888	稳健医疗	300	37,086.00	0.10
57	603005	晶方科技	620	36,722.60	0.10
58	002624	完美世界	1,500	35,865.00	0.09
59	603027	千禾味业	1,360	35,754.40	0.09
60	603218	日月股份	1,300	35,204.00	0.09
61	002367	康力电梯	3,700	33,078.00	0.09
62	002318	久立特材	2,700	32,454.00	0.09
63	002626	金达威	700	31,290.00	0.08
64	603018	华设集团	3,900	31,005.00	0.08
65	002727	一心堂	900	29,799.00	0.08
66	603939	益丰药房	520	29,166.80	0.08
67	603233	大参林	560	28,621.60	0.08
68	002352	顺丰控股	400	27,080.00	0.07
69	603686	龙马环卫	1,100	16,731.00	0.04
70	601528	瑞丰银行	1,038	16,161.66	0.04
71	603171	税友股份	637	12,230.40	0.03
72	001207	联科科技	341	11,290.51	0.03
73	605287	德才股份	349	11,014.44	0.03
74	001208	华菱线缆	970	7,498.10	0.02
75	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.01

## 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	1,575,075.20	4.47
2	002138	顺络电子	508,813.00	1.44
3	300463	迈克生物	466,934.00	1.33
4	600782	新钢股份	452,754.00	1.29
5	600885	宏发股份	440,407.00	1.25
6	601198	东兴证券	434,557.00	1.23
7	600563	法拉电子	429,214.00	1.22
8	002385	大北农	424,039.00	1.20
9	000932	华菱钢铁	419,302.00	1.19
10	300285	国瓷材料	403,330.00	1.15
11	002056	横店东磁	386,265.00	1.10
12	002648	卫星石化	384,832.00	1.09
13	601577	长沙银行	372,030.00	1.06
14	688002	睿创微纳	368,061.35	1.05
15	300207	欣旺达	366,569.00	1.04

16	300244	迪安诊断	365,893.00	1.04
17	601928	凤凰传媒	365,607.00	1.04
18	600486	扬农化工	365,263.00	1.04
19	600803	新奥股份	363,672.00	1.03
20	600409	三友化工	363,044.00	1.03

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	818,121.00	2.32
2	300274	阳光电源	632,438.00	1.80
3	600563	法拉电子	530,626.00	1.51
4	002709	天赐材料	448,488.00	1.27
5	002064	华峰化学	446,308.00	1.27
6	000932	华菱钢铁	412,455.00	1.17
7	603882	金域医学	406,781.00	1.16
8	300316	晶盛机电	391,730.00	1.11
9	002353	杰瑞股份	383,394.00	1.09
10	002648	卫星石化	377,328.00	1.07
11	300285	国瓷材料	372,535.00	1.06
12	002511	中顺洁柔	371,482.00	1.05
13	600885	宏发股份	363,548.00	1.03
14	002385	大北农	343,581.00	0.98
15	002028	思源电气	340,118.00	0.97
16	600486	扬农化工	328,379.00	0.93
17	002185	华天科技	325,651.00	0.92
18	603486	科沃斯	320,351.00	0.91
19	600079	人福医药	312,155.00	0.89
20	600143	金发科技	311,808.00	0.89

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	51,486,757.47
卖出股票收入（成交）总额	52,533,777.92

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）	4,600.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,600.00	0.01

### 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	127038	国微转债	25	2,500.00	0.01
2	123117	健帆转债	21	2,100.00	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

浙江卫星石化股份有限公司因存在以下违规事项：一、船舶期租协议未履行审议程序且未及时对外披露；二、造船承接协议未履行审议程序且未及时对外披露，于 2020 年 11 月 26 日收到深圳证券交易所出具的《关于对浙江卫星石化股份有限公司及相关当事人给予通报批评处分的规定》。

浙江卫星石化股份有限公司因内部控制、信息披露等工作中存在的问题，于 2020 年 12 月 18 日公司及相关责任人员收到中国证券监督管理委员会浙江监管局行政监管措施决定书《关于对浙江卫星石化股份有限公司及杨卫东、沈晓炜、王满英采取出具警示函措施的决定》（【2020】106 号）。

浙江卫星石化股份有限公司因违反了深交所《中小企业板上市公司规范运作指引（2015 年修订）》第 6.3.13 条的规定，于 2021 年 1 月 19 日收到深交所中小板公司管理部《关于对浙江卫星石化股份有限公司的监管函》中小板监管函【2020】第 174 号。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，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报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

### 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	3,167.86
2	应收证券清算款	5,357,894.28
3	应收股利	-
4	应收利息	385.58
5	应收申购款	79,164.82
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,440,612.54

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

## 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的股票。

## 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	2,359,048.86	6.22	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

份额级别	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 (%)
平安中证 500 指数增强 A	364	34,709.76	10,002,250.23	79.17	2,632,101.81	20.83
平安中证 500 指数增	2,500	6,552.11	-	-	16,380,279.21	100.00

强 C						
合计	2,828	10,259.77	10,002,250.23	34.47	19,012,381.02	65.53

注：上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安中证 500 指数增强 A	-	-
	平安中证 500 指数增强 C	20,013.50	0.1222
	合计	20,013.50	0.0690

注：上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 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	份额级别	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	平安中证 500 指数增强 A	0
	平安中证 500 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安中证 500 指数增强 A	0
	平安中证 500 指数增强 C	0
	合计	0

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例（%）	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例（%）	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,002,250.23	34.47	10,000,000.00	34.47	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-

基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,002,250.23	34.47	10,000,000.00	34.47	3 年

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安中证 500 指数增强 A	平安中证 500 指数增强 C
基金合同生效日 (2020 年 5 月 27 日)	12,013,400.08	23,981,471.99
基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	13,185,767.78	15,622,824.01
本报告期基金总申购份额	1,274,633.63	46,788,888.74
减：本报告期基金总赎回份额	1,826,049.37	46,031,433.54
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	12,634,352.04	16,380,279.21

## § 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	
中国国际金融股份有限公司	2	42,620,524.69	41.76%	39,693.42	46.87%	-
中信建投证券	1	33,696,237.57	33.02%	24,642.80	29.10%	-
东方证券	3	5,665,193.57	5.55%	4,144.66	4.89%	-
兴业证券	2	4,933,340.03	4.83%	3,517.38	4.15%	-
申万宏源证券	1	3,174,396.20	3.11%	2,956.56	3.49%	-
安信证券	4	2,208,218.63	2.16%	1,614.81	1.91%	-
长江证券	1	2,159,336.15	2.12%	2,011.10	2.37%	-
华泰证券	3	2,086,038.30	2.04%	1,483.81	1.75%	-
招商证券	2	1,979,631.10	1.94%	1,843.68	2.18%	-
中泰证券	1	1,703,799.00	1.67%	1,211.99	1.43%	-
方正证券	1	1,171,290.85	1.15%	1,090.83	1.29%	-
国泰君安证券	2	635,940.60	0.62%	452.47	0.53%	-
广发证券	3	23,880.00	0.02%	22.24	0.03%	-

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	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	39,427.00	55.96%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	20,674.00	29.34%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	10,352.60	14.69%	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
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	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 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旗下部分基金新增北京恒天明泽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 03 月 12 日
5	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中正达广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 03 月 16 日
6	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 29 日
7	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
8	平安中证 500 指数增强型发起式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
9	平安中证 500 指数增强型发起式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
10	平安中证 500 指数增强型发起式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 03 月 31 日
11	平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金 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
12	平安中证 500 指数增强型发起式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 27 日
13	平安基金管理有限公司关于新增华泰证券股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 27 日
14	平安中证 500 指数增强型发起式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 27 日
15	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
16	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

17	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海万得基金销售有限公司为销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 07 日
18	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
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
20	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

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2021/01/01--2021/06/09; 2021/06/17--2021/06/30	10,002,250.23	-	-	10,002,250.23	34.47
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5,000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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）中国证监会准予平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金基金合同
- （3）平安中证 500 指数增强型发起式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，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2021 年 8 月 27 日