

平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 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：平安银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告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	9
§ 4 管理人报告	9
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
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
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
§ 7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56

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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§ 8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
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	59
§ 9 开放式基金份额变动	59
§ 10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
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	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
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	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	64
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金	
基金简称	平安沪深 300 指数量化增强	
基金主代码	005113	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 26 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	350,413,730.44 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	005113	005114
报告期末下属分级基金的份额总额	162,019,905.11 份	188,393,825.33 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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、跟踪沪深 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	本基金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、跟踪沪深 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，以达到或超越具有良好市场代表性、流动性与投资性的沪深 300 指数的收益率水平，为投资者提供一个有效分享中国经济持续增长过程中带来的系统性投资机会。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活存款利率（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	平安银行股份有限公司
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	95511-3

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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)	
	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
本期已实现收益	7,834,813.56	10,260,427.61
本期利润	11,533,234.77	14,185,086.57
加权平均基金份额本期利润	0.1106	0.0931
本期加权平均净值利润率	7.51%	6.45%
本期基金份额净值增长率	6.39%	6.12%
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	9,962,861.96
	12,754,461.24	

期末可供分配基金份额利润	0.0787	0.0529
期末基金资产净值	248,239,026.28	282,400,502.86
期末基金份额净值	1.5322	1.4990
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	53.22%	49.90%

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

平安沪深 300 指数量化增强 A

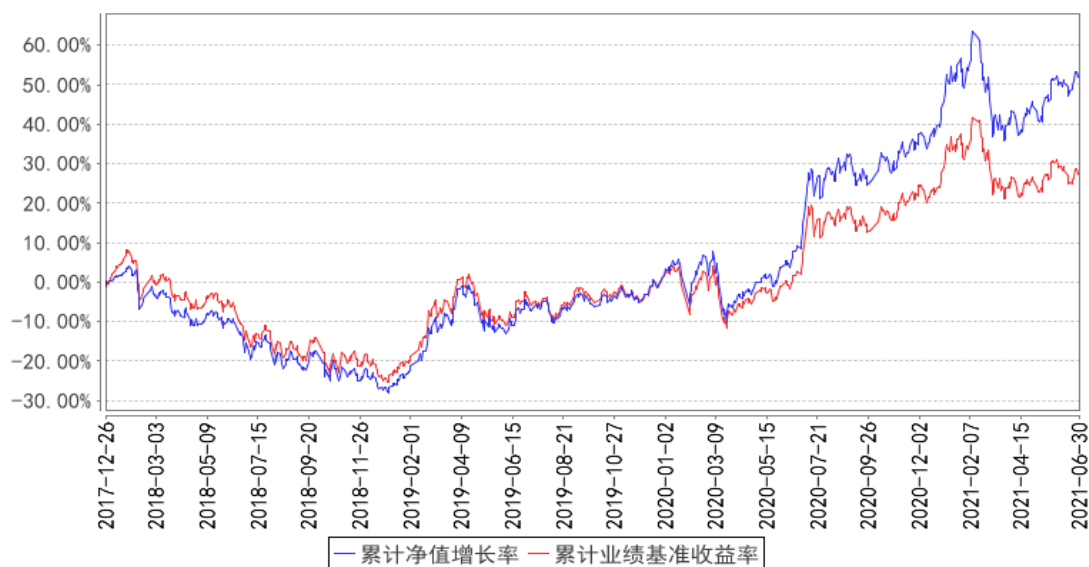
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.86%	0.79%	-1.91%	0.76%	2.77%	0.03%
过去三个月	9.47%	1.01%	3.32%	0.93%	6.15%	0.08%
过去六个月	6.39%	1.40%	0.29%	1.25%	6.10%	0.15%
过去一年	38.81%	1.37%	24.19%	1.27%	14.62%	0.10%
过去三年	81.43%	1.32%	46.42%	1.30%	35.01%	0.02%
自基金合同生效起至今	53.22%	1.28%	28.16%	1.27%	25.06%	0.01%

平安沪深 300 指数量化增强 C

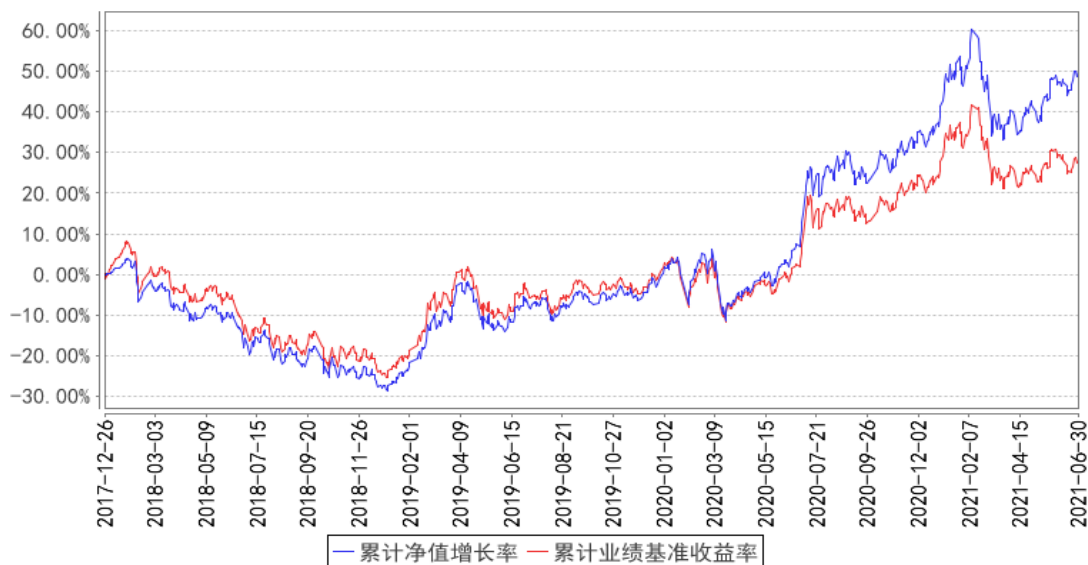
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.82%	0.79%	-1.91%	0.76%	2.73%	0.03%
过去三个月	9.33%	1.01%	3.32%	0.93%	6.01%	0.08%
过去六个月	6.12%	1.40%	0.29%	1.25%	5.83%	0.15%
过去一年	38.13%	1.37%	24.19%	1.27%	13.94%	0.10%
过去三年	78.09%	1.32%	46.42%	1.30%	31.67%	0.02%
自基金合同生效起至今	49.90%	1.28%	28.16%	1.27%	21.74%	0.01%

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

平安沪深300指数量化增强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



平安沪深300指数量化增强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、本基金基金合同于 2017 年 12 月 26 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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		(助理) 期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
毛时超	平安沪深 300 指数量化增强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

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沪深两市新股询价申购，增厚基金的投资收益。

本基金跟踪的沪深 300 指数，整体偏向金融、食品饮料、医药、电子、电力新能源等行业，以沪深两市较大市值股票为主。报告期内，虽然金融和食品饮料行业表现较差，基准指数整体涨幅一般，但是本基金相比基准指数，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

截至本报告期末平安沪深 300 指数量化增强 A 的基金份额净值 1.5322 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.39%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%；截至本报告期末平安沪深 300 指数量化增强 C 的基金份额净值 1.4990 元，本报告期基金份额净值增长率为 6.12%，同期业绩比较基准收益率为 0.29%。

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。本基金跟踪的沪深 300 指数，以沪深两市的大市值、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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金

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	23,944,530.03	17,789,775.38
结算备付金		161,573.55	5,804.30
存出保证金		72,259.32	104,588.07
交易性金融资产	6.4.7.2	508,066,282.02	319,447,262.41
其中：股票投资		502,792,548.27	319,447,262.41
基金投资		-	-
债券投资		5,273,733.75	-
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		-	550,004.58
应收利息	6.4.7.5	108,174.04	1,712.98
应收股利		-	-
应收申购款		232,751.53	141,415.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		532,585,570.49	338,040,563.31
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		228,318.19	-
应付赎回款		726,398.57	1,702,694.77
应付管理人报酬		358,574.75	273,676.29
应付托管费		35,857.47	27,367.60

应付销售服务费		112,223.21	71,781.84
应付交易费用	6.4.7.7	124,840.73	34,477.63
应交税费		0.35	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	359,828.08	274,850.53
负债合计		1,946,041.35	2,384,848.66
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	350,413,730.44	235,475,045.24
未分配利润	6.4.7.10	180,225,798.70	100,180,669.41
所有者权益合计		530,639,529.14	335,655,714.65
负债和所有者权益总计		532,585,570.49	338,040,563.31

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 350,413,730.44 份，其中平安沪深 300 指数量化增强 A 基金份额总额 162,019,905.11 份，基金份额净值 1.5322 元。平安沪深 300 指数量化增强 C 基金份额总额 188,393,825.33 份，基金份额净值 1.4990 元。

6.2 利润表

会计主体：平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金

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		28,837,816.37	6,309,544.85
1. 利息收入		60,198.70	20,136.42
其中：存款利息收入	6.4.7.11	39,504.75	20,134.72
债券利息收入		20,693.95	1.70
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）		21,081,025.55	7,222,243.32
其中：股票投资收益	6.4.7.12	17,885,923.12	6,720,016.16
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	245,689.89	-
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	2,949,412.54	502,227.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	7,623,080.17	-1,009,885.10
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	73,511.95	77,050.21
减：二、费用		3,119,495.03	1,164,036.35
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,859,173.41	414,699.52
2. 托管费	6.4.10.2.2	185,917.32	41,469.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	546,801.80	84,394.01
4. 交易费用	6.4.7.19	338,342.20	437,941.98
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0.15	-
7. 其他费用	6.4.7.20	189,260.15	185,530.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,718,321.34	5,145,508.50
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,718,321.34	5,145,508.50

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金

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）	235,475,045.24	100,180,669.41	335,655,714.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	25,718,321.34	25,718,321.34
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	114,938,685.20	54,326,807.95	169,265,493.15

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	192,446,326.59	90,101,195.89	282,547,522.48
2. 基金赎回款	-77,507,641.39	-35,774,387.94	-113,282,029.33
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）	350,413,730.44	180,225,798.70	530,639,529.14
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）	104,832,271.00	1,231,392.49	106,063,663.49
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,145,508.50	5,145,508.50
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）	-57,944,617.54	-1,969,097.44	-59,913,714.98
其中：1. 基金申购款	71,854,724.58	5,093.25	71,859,817.83
2. 基金赎回款	-129,799,342.12	-1,974,190.69	-131,773,532.81
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）	46,887,653.46	4,407,803.55	51,295,457.01

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：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
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

平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金(原名为平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]1226 号《关于准予平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华沪深 300 指数量化增强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 210,731,200.33 元,业经普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1087 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,770,188.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 38,988.22 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金。

根据《平安沪深 300 指数量化增强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/申购费用而不计提销售服务费的基金份额,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、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《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、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、权证、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于沪深 300 指数成分股及其备选成分股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 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》、《平安沪深 300 指数量化增强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	23,944,530.03
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	23,944,530.03

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	445,310,386.55	502,792,548.27	57,482,161.72
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	5,261,298.44	5,273,733.75
	银行间市场	-	-
	合计	5,261,298.44	5,273,733.75
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	450,571,684.99	508,066,282.02	57,494,597.03

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	4,976.71
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	65.07
应收债券利息	103,103.01
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	29.25
合计	108,174.04

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	124,840.73
银行间市场应付交易费用	-
合计	124,840.73

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	567.93
应付证券出借违约金	-
预提费用	359,260.15
合计	359,828.08

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安沪深 300 指数量化增强 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	110,122,704.97	110,122,704.97
本期申购	87,610,378.45	87,610,378.45
本期赎回（以“-”号填列）	-35,713,178.31	-35,713,178.31
-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	162,019,905.11	162,019,905.11
-----	----------------	----------------

平安沪深 300 指数量化增强 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	125,352,340.27	125,352,340.27
本期申购	104,835,948.14	104,835,948.14
本期赎回 (以“-”号填列)	-41,794,463.08	-41,794,463.08
-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	188,393,825.33	188,393,825.33

6.4.7.10 未分配利润

单位: 人民币元

平安沪深 300 指数量化增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	729,503.13	47,744,242.64	48,473,745.77
本期利润	7,834,813.56	3,698,421.21	11,533,234.77
本期基金份额 交易产生的变 动数	4,190,144.55	22,021,996.08	26,212,140.63
其中: 基金申 购款	5,696,568.87	38,702,514.46	44,399,083.33
基金赎 回款	-1,506,424.32	-16,680,518.38	-18,186,942.70
本期已分配利 润	-	-	-
本期末	12,754,461.24	73,464,659.93	86,219,121.17

平安沪深 300 指数量化增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-1,775,498.24	53,482,421.88	51,706,923.64
本期利润	10,260,427.61	3,924,658.96	14,185,086.57
本期基金份额 交易产生的变 动数	1,477,932.59	26,636,734.73	28,114,667.32
其中: 基金申 购款	2,033,257.25	43,668,855.31	45,702,112.56
基金赎 回款	-555,324.66	-17,032,120.58	-17,587,445.24
本期已分配利	-	-	-

润			
本期末	9,962,861.96	84,043,815.57	94,006,677.53

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		37,249.84
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		1,550.66
其他		704.25
合计		39,504.75

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		17,885,923.12
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		17,885,923.12

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		76,425,804.36
减：卖出股票成本总额		58,539,881.24
买卖股票差价收入		17,885,923.12

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	245,689.89
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	245,689.89

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	12,073,127.43
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,636,996.71
减：应收利息总额	190,440.83
买卖债券差价收入	245,689.89

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	2,949,412.54
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	2,949,412.54

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	7,623,080.17
股票投资	7,610,644.86
债券投资	12,435.31
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	7,623,080.17

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	73,271.23
基金转换费收入	240.72
合计	73,511.95

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	338,342.20
银行间市场交易费用	-
合计	338,342.20

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	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
合计	189,260.15

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
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“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
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

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1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
平安证券	681,039.00	0.23	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金于本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

注：本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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 (%)
平安证券	484.48	0.23	484.48	0.39
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
-	-	-	-	-

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1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,859,173.41	414,699.52
其中：支付销售机构的客户维护 费	239,357.38	119,916.00

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 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	185,917.32	41,469.94

注：支付基金托管人平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

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

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		
	平安沪深 300 指数量化 增强 A	平安沪深 300 指数量化 增强 C	合计
平安基金		278,831.99	278,831.99
平安银行		99,780.75	99,780.75
平安证券		6,467.95	6,467.95
合计		385,080.69	385,080.69
获得销售服务费的各关联方名称	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销售服务费		
	平安沪深 300 指数量化 增强 A	平安沪深 300 指数量化 增强 C	合计
平安基金		58.95	58.95
平安银行		36,792.76	36,792.76
平安证券		2,714.36	2,714.36
合计		39,566.07	39,566.07

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 0.5% 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 × 0.5% / 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

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

平安沪深 300 指数量化增强 A

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
平安人寿	66,268,389.66	40.9014	-	-

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
平安银行-活期	23,944,530.03	37,249.84	2,434,209.31	17,693.41

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。

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
平安证券股份有限公司	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39
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	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年07月02日	新股锁定	24.60	163.00	381	9,372.60	62,103.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
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	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
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	2021年8	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-

		27 日	月 3 日							
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	232	3,834.96	10,688.24	-
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	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021 年 3 月 18 日	2021 年 9 月 27 日	新股锁定	47.33	251.96	260	12,305.80	65,509.60	-
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	394	3,341.12	8,695.58	-
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	晓鸣股份	2021 年 4 月	2021 年 10	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-

		2 日	月 13 日							
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	1,162	7,982.94	14,025.34	-
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	245	4,468.80	6,931.05	-
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	324	9,162.72	37,490.04	-
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	593	4,993.06	8,064.80	-
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	444	14,749.68	38,850.00	-
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	283	13,750.97	25,580.37	-
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	264	3,904.56	8,070.48	-
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	410	4,961.00	7,908.90	-
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	928	4,584.32	12,110.40	-
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	201	3,760.71	11,581.62	-
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	801	10,044.54	22,339.89	-
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	2021 年 12	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-

		21 日	月 29 日							
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021 年 6 月 23 日	2021 年 12 月 30 日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
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	7,029	58,270.41	58,270.41	-
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	782	6,482.78	6,482.78	-
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	3,789	40,314.96	40,314.96	-
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	421	4,479.44	4,479.44	-
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	-
605162	新中港	2021 年 6 月 29 日	2021 年 7 月 7 日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021 年 6 月	2021 年 7 月	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-

		28 日	月 6 日							
688083	中望软件	2021 年 3 月 4 日	2021 年 9 月 13 日	新股锁定	150.50	524.08	918	138,159.00	481,105.44	-
688087	英科再生	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 9 日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股锁定	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股锁定	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688239	航宇科技	2021 年 6 月 25 日	2021 年 7 月 5 日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
688499	利元亨	2021 年 6 月 23 日	2021 年 7 月 1 日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

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
113049	长汽转债	2021 年 6 月 11 日	2021 年 7 月 8 日	新债未上市	100.00	100.00	40	4,000.00	4,000.00	-
113050	南银转债	2021 年 6 月 17 日	2021 年 7 月 1 日	新债未上市	100.00	100.00	1,190	118,998.44	118,998.44	-
113626	伯特转债	2021 年 6 月 30 日	2021 年 7 月 21 日	新债未上市	100.00	100.00	450	45,000.00	45,000.00	-
123117	健帆	2021	2021	新债未上市	100.00	100.00	117	11,700.00	11,700.00	-

	转债	年 6 月 23 日	年 7 月 12 日	上市						
127037	银轮 转债	2021 年 6 月 7 日	2021 年 07 月 09 日	新债未 上市	100.00	100.00	279	27,900.00	27,900.00	-
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	178	17,800.00	17,800.00	-

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

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 0.05%（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	23,944,530.03	-	-	-	23,944,530.03
结算备付金	161,573.55	-	-	-	161,573.55
存出保证金	72,259.32	-	-	-	72,259.32
交易性金融资产	5,273,733.75	-	-	-502,792,548.27	508,066,282.02
应收利息	-	-	-	108,174.04	108,174.04
应收申购款	-	-	-	232,751.53	232,751.53
资产总计	29,452,096.65	-	-	-503,133,473.84	532,585,570.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	726,398.57	726,398.57
应付管理人报酬	-	-	-	358,574.75	358,574.75
应付托管费	-	-	-	35,857.47	35,857.47
应付证券清算款	-	-	-	228,318.19	228,318.19
应付销售服务费	-	-	-	112,223.21	112,223.21
应付交易费用	-	-	-	124,840.73	124,840.73
应交税费	-	-	-	0.35	0.35

其他负债	-	-	-	359,828.08	359,828.08
负债总计	-	-	-	1,946,041.35	1,946,041.35
利率敏感度缺口	29,452,096.65	-	-	-501,187,432.49	530,639,529.14
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	17,789,775.38	-	-	-	17,789,775.38
结算备付金	5,804.30	-	-	-	5,804.30
存出保证金	104,588.07	-	-	-	104,588.07
交易性金融资产	-	-	-	-319,447,262.41	319,447,262.41
应收利息	-	-	-	1,712.98	1,712.98
应收申购款	-	-	-	141,415.59	141,415.59
应收证券清算款	-	-	-	550,004.58	550,004.58
资产总计	17,900,167.75	-	-	-320,140,395.56	338,040,563.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,702,694.77	1,702,694.77
应付管理人报酬	-	-	-	273,676.29	273,676.29
应付托管费	-	-	-	27,367.60	27,367.60
应付销售服务费	-	-	-	71,781.84	71,781.84
应付交易费用	-	-	-	34,477.63	34,477.63
其他负债	-	-	-	274,850.53	274,850.53
负债总计	-	-	-	2,384,848.66	2,384,848.66
利率敏感度缺口	17,900,167.75	-	-	-317,755,546.90	335,655,714.65

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

假设	除市场利率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	市场利率下降 25 个基点	5.40	-
	市场利率上升 25 个基点	-5.28	-

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 0.99%（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	502,792,548.27	94.75	319,447,262.41	95.17
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	502,792,548.27	94.75	319,447,262.41	95.17

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%	27,946,576.91	16,411,945.12
	沪深 300 指数下降 5%	-27,946,576.91	-16,411,945.12

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	502,792,548.27	94.41
	其中：股票	502,792,548.27	94.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,273,733.75	0.99
	其中：债券	5,273,733.75	0.99
	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	24,106,103.58	4.53
8	其他各项资产	413,184.89	0.08
9	合计	532,585,570.49	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	4,944,703.52	0.93
B	采矿业	7,403,864.00	1.40
C	制造业	253,075,541.94	47.69
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,716,562.00	0.70
E	建筑业	2,947,615.00	0.56
F	批发和零售业	803,999.80	0.15

G	交通运输、仓储和邮政业	10,630,936.20	2.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,186,392.30	2.30
J	金融业	122,478,330.77	23.08
K	房地产业	10,168,093.00	1.92
L	租赁和商务服务业	6,928,704.00	1.31
M	科学研究和技术服务业	6,114,996.09	1.15
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	812,621.00	0.15
Q	卫生和社会工作	9,672,530.00	1.82
R	文化、体育和娱乐业	1,179,920.00	0.22
S	综合	-	-
	合计	453,064,809.62	85.38

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	1,662,161.00	0.31
C	制造业	33,823,141.92	6.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.97
E	建筑业	1,532,837.37	0.29
F	批发和零售业	279,580.90	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	1,798,140.00	0.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,282,360.74	0.24
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	707,298.00	0.13
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	1,761,006.56	0.33
N	水利、环境和公共设施管理业	760,794.68	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	919,809.00	0.17
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,727,738.65	9.37

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	600519	贵州茅台	14,600	30,027,820.00	5.66
2	600036	招商银行	354,081	19,187,649.39	3.62
3	000858	五粮液	52,502	15,639,820.78	2.95
4	601012	隆基股份	167,360	14,868,262.40	2.80
5	000333	美的集团	163,316	11,655,862.92	2.20
6	600276	恒瑞医药	134,528	9,143,868.16	1.72
7	601166	兴业银行	434,000	8,918,700.00	1.68
8	600926	杭州银行	595,000	8,776,250.00	1.65
9	600030	中信证券	339,100	8,457,154.00	1.59
10	300059	东方财富	239,948	7,867,894.92	1.48
11	002142	宁波银行	195,900	7,634,223.00	1.44
12	002475	立讯精密	145,119	6,675,474.00	1.26
13	601601	中国太保	219,478	6,358,277.66	1.20
14	601888	中国中免	21,100	6,332,110.00	1.19
15	601818	光大银行	1,673,200	6,324,696.00	1.19
16	603259	药明康德	39,051	6,114,996.09	1.15
17	000568	泸州老窖	25,300	5,969,282.00	1.12
18	601838	成都银行	469,300	5,931,952.00	1.12
19	002415	海康威视	91,500	5,901,750.00	1.11
20	300122	智飞生物	30,100	5,620,573.00	1.06
21	601009	南京银行	525,500	5,528,260.00	1.04
22	601919	中远海控	180,300	5,506,362.00	1.04

23	601336	新华保险	118,700	5,449,517.00	1.03
24	600809	山西汾酒	10,500	4,704,000.00	0.89
25	601377	兴业证券	474,200	4,580,772.00	0.86
26	000002	万科A	191,800	4,566,758.00	0.86
27	600031	三一重工	156,700	4,555,269.00	0.86
28	002714	牧原股份	74,066	4,504,694.12	0.85
29	601688	华泰证券	267,100	4,220,180.00	0.80
30	601881	中国银河	388,100	4,183,718.00	0.79
31	603501	韦尔股份	12,900	4,153,800.00	0.78
32	002594	比亚迪	16,500	4,141,500.00	0.78
33	600309	万华化学	37,700	4,102,514.00	0.77
34	300014	亿纬锂能	38,551	4,006,605.43	0.76
35	600048	保利地产	328,700	3,957,548.00	0.75
36	000651	格力电器	75,400	3,928,340.00	0.74
37	600346	恒力石化	147,772	3,877,537.28	0.73
38	300015	爱尔眼科	52,600	3,733,548.00	0.70
39	300124	汇川技术	49,600	3,683,296.00	0.69
40	600887	伊利股份	96,600	3,557,778.00	0.67
41	000661	长春高新	9,100	3,521,700.00	0.66
42	000725	京东方A	563,200	3,514,368.00	0.66
43	603986	兆易创新	18,172	3,414,518.80	0.64
44	600958	东方证券	338,200	3,378,618.00	0.64
45	601899	紫金矿业	344,700	3,340,143.00	0.63
46	002352	顺丰控股	49,000	3,317,300.00	0.63
47	603288	海天味业	23,918	3,084,226.10	0.58
48	600900	长江电力	139,000	2,868,960.00	0.54
49	601211	国泰君安	166,200	2,848,668.00	0.54
50	300347	泰格医药	14,000	2,706,200.00	0.51
51	002241	歌尔股份	63,200	2,701,168.00	0.51
52	000708	中信特钢	127,060	2,647,930.40	0.50
53	000157	中联重科	286,400	2,646,336.00	0.50
54	002812	恩捷股份	11,200	2,621,920.00	0.49
55	600436	片仔癀	5,800	2,600,140.00	0.49
56	002460	赣锋锂业	20,600	2,494,454.00	0.47
57	000625	长安汽车	93,000	2,444,040.00	0.46
58	002271	东方雨虹	42,350	2,342,802.00	0.44
59	000063	中兴通讯	70,400	2,339,392.00	0.44
60	601628	中国人寿	68,900	2,335,021.00	0.44
61	603799	华友钴业	20,200	2,306,840.00	0.43
62	600745	闻泰科技	23,700	2,296,530.00	0.43
63	688169	石头科技	1,800	2,269,800.00	0.43
64	000776	广发证券	147,700	2,236,178.00	0.42

65	600763	通策医疗	5,300	2,178,300.00	0.41
66	600570	恒生电子	22,690	2,115,842.50	0.40
67	688036	传音控股	9,804	2,053,938.00	0.39
68	002371	北方华创	7,400	2,052,612.00	0.39
69	600999	招商证券	105,740	2,011,174.80	0.38
70	002311	海大集团	24,200	1,974,720.00	0.37
71	601799	星宇股份	8,200	1,850,904.00	0.35
72	300433	蓝思科技	57,200	1,682,252.00	0.32
73	300274	阳光电源	14,600	1,679,876.00	0.32
74	600585	海螺水泥	40,500	1,662,525.00	0.31
75	600893	航发动力	28,900	1,537,191.00	0.29
76	002410	广联达	22,200	1,514,040.00	0.29
77	002179	中航光电	19,100	1,509,282.00	0.28
78	600845	宝信软件	29,490	1,501,041.00	0.28
79	002129	中环股份	38,700	1,493,820.00	0.28
80	600588	用友网络	44,660	1,485,391.60	0.28
81	601390	中国中铁	276,600	1,449,384.00	0.27
82	002007	华兰生物	38,700	1,419,516.00	0.27
83	600741	华域汽车	52,500	1,379,175.00	0.26
84	002821	凯莱英	3,700	1,378,620.00	0.26
85	601225	陕西煤业	116,100	1,375,785.00	0.26
86	600050	中国联通	318,100	1,374,192.00	0.26
87	002049	紫光国微	8,900	1,372,291.00	0.26
88	601808	中海油服	93,500	1,342,660.00	0.25
89	300529	健帆生物	15,200	1,312,672.00	0.25
90	002050	三花智控	54,610	1,309,547.80	0.25
91	300408	三环集团	30,500	1,293,810.00	0.24
92	000338	潍柴动力	66,800	1,193,716.00	0.22
93	002601	龙佰集团	34,500	1,193,010.00	0.22
94	300413	芒果超媒	17,200	1,179,920.00	0.22
95	600660	福耀玻璃	20,900	1,167,265.00	0.22
96	600584	长电科技	30,800	1,160,544.00	0.22
97	002414	高德红外	41,474	1,143,852.92	0.22
98	002555	三七互娱	47,600	1,143,352.00	0.22
99	600690	海尔智家	44,000	1,140,040.00	0.21
100	601939	建设银行	171,200	1,138,480.00	0.21
101	002001	新和成	38,880	1,115,078.40	0.21
102	600760	中航沈飞	18,200	1,097,460.00	0.21
103	600703	三安光电	34,200	1,096,110.00	0.21
104	000783	长江证券	149,700	1,095,804.00	0.21
105	601668	中国建筑	233,200	1,084,380.00	0.20
106	002236	大华股份	50,800	1,071,880.00	0.20

107	601100	恒立液压	12,400	1,065,408.00	0.20
108	603882	金城医学	6,600	1,054,482.00	0.20
109	002230	科大讯飞	15,400	1,040,732.00	0.20
110	601066	中信建投	33,100	1,040,333.00	0.20
111	601155	新城控股	24,775	1,030,640.00	0.19
112	603899	晨光文具	12,000	1,014,720.00	0.19
113	601398	工商银行	192,800	996,776.00	0.19
114	603369	今世缘	18,300	991,128.00	0.19
115	002841	视源股份	7,900	981,891.00	0.19
116	000100	TCL 科技	128,100	979,965.00	0.18
117	000786	北新建材	24,800	973,400.00	0.18
118	000596	古井贡酒	3,800	910,100.00	0.17
119	600438	通威股份	20,700	895,689.00	0.17
120	600104	上汽集团	40,500	889,785.00	0.17
121	000768	中航西飞	33,500	880,380.00	0.17
122	603993	洛阳钼业	170,300	878,748.00	0.17
123	600886	国投电力	88,200	847,602.00	0.16
124	000876	新希望	56,912	834,899.04	0.16
125	002624	完美世界	34,600	827,286.00	0.16
126	002607	中公教育	38,900	812,621.00	0.15
127	600019	宝钢股份	102,900	786,156.00	0.15
128	300558	贝达药业	7,200	779,328.00	0.15
129	300142	沃森生物	12,300	758,910.00	0.14
130	002493	荣盛石化	43,900	758,153.00	0.14
131	601021	春秋航空	13,300	756,770.00	0.14
132	300136	信维通信	23,600	728,768.00	0.14
133	600183	生益科技	30,100	704,641.00	0.13
134	002602	世纪华通	104,560	671,275.20	0.13
135	600837	海通证券	56,900	654,350.00	0.12
136	300601	康泰生物	4,100	610,900.00	0.12
137	603233	大参林	11,780	602,075.80	0.11
138	600009	上海机场	12,500	601,625.00	0.11
139	002938	鹏鼎控股	16,700	599,196.00	0.11
140	002027	分众传媒	63,400	596,594.00	0.11
141	300450	先导智能	9,620	578,546.80	0.11
142	300628	亿联网络	6,400	536,320.00	0.10
143	002508	老板电器	11,466	533,169.00	0.10
144	688111	金山办公	1,300	513,240.00	0.10
145	603833	欧派家居	3,600	511,056.00	0.10
146	603338	浙江鼎力	8,700	510,603.00	0.10
147	000425	徐工机械	76,100	484,757.00	0.09
148	600015	华夏银行	78,200	484,058.00	0.09

149	600919	江苏银行	67,700	480,670.00	0.09
150	601088	中国神华	23,900	466,528.00	0.09
151	601872	招商轮船	97,160	448,879.20	0.08
152	300498	温氏股份	30,620	440,009.40	0.08
153	000538	云南白药	3,800	439,736.00	0.08
154	002463	沪电股份	27,500	425,425.00	0.08
155	000895	双汇发展	13,100	416,580.00	0.08
156	601186	中国铁建	55,700	413,851.00	0.08
157	002916	深南电路	3,640	404,513.20	0.08
158	603160	汇顶科技	3,000	388,890.00	0.07
159	000166	申万宏源	76,700	358,956.00	0.07
160	603019	中科曙光	12,840	354,512.40	0.07
161	600176	中国巨石	22,101	342,786.51	0.06
162	601633	长城汽车	7,800	340,002.00	0.06
163	000656	金科股份	58,500	338,715.00	0.06
164	603658	安图生物	4,380	331,872.60	0.06
165	688396	华润微	3,100	282,162.00	0.05
166	600383	金地集团	26,800	274,432.00	0.05
167	300595	欧普康视	2,620	271,301.00	0.05
168	600872	中炬高新	6,100	256,322.00	0.05
169	600161	天坛生物	7,400	253,450.00	0.05
170	603806	福斯特	2,400	252,312.00	0.05
171	000860	顺鑫农业	5,900	248,862.00	0.05
172	600989	宝丰能源	17,200	235,296.00	0.04
173	002304	洋河股份	1,000	207,200.00	0.04
174	603939	益丰药房	3,600	201,924.00	0.04
175	600521	华海药业	8,300	173,304.00	0.03
176	603195	公牛集团	700	141,400.00	0.03
177	600143	金发科技	5,000	104,300.00	0.02
178	002157	正邦科技	6,800	81,260.00	0.02
179	300677	英科医疗	200	24,960.00	0.00

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	0.97
2	300782	卓胜微	4,780	2,569,250.00	0.48
3	002459	晶澳科技	49,600	2,430,400.00	0.46
4	601058	赛轮轮胎	155,000	1,548,450.00	0.29
5	601636	旗滨集团	77,000	1,429,120.00	0.27
6	688002	睿创微纳	13,600	1,357,688.00	0.26

7	002568	百润股份	11,996	1,137,100.84	0.21
8	603345	安井食品	4,100	1,041,482.00	0.20
9	000516	国际医学	48,900	919,809.00	0.17
10	600882	妙可蓝多	12,800	893,440.00	0.17
11	600988	赤峰黄金	56,700	849,933.00	0.16
12	603129	春风动力	6,300	781,704.00	0.15
13	688200	华峰测控	1,603	758,747.99	0.14
14	300502	新易盛	24,276	758,625.00	0.14
15	603596	伯特利	20,200	722,150.00	0.14
16	002930	宏川智慧	42,800	700,636.00	0.13
17	002541	鸿路钢构	12,000	700,200.00	0.13
18	688198	佰仁医疗	3,013	686,964.00	0.13
19	002353	杰瑞股份	15,300	683,910.00	0.13
20	688093	世华科技	16,100	640,136.00	0.12
21	688356	键凯科技	1,900	624,150.00	0.12
22	600039	四川路桥	99,400	623,238.00	0.12
23	603713	密尔克卫	5,700	615,486.00	0.12
24	002128	露天煤业	56,900	592,329.00	0.11
25	603686	龙马环卫	38,600	587,106.00	0.11
26	300638	广和通	11,786	550,406.20	0.10
27	601117	中国化学	61,800	541,368.00	0.10
28	000733	振华科技	8,700	531,309.00	0.10
29	300129	泰胜风能	84,500	517,985.00	0.10
30	688083	中望软件	918	481,105.44	0.09
31	002487	大金重工	63,600	475,092.00	0.09
32	688007	光峰科技	11,200	469,056.00	0.09
33	603018	华设集团	57,760	459,192.00	0.09
34	603005	晶方科技	7,740	458,440.20	0.09
35	300759	康龙化成	2,000	433,980.00	0.08
36	002367	康力电梯	47,600	425,544.00	0.08
37	688179	阿拉丁	2,944	412,866.56	0.08
38	603816	顾家家居	5,300	409,584.00	0.08
39	000967	盈峰环境	58,500	401,895.00	0.08
40	002876	三利谱	6,200	401,140.00	0.08
41	001914	招商积余	22,700	389,986.00	0.07
42	300685	艾德生物	3,700	385,096.00	0.07
43	002126	银轮股份	36,300	377,520.00	0.07
44	603444	吉比特	700	371,000.00	0.07
45	603127	昭衍新药	2,000	367,500.00	0.07
46	603218	日月股份	13,000	352,040.00	0.07
47	000090	天健集团	62,000	342,860.00	0.06
48	603027	千禾味业	12,240	321,789.60	0.06
49	000961	中南建设	53,600	317,312.00	0.06

50	688161	威高骨科	2,885	305,954.25	0.06
51	600563	法拉电子	1,900	300,884.00	0.06
52	300702	天宇股份	8,260	292,569.20	0.06
53	688981	中芯国际	4,300	265,826.00	0.05
54	002677	浙江美大	14,000	255,920.00	0.05
55	301015	百洋医药	4,614	251,115.78	0.05
56	600742	一汽富维	24,400	248,636.00	0.05
57	002080	中材科技	8,400	219,828.00	0.04
58	002242	九阳股份	6,600	214,434.00	0.04
59	300750	宁德时代	400	213,920.00	0.04
60	603179	新泉股份	6,300	207,144.00	0.04
61	600323	瀚蓝环境	9,300	202,647.00	0.04
62	601615	明阳智能	12,300	199,137.00	0.04
63	002439	启明星辰	6,809	197,529.09	0.04
64	600201	生物股份	11,300	197,185.00	0.04
65	600720	祁连山	18,100	190,774.00	0.04
66	300841	康华生物	700	188,160.00	0.04
67	603313	梦百合	6,200	186,310.00	0.04
68	688345	博力威	2,532	186,228.60	0.04
69	002025	航天电器	3,700	185,629.00	0.03
70	002019	亿帆医药	10,700	184,575.00	0.03
71	600004	白云机场	16,500	184,470.00	0.03
72	601666	平煤股份	25,900	184,149.00	0.03
73	688516	奥特维	1,172	173,456.00	0.03
74	300888	稳健医疗	1,400	173,068.00	0.03
75	603416	信捷电气	2,600	165,022.00	0.03
76	688667	菱电电控	1,500	165,015.00	0.03
77	002385	大北农	23,700	161,160.00	0.03
78	688578	艾力斯	4,882	160,959.54	0.03
79	603128	华贸物流	10,800	152,172.00	0.03
80	300582	英飞特	6,500	151,710.00	0.03
81	601865	福莱特	3,700	146,261.00	0.03
82	600026	中远海能	23,600	145,376.00	0.03
83	002106	莱宝高科	12,400	139,500.00	0.03
84	603317	天味食品	4,740	139,498.20	0.03
85	002705	新宝股份	5,000	131,250.00	0.02
86	002859	洁美科技	4,100	128,207.00	0.02
87	300815	玉禾田	3,600	125,388.00	0.02
88	002013	中航机电	12,400	124,868.00	0.02
89	300037	新宙邦	1,200	120,120.00	0.02
90	000550	江铃汽车	5,100	119,493.00	0.02
91	300724	捷佳伟创	1,000	116,010.00	0.02
92	603267	鸿远电子	900	115,128.00	0.02

93	600761	安徽合力	10,300	113,918.00	0.02
94	002706	良信股份	4,800	108,192.00	0.02
95	605288	凯迪股份	1,000	104,480.00	0.02
96	688408	中信博	500	100,400.00	0.02
97	000049	德赛电池	2,100	96,390.00	0.02
98	688621	阳光诺和	985	87,468.00	0.02
99	002078	太阳纸业	6,400	85,440.00	0.02
100	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
101	603678	火炬电子	1,200	81,000.00	0.02
102	688221	前沿生物	3,802	80,298.24	0.02
103	002605	姚记科技	3,300	72,171.00	0.01
104	002233	塔牌集团	6,800	69,904.00	0.01
105	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.01
106	600060	海信视像	4,000	67,600.00	0.01
107	300957	贝泰妮	260	65,509.60	0.01
108	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
109	300496	中科创达	400	62,824.00	0.01
110	300919	中伟股份	381	62,103.00	0.01
111	688386	泛亚微透	1,017	59,748.75	0.01
112	603529	爱玛科技	1,019	59,224.28	0.01
113	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
114	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
115	601966	玲珑轮胎	1,200	52,488.00	0.01
116	002957	科瑞技术	2,000	50,920.00	0.01
117	002912	中新赛克	1,100	45,067.00	0.01
118	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
119	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
120	300979	华利集团	444	38,850.00	0.01
121	002318	久立特材	3,200	38,464.00	0.01
122	300973	立高食品	324	37,490.04	0.01
123	601689	拓普集团	1,000	37,430.00	0.01
124	605009	豪悦护理	500	36,185.00	0.01
125	601898	中煤能源	5,000	35,750.00	0.01
126	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
127	600380	健康元	2,000	27,460.00	0.01
128	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
129	300981	中红医疗	283	25,580.37	0.00
130	600066	宇通客车	2,000	24,980.00	0.00
131	603688	石英股份	1,000	23,500.00	0.00
132	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
133	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
134	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
135	000997	新大陆	1,000	16,590.00	0.00

136	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
137	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
138	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
139	300394	天孚通信	540	13,672.80	0.00
140	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
141	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
142	002959	小熊电器	200	13,288.00	0.00
143	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
144	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
145	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
146	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
147	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
148	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
149	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
150	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
151	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
152	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
153	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
154	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
155	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
156	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
157	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
158	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
159	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
160	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
161	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
162	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
163	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
164	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
165	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
166	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
167	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
168	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
169	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
170	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
171	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
172	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
173	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
174	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
175	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
176	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
177	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
178	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00

179	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	600519	贵州茅台	14,171,773.48	4.22
2	600036	招商银行	7,454,198.00	2.22
3	000858	五粮液	6,016,164.00	1.79
4	000333	美的集团	5,150,236.00	1.53
5	601012	隆基股份	5,141,876.00	1.53
6	601166	兴业银行	3,905,762.00	1.16
7	002415	海康威视	3,749,015.00	1.12
8	601601	中国太保	3,719,729.66	1.11
9	601888	中国中免	3,659,590.00	1.09
10	600030	中信证券	3,627,573.00	1.08
11	600276	恒瑞医药	3,569,974.00	1.06
12	600926	杭州银行	3,550,820.20	1.06
13	600905	三峡能源	3,436,527.95	1.02
14	002142	宁波银行	3,128,350.00	0.93
15	300059	东方财富	2,677,398.00	0.80
16	002475	立讯精密	2,552,290.00	0.76
17	603259	药明康德	2,409,115.80	0.72
18	600031	三一重工	2,393,526.00	0.71
19	000725	京东方 A	2,276,135.00	0.68
20	000568	泸州老窖	2,229,462.00	0.66

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	600519	贵州茅台	2,281,700.90	0.68
2	600905	三峡能源	1,781,363.60	0.53
3	601211	国泰君安	1,630,007.00	0.49
4	600036	招商银行	1,394,843.00	0.42
5	000333	美的集团	1,272,817.00	0.38
6	000858	五粮液	1,215,969.00	0.36
7	601012	隆基股份	1,095,184.00	0.33
8	601336	新华保险	1,077,260.00	0.32
9	603606	东方电缆	996,084.09	0.30
10	600276	恒瑞医药	974,028.97	0.29
11	600926	杭州银行	927,104.00	0.28

12	600346	恒力石化	885,840.00	0.26
13	601881	中国银河	744,707.00	0.22
14	600030	中信证券	720,798.00	0.21
15	688131	皓元医药	621,495.62	0.19
16	000708	中信特钢	615,514.00	0.18
17	002142	宁波银行	608,870.00	0.18
18	000425	徐工机械	608,666.00	0.18
19	603659	璞泰来	568,690.00	0.17
20	300171	东富龙	556,505.00	0.17

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	234,274,522.24
卖出股票收入（成交）总额	76,425,804.36

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	5,000,000.00	0.94
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）	273,733.75	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,273,733.75	0.99

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	019640	20 国债 10	50,000	5,000,000.00	0.94
2	113050	南银转债	1,190	118,998.44	0.02
3	127036	三花转债	369	48,335.31	0.01
4	113626	伯特转债	450	45,000.00	0.01
5	127037	银轮转债	279	27,900.00	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

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

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

定给予警告，没收违法所得 10,875,088.15 元，并处 13,824,431.23 元罚款。

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日作出银保监罚决字（2021）16 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等违规经营。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，对公司罚款 7170 万元。

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本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	72,259.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	108,174.04
5	应收申购款	232,751.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	413,184.89

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：持有股票但前十名不存在受限流通情况。

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	0.97	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 (%)
平安沪深 300 指数量化增强 A	2,994	54,114.86	143,260,050.91	88.42	18,759,854.20	11.58
平安沪深 300 指数量化增强 C	3,318	56,779.33	152,799,933.39	81.11	35,593,891.94	18.89
合	6,226	56,282.32	296,059,984.30	84.49	54,353,746.14	15.51

计					
---	--	--	--	--	--

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	平安沪深 300 指数量化增强 A	3,661.65	0.0023
	平安沪深 300 指数量化增强 C	3,103.24	0.0016
	合计	6,764.89	0.0019

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	平安沪深 300 指数量化增强 A	0
	平安沪深 300 指数量化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	平安沪深 300 指数量化增强 A	0
	平安沪深 300 指数量化增强 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 26 日）基金份额总额	126,189,116.16	84,581,072.39
本报告期期初基金份额总额	110,122,704.97	125,352,340.27
本报告期基金总申购份额	87,610,378.45	104,835,948.14
减：本报告期基金	35,713,178.31	41,794,463.08

总赎回份额		
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	162,019,905.11	188,393,825.33

§ 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。

2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

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	

国泰君安 证券	1	98,026,648.40	32.67%	69,725.98	32.64%	-
东吴证券	2	80,423,774.65	26.80%	57,205.57	26.77%	-
光大证券	2	21,497,436.62	7.16%	15,291.07	7.16%	-
海通证券	2	19,323,436.91	6.44%	13,744.73	6.43%	-
国盛证券	1	18,073,775.46	6.02%	12,855.98	6.02%	-
恒泰证券	2	11,846,976.10	3.95%	8,663.51	4.05%	-
华创证券	2	11,363,124.35	3.79%	8,082.65	3.78%	-
兴业证券	1	11,285,130.68	3.76%	8,026.92	3.76%	-
长江证券	1	11,136,269.84	3.71%	7,921.22	3.71%	-
方正证券	2	4,522,945.83	1.51%	3,217.20	1.51%	-
中信证券	3	3,609,235.02	1.20%	2,567.22	1.20%	-
中泰证券	1	2,859,093.87	0.95%	2,033.71	0.95%	-
安信证券	1	2,800,034.46	0.93%	1,991.75	0.93%	-
申万宏源 证券	2	1,585,757.94	0.53%	1,127.95	0.53%	-
平安证券	4	681,039.00	0.23%	484.48	0.23%	-
天风证券	2	386,435.75	0.13%	274.83	0.13%	-
国信证券	2	382,387.51	0.13%	272.00	0.13%	-
东北证券	3	233,565.29	0.08%	166.16	0.08%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	新增

						1 个
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
中银国际 证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国泰君安证券	5,042,266.70	18.76%	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,747,408.71	6.50%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	2,000,200.00	7.44%	-	-	-	-
华创证券	8,001,600.00	29.76%	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	90,191.74	0.34%	-	-	-	-
安信证券	10,002,000.00	37.20%	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-

世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 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	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 21 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
6	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 30 日
7	平安沪深 300 指数量化增强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
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	平安沪深 300 指数量化增强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
10	平安沪深 300 指数量化增强证券投	中国证监会规定报刊及	2021 年 03 月 31 日

	资基金招募说明书更新	网站	
11	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海中欧财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 04 月 09 日
12	平安基金管理有限公司关于调整旗下部分基金申购、赎回、转换、定期定额投资起点及账户最低持有份额下限的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 15 日
13	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 22 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增腾安基金销售（深圳）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 05 月 21 日
15	平安沪深 300 指数量化增强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
16	平安沪深 300 指数量化增强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
17	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
18	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
19	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
20	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
21	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
22	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
23	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 30 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) 中国证监会准予平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同
- (3) 平安沪深 300 指数量化增强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 31 日