

平安中证 500 交易型开放式指数证券投资  
基金  
2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 22 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 21 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 2019 年 1 月 1 日起至 6 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>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>42</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	59
7.7 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.....	59
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	59
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.....	59
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	60
7.12 投资组合报告附注.....	60
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>62</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	62
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	63
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	63
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>64</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>65</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
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.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65

10.8 其他重大事件.....	69
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>70</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 .....	70
<b>备查文件目录.....</b>	<b>71</b>
11.2 备查文件目录.....	71
11.3 存放地点.....	71
11.4 查阅方式.....	71

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 500ETF
场内简称	平安 500
基金主代码	510590
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 23 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	443,186,121.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018-05-04

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAISHUAI130@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	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	-54,256,468.22
本期利润	303,888,739.62
加权平均基金份额本期利润	0.7654
本期加权平均净值利润率	15.04%
本期基金份额净值增长率	19.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	-409,827,304.14
期末可供分配基金份额利润	-0.9247
期末基金资产净值	2,246,240,043.94
期末基金份额净值	5.0684
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-15.43%

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

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

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.91%	1.40%	0.78%	1.39%	0.13%	0.01%
过去三个月	-10.34%	1.82%	-10.76%	1.81%	0.42%	0.01%
过去六个月	19.10%	1.79%	18.77%	1.79%	0.33%	0.00%
过去一年	-3.96%	1.69%	-5.12%	1.69%	1.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	-15.43%	1.61%	-18.86%	1.65%	3.43%	-0.04%

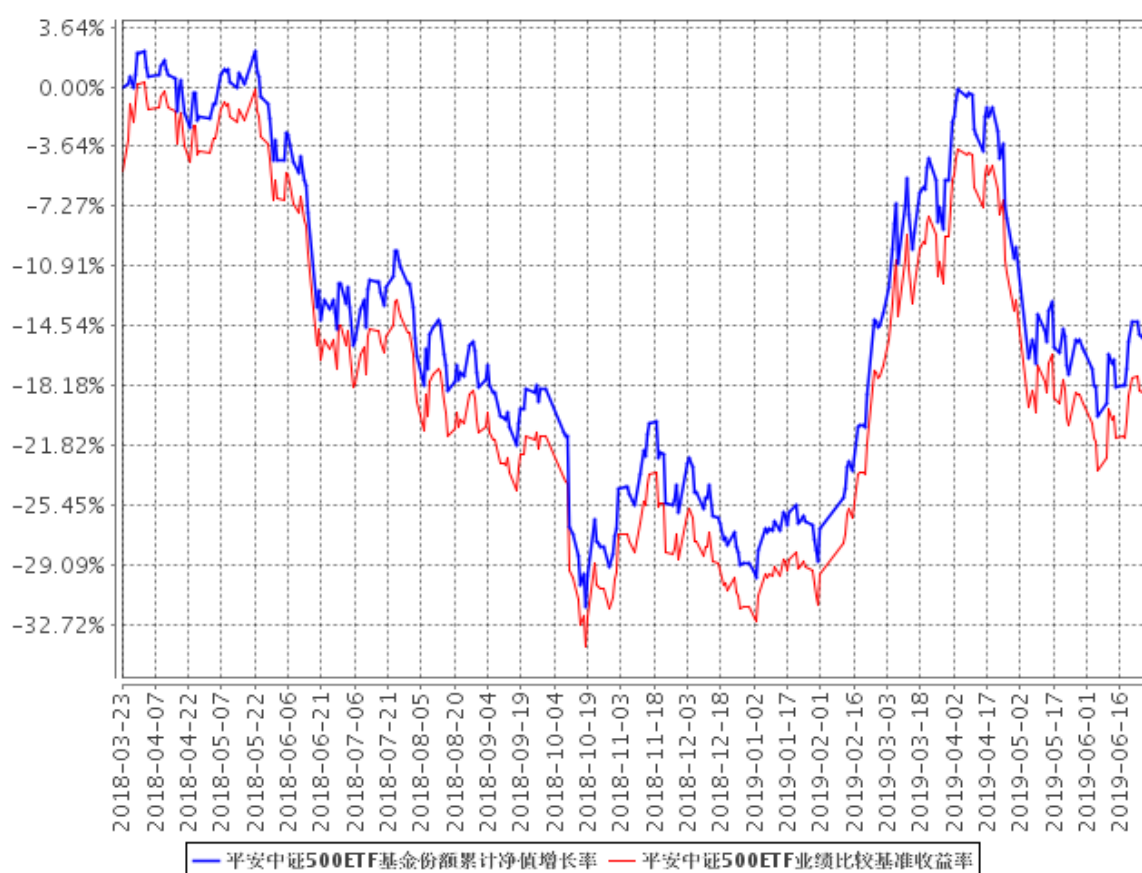


注：1、业绩比较基准：中证 500 指数收益率。其中，中证 500 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，是剔除沪深 300 成分股后，按日均成交额和股票市值大小排序后筛选的股票，是小盘股的代表，能够反映 A 股市场小盘股总体发展趋势。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

### 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500ETF基金份额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



- 1、本基金基金合同于 2018 年 3 月 23 日正式生效，截至报告期末已满一年；
- 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

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。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股份 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股份 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 14.3%。

平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富的客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2019 年 6 月 30 日，平安基金共管理 83 只公募基金，公募基金管理总规模 2877 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
成钧	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理、ETF 指数中心指数投资总监	2018 年 3 月 23 日	-	8	成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数中心指数投资总监。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交

					易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
刘洁倩	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（助理）	2018 年 10 月 16 日	-	6	刘洁倩女士，浙江大学数学专业博士，曾担任国泰基金管理有限公司产品研究主管。2018 年 8 月加入平安基金管理有限公司，现任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究员。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。
万纯	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（助理）	2018 年 7 月 20 日	2019 年 4 月 11 日	6	万纯，北京大学硕士，曾担任中国证券登记结算有限责任公司上海分公司基金业务经办岗。2017 年 7 月加入平安基金管理有限公司，任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究员。曾担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI

					中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。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连续四个季度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

作为一只投资于中证 500 指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

报告期内，本基金的日均偏离度为 0.002%，年化跟踪误差 0.52%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2%的投资目标。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 5.0684 元，份额累计净值为 0.8457 元；本报告期基金份额净值增长率为 19.10%，业绩比较基准收益率为 18.77%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初以来，在较为宽松的资金面和中美经贸关系缓和的背景下，市场风险偏好持续改善，叠加外资入场，推动市场估值水平持续修复，并走出了一轮强势的上涨行情。但是，4 月中旬以来，中美经贸关系骤然紧张，导致市场风险偏好迅速下降，股票市场整体表现也相应调整。展望下半年，国内经济增长动能趋弱，企业盈利情况大幅改善的概率不大，但长期来看，消费与产业升级的趋势依然具有较高的确定性。

作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

本基金本报告期末出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	8,706,484.14	8,961,382.14
结算备付金		23,502,612.69	4,712,707.86
存出保证金		4,093,999.82	3,234,511.30
交易性金融资产	6.4.7.2	2,216,642,518.06	1,642,862,051.03
其中：股票投资		2,216,642,518.06	1,642,862,051.03
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		511,959.02	3,982,445.17
应收利息	6.4.7.5	20,202.35	3,949.17
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	193,684.37	664,587.43
资产总计		2,253,671,460.45	1,664,421,634.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 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		-	-
应付管理人报酬		862,473.50	725,025.08
应付托管费		172,494.71	145,005.02
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	913,933.44	618,674.99



应交税费		11,598.55	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	5,470,916.31	1,663,089.65
负债合计		7,431,416.51	3,151,794.74
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	2,656,067,348.08	2,339,630,642.62
未分配利润	6.4.7.10	-409,827,304.14	-678,360,803.26
所有者权益合计		2,246,240,043.94	1,661,269,839.36
负债和所有者权益总计		2,253,671,460.45	1,664,421,634.10

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 5.0684 元，基金份额总额 443,186,121.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 3 月 23 日(基金 合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		312,544,556.59	-241,014,197.14
1.利息收入		198,472.99	1,866,457.86
其中：存款利息收入	6.4.7.11	138,878.17	619,200.01
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59,594.82	1,247,257.85
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-45,543,799.79	-2,844,208.21
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-66,804,472.78	-16,875,530.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	2,258,195.33	-24,800.00
股利收益	6.4.7.16	19,002,477.66	14,056,122.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	358,145,207.84	-240,419,245.19
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	-255,324.45	382,798.40

列)			
<b>减：二、费用</b>		8,655,816.97	7,636,228.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	4,989,111.18	3,182,328.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	997,822.30	636,465.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,092,902.31	3,515,480.04
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		8,129.51	-
7. 其他费用	6.4.7.20	567,851.67	301,954.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		303,888,739.62	-248,650,425.38
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		303,888,739.62	-248,650,425.38

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	2,339,630,642.62	-678,360,803.26	1,661,269,839.36
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	303,888,739.62	303,888,739.62
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）	316,436,705.46	-35,355,240.50	281,081,464.96
其中：1. 基金申购款	1,018,830,301.48	-147,748,905.76	871,081,395.72
2. 基金赎回款	-702,393,596.02	112,393,665.26	-589,999,930.76
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）	2,656,067,348.08	-409,827,304.14	2,246,240,043.94
项目	上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)至2018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）	2,648,875,604.00	-	2,648,875,604.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-248,650,425.38	-248,650,425.38
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）	-563,353,225.02	-281,262.37	-563,634,487.39
其中：1. 基金申购款	74,314,680.79	-8,790,862.41	65,523,818.38
2. 基金赎回款	-637,667,905.81	8,509,600.04	-629,158,305.77
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）	2,085,522,378.98	-248,931,687.75	1,836,590,691.23

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

平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]112 号《关于准予平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商

变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 2,648,533,409.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0175 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,648,875,604.00 份,其中认购资金利息折合 342,195.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]41 号审核同意,本基金 441,986,121.00 份基金份额于 2018 年 5 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证 500 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股和备选成份股;此外,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以在履行适程序后,参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人平安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“平安 500 ETF 联接基金”)。平安 500 ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 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<年度报告和半年度报告>》、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 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

### 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[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费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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	8,706,484.14
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	—

合计:	8,706,484.14
-----	--------------

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,288,577,576.79	2,216,642,518.06	-71,935,058.73
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,288,577,576.79	2,216,642,518.06	-71,935,058.73

注：于 2019 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 -479.00。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	24,062,861.19	-	-	
IC1909	24,062,861.19	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	24,062,861.19	-	-	

注：衍生金融资产项下的股指期货投资净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间抵销后的净额为 0。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC1909	IC1909	26	25,030,720.00	967,858.81
减: 可抵销期货暂收款				967,858.81
股指期货投资净额				-

#### 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

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

本基金于本期末未持有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 2019年6月30日
应收活期存款利息	2,757.27
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	17,307.65
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	137.43
合计	20,202.35

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	193,684.37
合计	193,684.37



## 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	913,933.44
银行间市场应付交易费用	-
合计	913,933.44

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
现金差额	430,944.44
可退替代款	3,843.10
应付替代款	4,713,610.21
预提费用	322,518.56
合计	5,470,916.31

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	390,386,121.00	2,339,630,642.62
本期申购	170,000,000.00	1,018,830,301.48
本期赎回(以“-”号填列)	-117,200,000.00	-702,393,596.02
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	443,186,121.00	2,656,067,348.08

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

**6.4.7.10 未分配利润**

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-198,907,936.57	-479,452,866.69	-678,360,803.26
本期利润	-54,256,468.22	358,145,207.84	303,888,739.62
本期基金份额交易产生的变动数	-31,818,632.01	-3,536,608.49	-35,355,240.50
其中：基金申购款	-100,254,162.57	-47,494,743.19	-147,748,905.76
基金赎回款	68,435,530.56	43,958,134.70	112,393,665.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-284,983,036.80	-124,844,267.34	-409,827,304.14

**6.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	35,385.11
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	100,870.34
其他	2,622.72
合计	138,878.17

**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 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-56,920,031.00
股票投资收益——赎回差价收入	-9,884,441.78
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	-66,804,472.78

**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 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	738,286,108.89
减：卖出股票成本总额	795,206,139.89
买卖股票差价收入	-56,920,031.00

**6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	589,999,930.76
减：现金支付赎回款总额	308,899,094.76
减：赎回股票成本总额	290,985,277.78
赎回差价收入	-9,884,441.78

**6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无股票投资产生的申购价差收入。

**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**

本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期无债券投资收益。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金于本期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**

本基金于本期无贵金属投资。

**6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金于本期无贵金属投资。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金于本期无贵金属投资。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金于本期无贵金属投资。

**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**

本基金于本期无买卖权证价差收入。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2019年1月1日至2019年6月30日
国债期货投资收益	-
股指期货-投资收益	2,258,195.33

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	19,002,477.66
基金投资产生的股利收益	-
合计	19,002,477.66

## 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	356,015,989.03
——股票投资	356,015,989.03
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	2,129,218.81
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	358,145,207.84

注：本基金本报告期公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为-479.00。

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-255,324.45
合计	-255,324.45

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,092,902.31
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,092,902.31

### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	48,596.69
信息披露费	59,044.72
登记结算费	106,315.63
上市费	29,752.78
IOPV 计算费	24,795.19
指数使用费	299,346.66
合计	567,851.67

### 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	基金管理人
平安银行股份有限公司	基金托管人
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构

中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
中国平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)至 2018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	643,342,479.83	37.95%	2,125,293,838.84	59.31%

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)至 2018年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
平安证券	4,000,000.00	0.67%	4,987,000,000.00	83.30%

##### 6.4.10.1.4 权证交易

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 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
平安证券	457,616.80	37.95%	195,497.79	21.39%
关联方名称	上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)至2018年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金总 额的比例
平安证券	1,511,751.74	59.31%	444,415.47	54.67%

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 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
	当期发生的基金应支付 的管理费	4,989,111.18
其中：支付销售机构的客 户维护费	-	-

注：支付基金管理人平安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日的基金资产净值的 0.5%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：

日管理人报酬=前一日的基金资产净值×0.5%/当年天数。



**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 3 月 23 日(基金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	997,822.30	636,465.68

注：支付基金托管人平安银行股份有限公司的基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算方式为：

日托管费=前一日的基金资产净值×0.1%/当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

无

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金于本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 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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
中国平安人寿保险股份有限公司	300,620,901.00	67.8318%	300,620,901.00	77.0060%
平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	87,537,790.00	19.7519%	14,214,462.00	3.6411%

**6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年3月23日(基金合同生效日)至 2018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	8,706,484.14	35,385.11	8,706,089.82	436,871.58

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

本基金于本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****6.4.11.1**

本基金本报告期内未进行利润分配。

**6.4.12 期末（2019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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

**6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时流通受限的股票。

### 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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金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

截至本报告期末 2019 年 6 月 30 日止，本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

#### **6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

本基金所持大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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2019 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中

度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.00253%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 2,225,292,025.66 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

#### **6.4.13.4 市场风险**

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,706,484.14	-	-	-	-	-	8,706,484.14
结算备付金	23,502,612.69	-	-	-	-	-	23,502,612.69
存出保证金	339,391.82	-	-	-	-	3,754,608.00	4,093,999.82
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,216,642,518.06	2,216,642,518.06
应收利息	-	-	-	-	-	20,202.35	20,202.35
应收证券清算款	-	-	-	-	-	511,959.02	511,959.02
其他资产	-	-	-	-	-	193,684.37	193,684.37
资产总计	32,548,488.65	-	-	-	-	2,221,122,971.80	2,253,671,460.45
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	862,473.50	862,473.50
应付托管费	-	-	-	-	-	172,494.71	172,494.71
应付交易费用	-	-	-	-	-	913,933.44	913,933.44
应交税费	-	-	-	-	-	11,598.55	11,598.55
其他负债	-	-	-	-	-	5,470,916.31	5,470,916.31
负债总计	-	-	-	-	-	7,431,416.51	7,431,416.51
利率敏感度缺口	32,548,488.65	-	-	-	-	-2,213,691,555.29	2,246,240,043.94
上年度末 2018年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	8,961,382.14	-	-	-	-	-	8,961,382.14
结算备付金	4,712,707.86	-	-	-	-	-	4,712,707.86
存出保证金	290,431.30	-	-	-	-	2,944,080.00	3,234,511.30

交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,642,862,051.03	1,642,862,051.03
应收证券清算款	-	-	-	-	-	3,982,445.17	3,982,445.17
应收利息	-	-	-	-	-	3,949.17	3,949.17
其他资产	-	-	-	-	-	664,587.43	664,587.43
资产总计	13,964,521.30	-	-	-	-	1,650,457,112.80	1,664,421,634.10
负债	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	725,025.08	725,025.08
应付托管费	-	-	-	-	-	145,005.02	145,005.02
应付交易费用	-	-	-	-	-	618,674.99	618,674.99
其他负债	-	-	-	-	-	1,663,089.65	1,663,089.65
负债总计	-	-	-	-	-	3,151,794.74	3,151,794.74
利率敏感度缺口	13,964,521.30	-	-	-	-	-1,647,305,318.06	1,661,269,839.36

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券(2018 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：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。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。本基金投资于中证 500 指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履

行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度（剔除成份股分红因素）的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,216,642,518.06	98.68	1,642,862,051.03	98.89
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	2,216,642,518.06	98.68	1,642,862,051.03	98.89

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	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（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	136,728,990.92	94,405,480.34
业绩比较基准减少 5%	-136,728,990.92	-94,405,480.34	

本基金业绩比较基准为中证 500 指数收益率



#### **6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

##### 6.4.14.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	2,216,642,518.06	98.36
	其中：股票	2,216,642,518.06	98.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	32,209,096.83	1.43
8	其他各项资产	4,819,845.56	0.21
9	合计	2,253,671,460.45	100.00

投资组合报表中股票投资市值与按行业分类股票投资组合报表中股票总市值之间的差异是由于可退替代款估值增值引起的。

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	24,578,381.00	1.09
B	采矿业	78,480,635.98	3.49
C	制造业	1,235,541,764.72	55.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,425,711.08	3.14
E	建筑业	39,548,199.68	1.76
F	批发和零售业	117,887,068.20	5.25
G	交通运输、仓储和邮政业	74,847,576.91	3.33
H	住宿和餐饮业	8,545,908.32	0.38
I	信息传输、软件和信息技术服务业	212,663,005.24	9.47

J	金融业	99,855,616.10	4.45
K	房地产业	102,750,599.30	4.57
L	租赁和商务服务业	30,547,990.99	1.36
M	科学研究和技术服务业	3,133,110.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	19,723,301.40	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	7,487,066.80	0.33
Q	卫生和社会工作	13,460,271.00	0.60
R	文化、体育和娱乐业	46,340,201.36	2.06
S	综合	30,189,670.15	1.34
	合计	2,216,006,078.23	98.65

### 7.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	采掘业	363,431.25	0.02
C	制造业	176,907.28	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,603.76	0.00
J	金融业	33,869.94	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	23,106.60	0.00
S	综合	-	-
	合计	636,918.83	0.03

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	占基金资产净值比例（%）
1	002405	四维图新	912,000	14,683,200.00	0.65
2	000860	顺鑫农业	302,086	14,092,311.90	0.63
3	600872	中炬高新	320,200	13,714,166.00	0.61
4	002157	正邦科技	687,600	11,455,416.00	0.51
5	002049	紫光国微	246,100	10,855,471.00	0.48
6	300253	卫宁健康	752,800	10,674,704.00	0.48
7	000066	中国长城	1,023,500	10,521,580.00	0.47
8	600201	生物股份	669,930	10,511,201.70	0.47
9	002195	二三四五	2,668,408	10,380,107.12	0.46
10	300450	先导智能	307,500	10,332,000.00	0.46
11	600739	辽宁成大	709,700	10,319,038.00	0.46
12	600763	通策医疗	110,500	9,789,195.00	0.44
13	600426	华鲁恒升	658,300	9,782,338.00	0.44
14	002507	涪陵榨菜	320,700	9,781,350.00	0.44
15	002506	协鑫集成	1,463,900	9,778,852.00	0.44
16	002439	启明星辰	361,600	9,727,040.00	0.43
17	002127	南极电商	855,100	9,611,324.00	0.43
18	000401	冀东水泥	545,600	9,608,016.00	0.43
19	600642	申能股份	1,576,200	9,472,962.00	0.42
20	002129	中环股份	968,000	9,447,680.00	0.42
21	002463	沪电股份	693,300	9,442,746.00	0.42
22	600183	生益科技	616,532	9,278,806.60	0.41
23	600536	中国软件	172,700	9,268,809.00	0.41
24	600895	张江高科	446,700	9,166,284.00	0.41
25	002340	格林美	1,925,800	9,070,518.00	0.40
26	000975	银泰资源	687,594	9,069,364.86	0.40
27	600298	安琪酵母	285,462	9,029,163.06	0.40
28	300383	光环新网	535,500	8,980,335.00	0.40

29	002465	海格通信	936,300	8,932,302.00	0.40
30	000623	吉林敖东	538,600	8,827,654.00	0.39
31	000750	国海证券	1,709,800	8,600,294.00	0.38
32	002223	鱼跃医疗	346,798	8,538,166.76	0.38
33	002268	卫士通	338,400	8,273,880.00	0.37
34	603369	今世缘	291,200	8,121,568.00	0.36
35	002384	东山精密	556,376	8,106,398.32	0.36
36	600801	华新水泥	396,780	8,034,795.00	0.36
37	002926	华西证券	761,400	7,994,700.00	0.36
38	002075	沙钢股份	1,018,000	7,981,120.00	0.36
39	002500	山西证券	982,600	7,959,060.00	0.35
40	002821	凯莱英	80,700	7,915,056.00	0.35
41	002385	大北农	1,473,500	7,794,815.00	0.35
42	600879	航天电子	1,262,000	7,773,920.00	0.35
43	000998	隆平高科	532,400	7,709,152.00	0.34
44	002797	第一创业	1,214,700	7,701,198.00	0.34
45	600161	天坛生物	303,208	7,656,002.00	0.34
46	600325	华发股份	979,300	7,648,333.00	0.34
47	600460	士兰微	453,703	7,531,469.80	0.34
48	600497	驰宏锌锗	1,472,200	7,478,776.00	0.33
49	600528	中铁工业	643,920	7,450,154.40	0.33
50	000723	美锦能源	710,500	7,424,725.00	0.33
51	002371	北方华创	106,300	7,361,275.00	0.33
52	601128	常熟银行	953,500	7,361,020.00	0.33
53	002373	千方科技	430,040	7,353,684.00	0.33
54	000988	华工科技	464,400	7,346,808.00	0.33
55	600745	闻泰科技	221,067	7,343,845.74	0.33
56	002299	圣农发展	289,200	7,322,544.00	0.33
57	600848	上海临港	233,700	7,275,081.00	0.32
58	600779	水井坊	141,500	7,191,030.00	0.32
59	000778	新兴铸管	1,615,100	7,171,044.00	0.32
60	600584	长电科技	555,800	7,142,030.00	0.32
61	000997	新大陆	422,600	7,137,714.00	0.32
62	000686	东北证券	809,400	7,130,814.00	0.32
63	000009	中国宝安	1,239,765	7,079,058.15	0.32
64	600699	均胜电子	329,600	7,040,256.00	0.31
65	601168	西部矿业	1,101,800	7,029,484.00	0.31
66	600549	厦门钨业	491,100	7,027,641.00	0.31
67	002572	索菲亚	375,400	6,967,424.00	0.31

68	002092	中泰化学	870,000	6,925,200.00	0.31
69	600572	康恩贝	1,081,700	6,922,880.00	0.31
70	600820	隧道股份	1,091,000	6,884,210.00	0.31
71	600909	华安证券	1,049,300	6,862,422.00	0.31
72	600673	东阳光	872,800	6,851,480.00	0.31
73	600410	华胜天成	638,173	6,847,596.29	0.30
74	601005	重庆钢铁	3,390,600	6,815,106.00	0.30
75	600875	东方电气	636,700	6,761,754.00	0.30
76	600392	盛和资源	611,310	6,761,088.60	0.30
77	000060	中金岭南	1,441,400	6,760,166.00	0.30
78	300168	万达信息	514,400	6,671,768.00	0.30
79	600376	首开股份	746,500	6,666,245.00	0.30
80	000999	华润三九	226,200	6,636,708.00	0.30
81	000039	中集集团	618,120	6,601,521.60	0.29
82	600718	东软集团	506,379	6,491,778.78	0.29
83	000690	宝新能源	1,005,200	6,473,488.00	0.29
84	002353	杰瑞股份	279,898	6,465,643.80	0.29
85	000960	锡业股份	576,200	6,436,154.00	0.29
86	600166	福田汽车	2,706,400	6,414,168.00	0.29
87	000830	鲁西化工	589,200	6,410,496.00	0.29
88	600811	东方集团	1,720,800	6,401,376.00	0.28
89	600755	厦门国贸	737,800	6,367,214.00	0.28
90	002191	劲嘉股份	511,500	6,347,715.00	0.28
91	600959	江苏有线	1,425,300	6,342,585.00	0.28
92	600022	山东钢铁	3,794,900	6,337,483.00	0.28
93	601333	广深铁路	1,960,700	6,333,061.00	0.28
94	600839	四川长虹	2,137,600	6,305,920.00	0.28
95	002372	伟星新材	362,040	6,299,496.00	0.28
96	600885	宏发股份	258,580	6,283,494.00	0.28
97	000581	威孚高科	337,500	6,264,000.00	0.28
98	600804	鹏博士	831,900	6,255,888.00	0.28
99	600567	山鹰纸业	1,855,700	6,253,709.00	0.28
100	601866	中远海发	2,295,146	6,242,797.12	0.28
101	000547	航天发展	649,100	6,205,396.00	0.28
102	002387	维信诺	474,700	6,194,835.00	0.28
103	002281	光迅科技	233,600	6,185,728.00	0.28
104	603939	益丰药房	87,900	6,152,121.00	0.27
105	002078	太阳纸业	898,600	6,119,466.00	0.27
106	601872	招商轮船	1,402,300	6,114,028.00	0.27

107	600881	亚泰集团	1,880,700	6,112,275.00	0.27
108	600521	华海药业	432,700	6,101,070.00	0.27
109	002916	深南电路	59,540	6,068,316.80	0.27
110	600315	上海家化	194,726	6,065,714.90	0.27
111	002074	国轩高科	459,200	6,020,112.00	0.27
112	002217	合力泰	1,082,800	5,987,884.00	0.27
113	600486	扬农化工	107,800	5,896,660.00	0.26
114	600808	马钢股份	1,727,300	5,890,093.00	0.26
115	600260	凯乐科技	292,200	5,838,156.00	0.26
116	603077	和邦生物	3,067,200	5,827,680.00	0.26
117	002273	水晶光电	502,930	5,823,929.40	0.26
118	600094	大名城	917,600	5,771,704.00	0.26
119	600037	歌华有线	562,500	5,765,625.00	0.26
120	300009	安科生物	361,800	5,752,620.00	0.26
121	600079	人福医药	546,900	5,742,450.00	0.26
122	002221	东华能源	666,200	5,735,982.00	0.26
123	603000	人民网	320,500	5,714,515.00	0.25
124	002670	国盛金控	447,403	5,637,277.80	0.25
125	000970	中科三环	496,300	5,633,005.00	0.25
126	600160	巨化股份	791,830	5,629,911.30	0.25
127	002038	双鹭药业	236,500	5,571,940.00	0.25
128	002002	鸿达兴业	898,700	5,562,953.00	0.25
129	600845	宝信软件	195,086	5,556,049.28	0.25
130	300027	华谊兄弟	1,127,500	5,536,025.00	0.25
131	002085	万丰奥威	759,100	5,526,248.00	0.25
132	300315	掌趣科技	1,599,400	5,517,930.00	0.25
133	000983	西山煤电	909,500	5,511,570.00	0.25
134	300274	阳光电源	588,100	5,498,735.00	0.24
135	601699	潞安环能	690,400	5,481,776.00	0.24
136	000513	丽珠集团	164,920	5,480,291.60	0.24
137	600435	北方导航	606,200	5,449,738.00	0.24
138	600967	内蒙一机	485,000	5,432,000.00	0.24
139	002607	中公教育	395,000	5,423,350.00	0.24
140	600064	南京高科	503,800	5,395,698.00	0.24
141	300088	长信科技	1,064,100	5,384,346.00	0.24
142	000729	燕京啤酒	810,700	5,383,048.00	0.24
143	600466	蓝光发展	864,640	5,378,060.80	0.24
144	600143	金发科技	1,097,400	5,377,260.00	0.24
145	600643	爱建集团	561,100	5,375,338.00	0.24

146	600282	南钢股份	1,535,700	5,374,950.00	0.24
147	600388	龙净环保	432,900	5,363,631.00	0.24
148	600737	中粮糖业	615,157	5,339,562.76	0.24
149	600021	上海电力	609,100	5,286,988.00	0.24
150	601098	中南传媒	417,309	5,274,785.76	0.23
151	000878	云南铜业	496,100	5,273,543.00	0.23
152	002589	瑞康医药	694,600	5,272,014.00	0.23
153	600863	内蒙华电	1,678,000	5,268,920.00	0.23
154	300166	东方国信	428,500	5,266,265.00	0.23
155	002110	三钢闽光	566,200	5,265,660.00	0.23
156	000089	深圳机场	591,200	5,255,768.00	0.23
157	600266	北京城建	652,040	5,255,442.40	0.23
158	600171	上海贝岭	322,900	5,247,125.00	0.23
159	300001	特锐德	291,175	5,246,973.50	0.23
160	603444	吉比特	24,947	5,237,872.12	0.23
161	002174	游族网络	309,500	5,224,360.00	0.23
162	603517	绝味食品	132,840	5,168,804.40	0.23
163	002131	利欧股份	2,695,600	5,148,596.00	0.23
164	300207	欣旺达	446,700	5,145,984.00	0.23
165	600258	首旅酒店	286,184	5,145,588.32	0.23
166	002019	亿帆医药	419,500	5,138,875.00	0.23
167	600026	中远海能	788,700	5,118,663.00	0.23
168	000563	陕国投A	1,152,140	5,115,501.60	0.23
169	601118	海南橡胶	992,200	5,109,830.00	0.23
170	002690	美亚光电	155,700	5,075,820.00	0.23
171	600373	中文传媒	401,500	5,042,840.00	0.22
172	000636	风华高科	416,500	5,039,650.00	0.22
173	601106	中国一重	1,592,300	4,999,822.00	0.22
174	002440	闰土股份	401,200	4,998,952.00	0.22
175	601718	际华集团	1,271,600	4,971,956.00	0.22
176	000883	湖北能源	1,127,700	4,894,218.00	0.22
177	000826	启迪环境	414,100	4,882,239.00	0.22
178	002155	湖南黄金	483,500	4,868,845.00	0.22
179	002233	塔牌集团	415,700	4,855,376.00	0.22
180	600380	健康元	560,672	4,849,812.80	0.22
181	000930	中粮生化	642,200	4,829,344.00	0.21
182	601100	恒立液压	153,200	4,807,416.00	0.21
183	000732	泰禾集团	289,900	4,783,350.00	0.21
184	002152	广电运通	693,800	4,752,530.00	0.21



185	000559	万向钱潮	794,600	4,751,708.00	0.21
186	002250	联化科技	428,100	4,747,629.00	0.21
187	600649	城投控股	733,400	4,745,098.00	0.21
188	601000	唐山港	1,718,420	4,725,655.00	0.21
189	601966	玲珑轮胎	277,800	4,722,600.00	0.21
190	000598	兴蓉环境	1,035,000	4,709,250.00	0.21
191	000681	视觉中国	241,820	4,686,471.60	0.21
192	300316	晶盛机电	369,300	4,686,417.00	0.21
193	000932	华菱钢铁	976,520	4,658,000.40	0.21
194	600008	首创股份	1,317,000	4,635,840.00	0.21
195	300182	捷成股份	1,047,600	4,619,916.00	0.21
196	600782	新钢股份	920,400	4,602,000.00	0.20
197	600039	四川路桥	1,249,500	4,548,180.00	0.20
198	600648	外高桥	216,500	4,542,170.00	0.20
199	002399	海普瑞	216,220	4,538,457.80	0.20
200	600827	百联股份	461,600	4,528,296.00	0.20
201	601231	环旭电子	374,800	4,516,340.00	0.20
202	600500	中化国际	604,400	4,514,868.00	0.20
203	002004	华邦健康	920,100	4,471,686.00	0.20
204	600515	海航基础	902,653	4,468,132.35	0.20
205	002583	海能达	531,800	4,461,802.00	0.20
206	000738	航发控制	331,600	4,443,440.00	0.20
207	600598	北大荒	413,500	4,436,855.00	0.20
208	600748	上实发展	534,300	4,429,347.00	0.20
209	601179	中国西电	1,186,855	4,391,363.50	0.20
210	000685	中山公用	512,900	4,380,166.00	0.19
211	002368	太极股份	144,200	4,369,260.00	0.19
212	000758	中色股份	795,428	4,366,899.72	0.19
213	000031	大悦城	679,200	4,360,464.00	0.19
214	603501	韦尔股份	79,400	4,359,854.00	0.19
215	002266	浙富控股	910,700	4,325,825.00	0.19
216	601608	中信重工	1,001,200	4,325,184.00	0.19
217	300418	昆仑万维	333,310	4,289,699.70	0.19
218	300058	蓝色光标	1,004,466	4,289,069.82	0.19
219	000027	深圳能源	685,300	4,248,860.00	0.19
220	601678	滨化股份	627,770	4,243,725.20	0.19
221	000008	神州高铁	1,125,500	4,243,135.00	0.19
222	000807	云铝股份	904,500	4,242,105.00	0.19
223	600120	浙江东方	332,842	4,240,407.08	0.19

224	600138	中青旅	334,000	4,238,460.00	0.19
225	600633	浙数文化	451,700	4,223,395.00	0.19
226	600729	重庆百货	139,078	4,205,718.72	0.19
227	603228	景旺电子	105,031	4,202,290.31	0.19
228	000877	天山股份	361,580	4,201,559.60	0.19
229	600167	联美控股	396,890	4,199,096.20	0.19
230	600056	中国医药	309,700	4,177,853.00	0.19
231	300133	华策影视	619,600	4,169,908.00	0.19
232	002414	高德红外	216,450	4,155,840.00	0.19
233	000488	晨鸣纸业	771,950	4,137,652.00	0.18
234	600507	方大特钢	420,300	4,110,534.00	0.18
235	002183	怡亚通	861,211	4,107,976.47	0.18
236	600511	国药股份	178,700	4,104,739.00	0.18
237	603885	吉祥航空	312,820	4,097,942.00	0.18
238	600777	新潮能源	1,967,400	4,092,192.00	0.18
239	600155	华创阳安	302,800	4,066,604.00	0.18
240	600409	三友化工	718,300	4,065,578.00	0.18
241	000887	中鼎股份	423,800	4,064,242.00	0.18
242	600216	浙江医药	393,600	4,030,464.00	0.18
243	002603	以岭药业	347,600	4,025,208.00	0.18
244	600348	阳泉煤业	691,400	4,017,034.00	0.18
245	600823	世茂股份	868,200	4,002,402.00	0.18
246	002408	齐翔腾达	514,400	3,986,600.00	0.18
247	000813	德展健康	521,100	3,970,782.00	0.18
248	600418	江淮汽车	765,400	3,949,464.00	0.18
249	000528	柳工	592,170	3,943,852.20	0.18
250	002812	恩捷股份	83,800	3,917,650.00	0.17
251	600060	海信电器	452,800	3,903,136.00	0.17
252	603883	老百姓	66,700	3,900,616.00	0.17
253	600970	中材国际	605,700	3,894,651.00	0.17
254	600525	长园集团	615,500	3,889,960.00	0.17
255	600158	中体产业	378,100	3,867,963.00	0.17
256	600277	亿利洁能	788,800	3,841,456.00	0.17
257	002701	奥瑞金	820,500	3,831,735.00	0.17
258	000301	东方盛虹	695,800	3,819,942.00	0.17
259	600062	华润双鹤	302,820	3,818,560.20	0.17
260	601880	大连港	1,787,200	3,806,736.00	0.17
261	300010	立思辰	404,100	3,794,499.00	0.17
262	600597	光明乳业	352,500	3,789,375.00	0.17

263	600580	卧龙电驱	448,000	3,767,680.00	0.17
264	002407	多氟多	317,927	3,764,255.68	0.17
265	300113	顺网科技	239,900	3,761,632.00	0.17
266	002242	九阳股份	180,600	3,758,286.00	0.17
267	002640	跨境通	450,500	3,752,665.00	0.17
268	601958	金铂股份	558,300	3,740,610.00	0.17
269	600478	科力远	668,000	3,734,120.00	0.17
270	000090	天健集团	754,922	3,729,314.68	0.17
271	002244	滨江集团	896,400	3,720,060.00	0.17
272	600717	天津港	579,040	3,717,436.80	0.17
273	600307	酒钢宏兴	1,812,700	3,679,781.00	0.16
274	002419	天虹股份	281,100	3,671,166.00	0.16
275	300244	迪安诊断	216,200	3,671,076.00	0.16
276	000028	国药一致	87,700	3,668,491.00	0.16
277	000156	华数传媒	331,300	3,647,613.00	0.16
278	600664	哈药股份	875,500	3,624,570.00	0.16
279	002212	南洋股份	264,500	3,623,650.00	0.16
280	601200	上海环境	265,448	3,612,747.28	0.16
281	600312	平高电气	469,200	3,608,148.00	0.16
282	300026	红日药业	1,045,500	3,606,975.00	0.16
283	002056	横店东磁	473,700	3,600,120.00	0.16
284	300002	神州泰岳	904,000	3,597,920.00	0.16
285	002128	露天煤业	415,200	3,591,480.00	0.16
286	002426	胜利精密	1,402,100	3,589,376.00	0.16
287	600259	广晟有色	88,500	3,566,550.00	0.16
288	601928	凤凰传媒	441,100	3,559,677.00	0.16
289	600557	康缘药业	238,600	3,545,596.00	0.16
290	002491	通鼎互联	437,900	3,542,611.00	0.16
291	600884	杉杉股份	331,700	3,532,605.00	0.16
292	603659	璞泰来	75,100	3,531,202.00	0.16
293	600759	洲际油气	914,200	3,528,812.00	0.16
294	601611	中国核建	453,480	3,528,074.40	0.16
295	600316	洪都航空	246,500	3,527,415.00	0.16
296	002665	首航节能	1,028,000	3,484,920.00	0.16
297	002470	金正大	952,100	3,465,644.00	0.15
298	002030	达安基因	322,400	3,459,352.00	0.15
299	600073	上海梅林	375,700	3,456,440.00	0.15
300	000021	深科技	424,900	3,454,437.00	0.15
301	300134	大富科技	221,200	3,435,236.00	0.15

302	300324	旋极信息	592,255	3,429,156.45	0.15
303	300197	铁汉生态	951,600	3,416,244.00	0.15
304	600125	铁龙物流	529,100	3,412,695.00	0.15
305	600859	王府井	224,600	3,411,674.00	0.15
306	601717	郑煤机	596,700	3,407,157.00	0.15
307	002064	华峰氨纶	678,682	3,406,983.64	0.15
308	600754	锦江股份	138,000	3,400,320.00	0.15
309	000078	海王生物	970,500	3,377,340.00	0.15
310	002176	江特电机	689,800	3,359,326.00	0.15
311	600017	日照港	1,065,500	3,356,325.00	0.15
312	600267	海正药业	335,451	3,354,510.00	0.15
313	603816	顾家家居	104,520	3,336,278.40	0.15
314	600751	海航科技	1,046,300	3,327,234.00	0.15
315	600582	天地科技	963,300	3,323,385.00	0.15
316	002051	中工国际	289,280	3,318,041.60	0.15
317	300115	长盈精密	315,900	3,313,791.00	0.15
318	000712	锦龙股份	257,200	3,302,448.00	0.15
319	000727	华东科技	1,574,700	3,291,123.00	0.15
320	600575	皖江物流	1,118,900	3,278,377.00	0.15
321	600563	法拉电子	79,590	3,276,720.30	0.15
322	002302	西部建设	294,100	3,276,274.00	0.15
323	002358	森源电气	322,300	3,271,345.00	0.15
324	600291	西水股份	324,200	3,261,452.00	0.15
325	603866	桃李面包	78,260	3,259,529.00	0.15
326	002280	联络互动	884,300	3,236,538.00	0.14
327	600901	江苏租赁	530,400	3,230,136.00	0.14
328	002424	贵州百灵	326,200	3,222,856.00	0.14
329	600499	科达洁能	734,100	3,215,358.00	0.14
330	000959	首钢股份	913,400	3,215,168.00	0.14
331	002285	世联行	708,800	3,196,688.00	0.14
332	002317	众生药业	373,400	3,177,634.00	0.14
333	600565	迪马股份	846,275	3,156,605.75	0.14
334	000400	许继电气	347,697	3,150,134.82	0.14
335	000519	中兵红箭	405,800	3,136,834.00	0.14
336	002505	大康农业	1,590,600	3,133,482.00	0.14
337	600645	中源协和	181,000	3,133,110.00	0.14
338	600835	上海机电	188,400	3,127,440.00	0.14
339	000158	常山北明	574,600	3,114,332.00	0.14
340	002444	巨星科技	311,700	3,110,766.00	0.14

341	600993	马应龙	176,000	3,106,400.00	0.14
342	600317	营口港	1,124,200	3,102,792.00	0.14
343	000926	福星股份	445,800	3,084,936.00	0.14
344	000717	韶钢松山	696,000	3,083,280.00	0.14
345	600908	无锡银行	546,600	3,082,824.00	0.14
346	002390	信邦制药	580,400	3,058,708.00	0.14
347	000718	苏宁环球	876,500	3,032,690.00	0.14
348	002028	思源电气	304,200	3,029,832.00	0.13
349	002807	江阴银行	642,400	3,006,432.00	0.13
350	600141	兴发集团	292,360	3,005,460.80	0.13
351	600770	综艺股份	449,200	3,000,656.00	0.13
352	601326	秦港股份	826,000	2,998,380.00	0.13
353	002573	清新环境	371,800	2,992,990.00	0.13
354	600787	中储股份	522,273	2,992,624.29	0.13
355	600765	中航重机	323,400	2,984,982.00	0.13
356	002249	大洋电机	685,500	2,975,070.00	0.13
357	600151	航天机电	577,400	2,973,610.00	0.13
358	000006	深振业 A	545,100	2,970,795.00	0.13
359	000980	众泰汽车	701,700	2,954,157.00	0.13
360	000012	南玻 A	709,002	2,949,448.32	0.13
361	002839	张家港行	523,600	2,947,868.00	0.13
362	600611	大众交通	633,550	2,946,007.50	0.13
363	002831	裕同科技	153,260	2,937,994.20	0.13
364	000543	皖能电力	622,800	2,933,388.00	0.13
365	600862	中航高科	322,000	2,894,780.00	0.13
366	600458	时代新材	277,000	2,878,030.00	0.13
367	300055	万邦达	402,300	2,868,399.00	0.13
368	300308	中际旭创	84,180	2,861,278.20	0.13
369	603515	欧普照明	88,720	2,861,220.00	0.13
370	002332	仙琚制药	419,100	2,833,116.00	0.13
371	002366	台海核电	302,200	2,828,592.00	0.13
372	600169	太原重工	1,057,600	2,823,792.00	0.13
373	000848	承德露露	338,500	2,819,705.00	0.13
374	603712	七一二	132,500	2,812,975.00	0.13
375	601019	山东出版	360,300	2,803,134.00	0.12
376	000600	建投能源	415,500	2,783,850.00	0.12
377	002048	宁波华翔	254,200	2,750,444.00	0.12
378	600338	西藏珠峰	156,180	2,730,026.40	0.12
379	601311	骆驼股份	251,500	2,728,775.00	0.12

380	000564	供销大集	1,044,400	2,725,884.00	0.12
381	002093	国脉科技	293,100	2,722,899.00	0.12
382	603233	大参林	60,480	2,721,600.00	0.12
383	600393	粤泰股份	582,500	2,708,625.00	0.12
384	002431	棕榈股份	685,400	2,707,330.00	0.12
385	002635	安洁科技	200,400	2,703,396.00	0.12
386	002672	东江环保	236,700	2,684,178.00	0.12
387	300376	易事特	538,500	2,654,805.00	0.12
388	300287	飞利信	662,600	2,630,522.00	0.12
389	600978	宜华生活	699,500	2,630,120.00	0.12
390	300297	蓝盾股份	434,100	2,617,623.00	0.12
391	601016	节能风电	983,800	2,616,908.00	0.12
392	601689	拓普集团	169,900	2,602,868.00	0.12
393	002254	泰和新材	245,500	2,597,390.00	0.12
394	002544	杰赛科技	199,600	2,594,800.00	0.12
395	300159	新研股份	519,500	2,587,110.00	0.12
396	002745	木林森	220,700	2,586,604.00	0.12
397	000869	张裕A	80,400	2,582,448.00	0.11
398	603766	隆鑫通用	605,200	2,535,788.00	0.11
399	600006	东风汽车	474,100	2,526,953.00	0.11
400	603198	迎驾贡酒	140,700	2,519,937.00	0.11
401	600640	号百控股	186,000	2,488,680.00	0.11
402	600623	华谊集团	322,500	2,463,900.00	0.11
403	000501	鄂武商A	228,600	2,457,450.00	0.11
404	300266	兴源环境	541,100	2,456,594.00	0.11
405	002503	搜于特	893,300	2,456,575.00	0.11
406	600757	长江传媒	356,900	2,430,489.00	0.11
407	600639	浦东金桥	150,300	2,430,351.00	0.11
408	600195	中牧股份	175,420	2,429,567.00	0.11
409	603888	新华网	121,700	2,429,132.00	0.11
410	300199	翰宇药业	264,800	2,428,216.00	0.11
411	600750	江中药业	186,000	2,419,860.00	0.11
412	000062	深圳华强	181,670	2,414,394.30	0.11
413	600694	大商股份	86,200	2,405,842.00	0.11
414	600545	卓郎智能	338,100	2,403,891.00	0.11
415	002709	天赐材料	99,100	2,398,220.00	0.11
416	603056	德邦股份	170,200	2,396,416.00	0.11
417	000990	诚志股份	145,901	2,394,235.41	0.11
418	600869	智慧能源	527,000	2,382,040.00	0.11

419	600329	中新药业	165,900	2,370,711.00	0.11
420	000937	冀中能源	613,900	2,369,654.00	0.11
421	603568	伟明环保	109,781	2,362,487.12	0.11
422	600416	湘电股份	392,200	2,361,044.00	0.11
423	002382	蓝帆医疗	169,800	2,346,636.00	0.10
424	000426	兴业矿业	431,100	2,315,007.00	0.10
425	002375	亚厦股份	389,800	2,303,718.00	0.10
426	000537	广宇发展	332,800	2,302,976.00	0.10
427	002815	崇达技术	145,300	2,265,227.00	0.10
428	601001	大同煤业	491,900	2,247,983.00	0.10
429	603806	福斯特	60,820	2,233,918.60	0.10
430	300257	开山股份	199,300	2,208,244.00	0.10
431	601127	小康股份	167,250	2,190,975.00	0.10
432	002489	浙江永强	649,400	2,168,996.00	0.10
433	002920	德赛西威	96,300	2,157,120.00	0.10
434	600058	五矿发展	253,100	2,138,695.00	0.10
435	000061	农产品	393,800	2,134,396.00	0.10
436	002707	众信旅游	349,300	2,120,251.00	0.09
437	002948	青岛银行	327,900	2,108,397.00	0.09
438	002434	万里扬	310,500	2,108,295.00	0.09
439	601801	皖新传媒	350,700	2,107,707.00	0.09
440	600657	信达地产	509,600	2,099,552.00	0.09
441	002118	紫鑫药业	307,500	2,072,550.00	0.09
442	002437	誉衡药业	524,300	2,070,985.00	0.09
443	000536	华映科技	821,600	2,070,432.00	0.09
444	600874	创业环保	249,600	2,069,184.00	0.09
445	600971	恒源煤电	352,920	2,064,582.00	0.09
446	603377	东方时尚	135,060	2,063,716.80	0.09
447	000829	天音控股	349,900	2,036,418.00	0.09
448	002509	天广中茂	987,800	2,034,868.00	0.09
449	600707	彩虹股份	405,000	2,029,050.00	0.09
450	002681	奋达科技	478,000	2,026,720.00	0.09
451	000541	佛山照明	384,070	2,012,526.80	0.09
452	002251	步步高	251,500	2,004,455.00	0.09
453	002517	恺英网络	625,050	1,993,909.50	0.09
454	002512	达华智能	434,400	1,963,488.00	0.09
455	600996	贵广网络	182,100	1,963,038.00	0.09
456	600098	广州发展	317,300	1,954,568.00	0.09
457	601139	深圳燃气	342,800	1,950,532.00	0.09

458	300459	金科文化	342,400	1,948,256.00	0.09
459	000766	通化金马	281,200	1,912,160.00	0.09
460	600428	中远海特	511,000	1,890,700.00	0.08
461	600350	山东高速	391,600	1,879,680.00	0.08
462	002936	郑州银行	365,300	1,855,724.00	0.08
463	603328	依顿电子	180,400	1,852,708.00	0.08
464	000552	靖远煤电	680,800	1,844,968.00	0.08
465	601869	长飞光纤	48,600	1,822,500.00	0.08
466	600053	九鼎投资	77,149	1,797,571.70	0.08
467	002344	海宁皮城	380,500	1,773,130.00	0.08
468	601003	柳钢股份	305,800	1,770,582.00	0.08
469	002482	广田集团	364,100	1,769,526.00	0.08
470	600903	贵州燃气	134,296	1,749,876.88	0.08
471	601615	明阳智能	161,000	1,745,240.00	0.08
472	600335	国机汽车	250,000	1,730,000.00	0.08
473	002818	富森美	133,850	1,717,295.50	0.08
474	601777	力帆股份	391,100	1,677,819.00	0.07
475	600939	重庆建工	325,500	1,591,695.00	0.07
476	000587	金洲慈航	616,900	1,591,602.00	0.07
477	603556	海兴电力	113,370	1,566,773.40	0.07
478	000987	越秀金控	161,700	1,458,534.00	0.06
479	002416	爱施德	224,480	1,403,000.00	0.06
480	000025	特力A	69,105	1,397,303.10	0.06
481	600126	杭钢股份	304,390	1,388,018.40	0.06
482	601969	海南矿业	233,400	1,372,392.00	0.06
483	002699	美盛文化	220,000	1,320,000.00	0.06
484	600985	淮北矿业	113,300	1,284,822.00	0.06
485	601068	中铝国际	185,400	1,279,260.00	0.06
486	603225	新凤鸣	101,920	1,272,980.80	0.06
487	600280	中央商场	343,700	1,233,883.00	0.05
488	600179	ST安通	403,240	1,181,493.20	0.05
489	601811	新华文轩	93,500	1,141,635.00	0.05
490	002941	新疆交建	43,300	1,125,800.00	0.05
491	603355	莱克电气	50,100	1,078,152.00	0.05
492	603868	飞科电器	27,000	1,057,050.00	0.05
493	603486	科沃斯	34,100	1,031,525.00	0.05
494	000761	本钢板材	236,100	1,015,230.00	0.05
495	002946	新乳业	59,400	899,316.00	0.04
496	603650	彤程新材	39,300	858,312.00	0.04



497	600917	重庆燃气	114,600	797,616.00	0.04
498	603025	大豪科技	71,325	730,368.00	0.03
499	603569	长久物流	47,980	556,088.20	0.02
500	603877	太平鸟	31,400	487,328.00	0.02

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600968	海油发展	102,375	363,431.25	0.02
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.00
3	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.00
4	603863	松炆资源	1,612	37,204.96	0.00
5	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.00
6	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.00
7	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.00
8	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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	002405	四维图新	17,422,358.00	1.05
2	002157	正邦科技	13,000,048.72	0.78
3	002926	华西证券	10,734,753.00	0.65
4	002075	沙钢股份	9,429,837.83	0.57
5	600739	辽宁成大	9,242,106.80	0.56
6	600763	通策医疗	8,812,710.00	0.53
7	002387	维信诺	8,143,002.00	0.49
8	002797	第一创业	7,885,337.40	0.47
9	002821	凯莱英	7,751,487.00	0.47
10	600745	闻泰科技	7,700,754.05	0.46
11	600549	厦门钨业	7,503,743.30	0.45

12	600497	驰宏锌锗	7,472,796.95	0.45
13	002572	索菲亚	7,358,974.57	0.44
14	002217	合力泰	6,731,291.00	0.41
15	600909	华安证券	6,278,806.28	0.38
16	300009	安科生物	6,196,026.00	0.37
17	601333	广深铁路	6,181,874.00	0.37
18	601598	中国外运	6,113,518.12	0.37
19	002085	万丰奥威	5,983,303.38	0.36
20	000983	西山煤电	5,938,992.00	0.36

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	300347	泰格医药	15,779,860.00	0.95
2	002410	广联达	14,305,470.00	0.86
3	000656	金科股份	12,600,723.84	0.76
4	300146	汤臣倍健	12,099,555.00	0.73
5	000596	古井贡酒	9,814,510.00	0.59
6	600600	青岛啤酒	9,508,973.23	0.57
7	300413	芒果超媒	9,029,154.13	0.54
8	600256	广汇能源	8,202,304.70	0.49
9	000418	小天鹅 A	8,148,906.05	0.49
10	002013	中航机电	7,199,370.82	0.43
11	603899	晨光文具	6,448,690.64	0.39
12	600779	水井坊	5,441,337.56	0.33
13	600655	豫园股份	5,336,022.71	0.32
14	601598	中国外运	5,240,623.64	0.32
15	000667	美好置业	5,066,971.00	0.31
16	002916	深南电路	4,386,916.24	0.26
17	600270	外运发展	4,170,655.28	0.25
18	000860	顺鑫农业	4,157,416.10	0.25
19	002563	森马服饰	4,043,649.98	0.24
20	600366	宁波韵升	4,007,243.24	0.24

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	965,175,573.96
卖出股票收入（成交）总额	738,286,108.89

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 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

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

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1909	中证 500 指数	26	25,030,720.00	967,858.81	-
公允价值变动总额合计（元）					967,858.81
股指期货投资本期收益（元）					2,258,195.33
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,129,218.81

## 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

### 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

本组合投资的前十名证券之一紫光国微，于 2018 年 8 月 21 日被深交所依据相关法规出具监管函，主要违法违规事实为：未按规定及时对关联交易履行审议程序和信息披露义务。

本组合投资的前十名证券之一中炬高新，于 2019 年 4 月 22 日被上交所依据相关法规给予监管关注处分决定，主要违法违规事实为：未及时披露公司重大事项。

对上述股票的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为有效跟踪标的指数，控制跟踪偏离和跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成份股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

### 7.12.2

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	4,093,999.82
2	应收证券清算款	511,959.02
3	应收股利	-
4	应收利息	20,202.35
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	193,684.37
8	其他	-
9	合计	4,819,845.56

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.00	新股未上市

### 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

#### 8.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
2,208	200,718.35	333,834,961.00	75.33%	21,813,370.00	4.92%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
平安中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	87,537,790.00	19.75%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司	300,383,101.00	67.78%
2	中国人保资产管理股份有限公司-中 国人保资产安心增值投资产品	12,481,900.00	2.82%
3	中国国际金融股份有限公司	2,997,058.00	0.68%
4	广发证券股份有限公司	2,173,758.00	0.49%
5	太平人寿保险有限公司-分红-个 险分红	2,000,000.00	0.45%
6	新华资管-中国银行-新华资产-明仁 五号资产管理产品	1,483,300.00	0.33%
7	中国人民保险集团股份有限公司企 业年金计划-中国建设银行股份有 限公司	1,383,700.00	0.31%
8	中信建投证券股份有限公司	1,343,832.00	0.30%
9	中英人寿保险有限公司-分红-个 险分红	1,260,000.00	0.28%
10	百年人寿保险股份有限公司-传统 保险产品	1,000,000.00	0.23%

11	平安中证 500 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金	87,537,790.00	19.75%
----	---------------------------------	---------------	--------

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 3 月 23 日）基金份额总额	2,648,875,604.00
本报告期期初基金份额总额	390,386,121.00
本报告期期间基金总申购份额	170,000,000.00
减：本报告期期间基金总赎回份额	117,200,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	443,186,121.00



## § 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

1、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2、经平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）2019 年第三次股东会议审议通过，由薛世峰先生接替李兆良先生任职公司的独立董事，任职日期为 2019 年 6 月 7 日。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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	
平安证券	4	643,342,479.83	37.95%	457,616.80	37.95%	-
方正证券	2	526,613,537.98	31.07%	374,573.11	31.07%	-
中信证券	3	501,377,583.25	29.58%	356,635.63	29.58%	-
中泰证券	1	23,772,844.37	1.40%	16,910.54	1.40%	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	新增 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	4	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	新增
安信证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

申万宏源	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
广州证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	7	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

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。其中中信证券的一个席位作为申赎本基金的专用席位。

### 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
平安证券	-	-	4,000,000.00	0.67%	-	-
方正证券	-	-	401,000,000.00	66.94%	-	-
中信证券	-	-	194,000,000.00	32.39%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-

华福证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-

## 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关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 1 月 3 日
2	关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 1 月 17 日
3	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 1 月 18 日
4	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 2 月 12 日
5	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 2 月 27 日
6	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 3 月 26 日
7	关于平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 12 日
8	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 18 日
9	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 30 日
10	关于旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 5 月 10 日
11	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定网站	2019 年 6 月 18 日
12	关于旗下基金新增中国银河证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 6 月 24 日
13	平安基金管理有限公司 2019 年 6 月 30 日基金净值披露公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 6 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

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	2019/01/01--2019/06/30	300,383,101.00	0.00	0.00	300,383,101.00	67.78%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

## 备查文件目录

### 11.2 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
- 3、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
- 4、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

### 11.3 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

### 11.4 查阅方式

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

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

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 22 日