

平安沪深 300 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 8 月 23 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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

| | |
|--|-----------|
| §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 | 6 |
| 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 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 8 |
| 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 |
| §4 管理人报告 | 10 |
| 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 |
| §5 托管人报告 | 15 |
| 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 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 16 |
| 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 |
| §7 投资组合报告..... | 42 |
| 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..... | 52 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明..... | 54 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明..... | 55 |
| 7.12 投资组合报告附注..... | 55 |
| §8 基金份额持有人信息..... | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 57 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 57 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 57 |
| 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..... | 58 |
| §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..... | 61 |

| | |
|--|-----------|
| 10.8 其他重大事件..... | 62 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 63 |
| 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 | 63 |
| 备查文件目录..... | 64 |
| 11.2 备查文件目录..... | 64 |
| 11.3 存放地点..... | 64 |
| 11.4 查阅方式..... | 64 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称 | 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 平安沪深 300ETF |
| 场内简称 | 平安 300 |
| 基金主代码 | 510390 |
| 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 | 2017 年 12 月 25 日 |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,366,849,992.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2018-1-26 |

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，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|---------------------------------|---------------------|
| 名称 | | 平安基金管理有限公司 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 陈特正 | 郭明 |
| | 联系电话 | 0755-22626828 | 010-66105799 |
| | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话 | | 400-800-4800 | 95588 |
| 传真 | | 0755-23997878 | (010)66105798 |
| 注册地址 | | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 办公地址 | | 深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层 | 北京市西城区复兴门内大街 55 号 |
| 邮政编码 | | 518048 | 100140 |
| 法定代表人 | | 罗春风 | 陈四清 |

2.4 信息披露方式

| | |
|----------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | http://www.fund.pingan.com |
| 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 | -80,018,704.95 |
| 本期利润 | 1,229,603,065.39 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.9149 |
| 本期加权平均净值利润率 | 24.88% |
| 本期基金份额净值增长率 | 28.22% |
| 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 | -341,912,990.54 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2501 |
| 期末基金资产净值 | 5,369,859,905.53 |
| 期末基金份额净值 | 3.9286 |
| 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 | -5.99% |

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

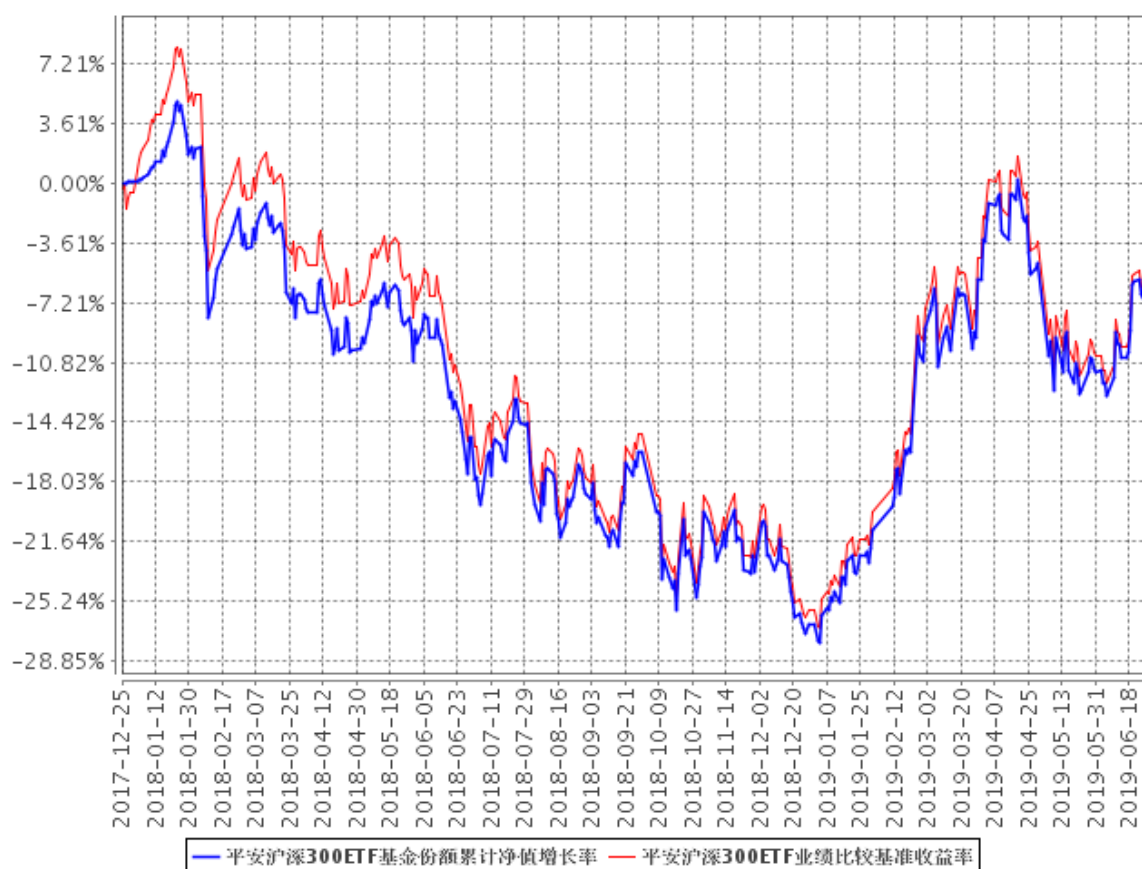
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③ | ②—④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 6.10% | 1.17% | 5.39% | 1.16% | 0.71% | 0.01% |
| 过去三个月 | -0.12% | 1.53% | -1.21% | 1.53% | 1.09% | 0.00% |
| 过去六个月 | 28.22% | 1.55% | 27.07% | 1.55% | 1.15% | 0.00% |
| 过去一年 | 11.10% | 1.53% | 8.96% | 1.53% | 2.14% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | -5.99% | 1.40% | -5.65% | 1.41% | -0.34% | -0.01% |

注：1、沪深 300 指数收益率：沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

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

平安沪深300ETF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 2017 年 12 月 25 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 | 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、ETF 指数中心指数投资总监 | 2017 年 12 月 25 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 | 平安沪深 300 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，浙江大学博士，曾担任国泰基金管理有限公司产品研究主管。2018 年 8 月加入平安基金管理有限公司，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 | 平安沪深 300 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，北京大学计算机软件专业硕士，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，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 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|---|
| | | | | | 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遵规守信情况的说明

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、《平安沪深 300 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

作为一只投资于沪深 300 指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

报告期内，本基金的日均偏离度为 0.01%，年化跟踪误差 0.43%，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 3.9286 元，份额累计净值为 0.9401 元；本报告期基金份额净值增长率为 28.22%，业绩比较基准收益率为 27.07%。

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

本基金本报告期未出现连续 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

本报告期内，本基金托管人在对平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——平安基金管理有限公司在平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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 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 |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 12,969,731.90 | 5,726,834.16 |
| 结算备付金 | | 23,069,388.76 | 5,770,282.23 |
| 存出保证金 | | 2,307,634.94 | 623,699.00 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 5,343,497,055.30 | 4,288,970,576.02 |
| 其中：股票投资 | | 5,343,497,055.30 | 4,288,970,576.02 |
| 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 | | - | 2,069,904.00 |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 9,111.74 | 3,518.66 |
| 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 | - |
| 资产总计 | | 5,382,046,607.01 | 4,303,164,814.07 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末 2019 年 6 月 30 日 | 上年度末 2018 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 | | 2,723,793.42 | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 2,061,963.53 | 1,885,314.66 |
| 应付托管费 | | 412,392.72 | 377,062.93 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 866,134.07 | 450,338.00 |

| | | | |
|---------------|----------|------------------|-------------------|
| 应交税费 | | 7,595.22 | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 6,114,822.52 | 2,075,287.03 |
| 负债合计 | | 12,186,701.48 | 4,788,002.62 |
| 所有者权益： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 5,711,772,896.07 | 5,862,209,173.14 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | -341,912,990.54 | -1,563,832,361.69 |
| 所有者权益合计 | | 5,369,859,905.53 | 4,298,376,811.45 |
| 负债和所有者权益总计 | | 5,382,046,607.01 | 4,303,164,814.07 |

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 3.9286 元，基金份额总额 1,366,849,992.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|------------|--|---|
| 一、收入 | | 1,247,250,176.55 | -752,306,868.83 |
| 1.利息收入 | | 126,867.89 | 7,787,594.75 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 84,832.23 | 6,545,340.09 |
| 债券利息收入 | | - | 190.57 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 42,035.66 | 1,242,064.09 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -62,276,109.59 | 5,496,410.93 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | -118,084,078.65 | -40,049,522.44 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - | 110,961.48 |
| 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 | 1,186,176.70 | -435,382.14 |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | 54,621,792.36 | 45,870,354.03 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 1,309,621,770.34 | -765,973,979.47 |
| 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 | -222,352.09 | 383,104.96 |
| 减：二、费用 | | 17,647,111.16 | 21,742,119.70 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 12,228,015.04 | 12,194,775.46 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 2,445,602.99 | 2,438,955.09 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | - | - |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 1,954,375.95 | 6,116,772.86 |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 税金及附加 | | 4,270.23 | 250.69 |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 1,014,846.95 | 991,365.60 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 1,229,603,065.39 | -774,048,988.53 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 1,229,603,065.39 | -774,048,988.53 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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） | 5,862,209,173.14 | -1,563,832,361.69 | 4,298,376,811.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润） | - | 1,229,603,065.39 | 1,229,603,065.39 |
| 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） | -150,436,277.07 | -7,683,694.24 | -158,119,971.31 |
| 其中：1. 基金申购款 | 928,944,011.61 | -110,862,951.14 | 818,081,060.47 |
| 2. 基金赎回款 | -1,079,380,288.68 | 103,179,256.90 | -976,201,031.78 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以 | - | - | - |

| | | | |
|--|---------------------------------|-----------------|-------------------|
| “-”号填列) | | | |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 5,711,772,896.07 | -341,912,990.54 | 5,369,859,905.53 |
| 项目 | 上年度可比期间 2018年1月1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) | 5,723,055,617.00 | 5,383,130.13 | 5,728,438,747.13 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | -774,048,988.53 | -774,048,988.53 |
| 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) | -398,656,134.75 | -50,222,007.69 | -448,878,142.44 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 684,485,061.03 | -59,314,260.04 | 625,170,800.99 |
| 2. 基金赎回款 | -1,083,141,195.78 | 9,092,252.35 | -1,074,048,943.43 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | - | - | - |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 5,324,399,482.25 | -818,887,866.09 | 4,505,511,616.16 |

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 交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2055 号《关于准予平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商

变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,721,050,037.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1086 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,723,055,617.00 份,其中认购资金利息折合 2,005,580.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]15 号审核同意,本基金 1,369,549,992.00 份基金份额于 2018 年 1 月 26 日在上交所挂牌交易。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数沪深 300 指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资范围为标的指数的成份股及其备选成份股;此外,本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金在履行适当程序后,参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数成份股、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:沪深 300 指数收益率。

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

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》、《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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 06 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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育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 | 12,969,731.90 |
| 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： | 12,969,731.90 |

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 | 5,346,677,438.25 | 5,343,497,055.30 | -3,180,382.95 |
| 贵金属投资-金交所 黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | - | - |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | - | - |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 5,346,677,438.25 | 5,343,497,055.30 | -3,180,382.95 |

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 -192 元

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 | | | 备注 |
|--------|-------------------|------|----|----|
| | 合同/名义金额 | 公允价值 | | |
| | | 资产 | 负债 | |
| 利率衍生工具 | - | - | - | |
| 货币衍生工具 | - | - | - | |
| 权益衍生工具 | 20,140,950.00 | - | - | |
| IF1909 | 20,140,950.00 | - | - | |
| 其他衍生工具 | - | - | - | |
| 合计 | 20,140,950.00 | - | - | |

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）之间按抵销后的净额为 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 |
|------------|--------|----------|---------------|--------------|
| IF1909 | IF1909 | 19 | 21,613,260.00 | 1,472,310.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | | | | 1,472,310.00 |
| 股指期货投资净额 | | | | - |

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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未持有买入返售金融资产。

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 | 1,900.26 |
| 应收定期存款利息 | - |
| 应收其他存款利息 | - |

| | |
|------------|----------|
| 应收结算备付金利息 | 7,152.17 |
| 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 | 59.31 |
| 合计 | 9,111.74 |

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 | 866,134.07 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 866,134.07 |

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 | - |
| 应付替代款 | 5,447,297.05 |
| 可退替代款 | 2,098.80 |
| 现金差额 | 64,345.02 |
| 预提费用 | 601,081.65 |
| 合计 | 6,114,822.52 |

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 | 1,402,849,992.00 | 5,862,209,173.14 |
| 本期申购 | 222,300,000.00 | 928,944,011.61 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -258,300,000.00 | -1,079,380,288.68 |
| - 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 | 1,366,849,992.00 | 5,711,772,896.07 |

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 | -84,996,003.74 | -1,478,836,357.95 | -1,563,832,361.69 |
| 本期利润 | -80,018,704.95 | 1,309,621,770.34 | 1,229,603,065.39 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,815,973.58 | -10,499,667.82 | -7,683,694.24 |
| 其中：基金申购款 | -22,615,090.07 | -88,247,861.07 | -110,862,951.14 |
| 基金赎回款 | 25,431,063.65 | 77,748,193.25 | 103,179,256.90 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -162,198,735.11 | -179,714,255.43 | -341,912,990.54 |

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 |
| 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 | 50,395.82 |
| 其他 | 950.43 |
| 合计 | 84,832.23 |

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 | -99,647,018.27 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -18,437,060.38 |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | -118,084,078.65 |

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 | 757,178,558.48 |
| 减：卖出股票成本总额 | 856,825,576.75 |
| 买卖股票差价收入 | -99,647,018.27 |

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 | 976,201,031.78 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 296,927,659.78 |
| 减：赎回股票成本总额 | 697,710,432.38 |
| 赎回差价收入 | -18,437,060.38 |

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

本基金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

本基金本报告期末无债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

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

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

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**

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

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

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

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**

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

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 | 1,186,176.70 |

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 | 54,621,792.36 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 54,621,792.36 |

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 | 1,307,838,312.34 |
| ——股票投资 | 1,307,838,312.34 |
| ——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 | 1,783,458.00 |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | - |
| 合计 | 1,309,621,770.34 |

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为-192元

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 | -222,352.09 |
| 合计 | -222,352.09 |

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 | 1,954,375.95 |
| 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 | 1,954,375.95 |

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 | 54,547.97 |
| 信息披露费 | 59,044.72 |
| 登记结算费 | 106,315.63 |
| 上市费 | 29,752.78 |
| 银行汇划费 | 624.07 |
| IOPV 计算费 | 30,880.87 |
| 指数使用费 | 733,680.91 |
| 合计 | 1,014,846.95 |

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 |
| 中国工商银行股份有限公司 | 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 |
| 平安银行股份有限公司 | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 平安沪深 300 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 |
| 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 |

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1月1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 | 470,105,270.97 | 31.47% | 3,332,556,412.27 | 48.73% |

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1月1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 | - | - | 835,000,000.00 | 39.11% |

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 | 334,388.57 | 31.47% | 166,082.53 | 19.18% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2018年1月1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 | 2,370,466.76 | 48.37% | 181,354.69 | 27.86% |

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1月1日至2018年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 12,228,015.04 | 12,194,775.46 |

| | | |
|-----------------|---|---|
| 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基金资产净值的 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X0.50%/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1月1日至2018年6月30日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,445,602.99 | 2,438,955.09 |

注：支付托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日的基金资产净值的 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：

日托管费=前一日的基金资产净值×0.10%/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 | | 上年度末 | |
|--------------|------------|------------------|--------------|------------------|
| | 2019年6月30日 | | 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 |
| 平安健康保险股份有限公司 | - | - | 2,394,225.00 | 0.1707% |

| | | | | |
|-----------------------------|----------------|----------|----------------|----------|
| 中国平安人寿保险股份有限公司 | 921,673,706.00 | 67.4305% | 921,673,706.00 | 65.7001% |
| 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 232,943,558.00 | 17.0424% | 253,678,033.00 | 18.0830% |

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 | | 上年度可比期间 | |
|-------|---------------------------------|-----------|---------------------------------|------------|
| | 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日 | | 2018 年 1 月 1 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 |
| 工商银行 | 12,969,731.90 | 33,485.98 | 6,811,995.18 | 535,225.44 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商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

(1) 于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 9,279,200 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 56,213,277.84 元，估值总额为人民币 54,654,488.00 元，占基金资产净值的比例为 1.0178%(2018 年 6 月 30 日：数量：9,063,300 股；成本：56,743,638.39；市值：48,216,756.00 元；占基金资产净值的比例：1.0702%)。

(2) 于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 4,673,286 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 336,405,137.71 元，估值总额为人民币 414,099,872.46 元，占基金资产净值的比例为 7.7116%(2018 年 6 月 30 日：数量：4,556,859 股；成本：328,509,271.18 元；市值：266,940,800.22 元；占基金资产净值的比例：5.9248%)。

(3) 于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 3,699,026 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 47,239,816.30 元，估值总额为人民币 50,972,578.28 元，占基金资产净值的比例为 0.9492%(2018 年 6 月 30 日：数量：3,594,726 股；成本：47,723,979.88 元；市值：32,676,059.34 元；占基金资产净值的比例：0.7252%)。

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停牌的股票。

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，无质押抵押券。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中国工商银行，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 0.00106%。

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 5,356,409,810.66 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 | 12,969,731.90 | - | - | - | - | - | 12,969,731.90 |
| 结算备付金 | 23,069,388.76 | - | - | - | - | - | 23,069,388.76 |
| 存出保证金 | 146,308.94 | - | - | - | - | 2,161,326.00 | 2,307,634.94 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 5,343,497,055.30 | 5,343,497,055.30 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 9,111.74 | 9,111.74 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | 193,684.37 | 193,684.37 |
| 资产总计 | 36,185,429.60 | - | - | - | - | 5,345,861,177.41 | 5,382,046,607.01 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,723,793.42 | 2,723,793.42 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 2,061,963.53 | 2,061,963.53 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 412,392.72 | 412,392.72 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 866,134.07 | 866,134.07 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 6,114,822.52 | 6,114,822.52 |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | 7,595.22 | 7,595.22 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 12,186,701.48 | 12,186,701.48 |
| 利率敏感度缺口 | 36,185,429.60 | - | - | - | - | 5,333,674,475.93 | 5,369,859,905.53 |
| 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 | 5,726,834.16 | - | - | - | - | - | 5,726,834.16 |
| 结算备付金 | 5,770,282.23 | - | - | - | - | - | 5,770,282.23 |
| 存出保证金 | 82,367.00 | - | - | - | - | 541,332.00 | 623,699.00 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 4,288,970,576.02 | 4,288,970,576.02 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | - | - | 2,069,904.00 | 2,069,904.00 |
| 应收利息 | - | - | - | - | - | 3,518.66 | 3,518.66 |
| 资产总计 | 11,579,483.39 | - | - | - | - | 4,291,585,330.68 | 4,303,164,814.07 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 1,885,314.66 | 1,885,314.66 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 377,062.93 | 377,062.93 |
| 应付交易费用 | - | - | - | - | - | 450,338.00 | 450,338.00 |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 2,075,287.03 | 2,075,287.03 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 4,788,002.62 | 4,788,002.62 |
| 利率敏感度缺口 | 11,579,483.39 | - | - | - | - | 4,286,797,328.06 | 4,298,376,811.45 |

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

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或银行间同业市场交易的股票和债券，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。本基金投资于沪深 300 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%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。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 | 5,343,497,055.30 | 99.51 | 4,288,970,576.02 | 99.78 |
| 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 | 5,343,497,055.30 | 99.51 | 4,288,970,576.02 | 99.78 |

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% | 282,980,211.98 | 232,349,485.01 |
| | 业绩比较基准减少5% | -282,980,211.98 | -232,349,485.01 |

本基金业绩比较基准为沪深 300 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 | 5,343,497,055.30 | 99.28 |
| | 其中：股票 | 5,343,497,055.30 | 99.28 |
| 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 | 36,039,120.66 | 0.67 |
| 8 | 其他各项资产 | 2,510,431.05 | 0.05 |
| 9 | 合计 | 5,382,046,607.01 | 100.00 |

投资组合报表中股票投资市值与按行业分类的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 | 78,604,036.92 | 1.46 |
| B | 采矿业 | 171,610,392.95 | 3.20 |
| C | 制造业 | 2,122,593,331.84 | 39.53 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 121,583,280.60 | 2.26 |
| E | 建筑业 | 162,191,571.16 | 3.02 |
| F | 批发和零售业 | 73,011,658.26 | 1.36 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 164,311,576.39 | 3.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 193,329,224.29 | 3.60 |

| | | | |
|---|---------------|------------------|-------|
| J | 金融业 | 1,872,772,118.89 | 34.88 |
| K | 房地产业 | 245,640,343.52 | 4.57 |
| L | 租赁和商务服务业 | 74,936,715.70 | 1.40 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,909,268.00 | 0.07 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 6,461,805.00 | 0.12 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 26,715,981.55 | 0.50 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 25,189,023.40 | 0.47 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 5,342,860,328.47 | 99.50 |

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 | 0.01 |
| C | 制造业 | 176,907.28 | 0.00 |
| 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 | 0.01 |

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 | 601318 | 中国平安 | 4,673,286 | 414,099,872.46 | 7.71 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 216,702 | 213,234,768.00 | 3.97 |
| 3 | 600036 | 招商银行 | 4,446,503 | 159,985,177.94 | 2.98 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 6,268,179 | 114,644,993.91 | 2.13 |
| 5 | 000651 | 格力电器 | 2,075,916 | 114,175,380.00 | 2.13 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 1,993,198 | 103,367,248.28 | 1.92 |
| 7 | 000858 | 五粮液 | 837,600 | 98,794,920.00 | 1.84 |
| 8 | 600276 | 恒瑞医药 | 1,333,738 | 88,026,708.00 | 1.64 |
| 9 | 600887 | 伊利股份 | 2,627,382 | 87,780,832.62 | 1.63 |
| 10 | 600030 | 中信证券 | 3,395,700 | 80,851,617.00 | 1.51 |
| 11 | 601328 | 交通银行 | 11,823,800 | 72,361,656.00 | 1.35 |
| 12 | 600016 | 民生银行 | 10,699,000 | 67,938,650.00 | 1.27 |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 16,482,800 | 59,338,080.00 | 1.11 |
| 14 | 600000 | 浦发银行 | 5,049,040 | 58,972,787.20 | 1.10 |
| 15 | 000002 | 万科A | 2,098,254 | 58,352,443.74 | 1.09 |
| 16 | 300498 | 温氏股份 | 1,602,332 | 57,459,625.52 | 1.07 |
| 17 | 601398 | 工商银行 | 9,279,200 | 54,654,488.00 | 1.02 |
| 18 | 601668 | 中国建筑 | 9,030,600 | 51,925,950.00 | 0.97 |
| 19 | 000001 | 平安银行 | 3,699,026 | 50,972,578.28 | 0.95 |
| 20 | 600900 | 长江电力 | 2,847,034 | 50,961,908.60 | 0.95 |
| 21 | 601601 | 中国太保 | 1,355,927 | 49,504,894.77 | 0.92 |
| 22 | 600837 | 海通证券 | 3,488,300 | 49,498,977.00 | 0.92 |
| 23 | 002415 | 海康威视 | 1,608,516 | 44,362,871.28 | 0.83 |
| 24 | 600048 | 保利地产 | 3,076,750 | 39,259,330.00 | 0.73 |
| 25 | 600104 | 上汽集团 | 1,505,806 | 38,398,053.00 | 0.72 |
| 26 | 601169 | 北京银行 | 6,359,954 | 37,587,328.14 | 0.70 |
| 27 | 601888 | 中国国旅 | 420,718 | 37,296,650.70 | 0.69 |
| 28 | 603288 | 海天味业 | 349,200 | 36,666,000.00 | 0.68 |

| | | | | | |
|----|--------|------|------------|---------------|------|
| 29 | 600585 | 海螺水泥 | 860,150 | 35,696,225.00 | 0.66 |
| 30 | 601211 | 国泰君安 | 1,938,700 | 35,575,145.00 | 0.66 |
| 31 | 000725 | 京东方A | 10,181,400 | 35,024,016.00 | 0.65 |
| 32 | 601688 | 华泰证券 | 1,563,801 | 34,904,038.32 | 0.65 |
| 33 | 600009 | 上海机场 | 415,417 | 34,803,636.26 | 0.65 |
| 34 | 601988 | 中国银行 | 9,046,400 | 33,833,536.00 | 0.63 |
| 35 | 601766 | 中国中车 | 4,179,600 | 33,812,964.00 | 0.63 |
| 36 | 000063 | 中兴通讯 | 1,023,300 | 33,287,949.00 | 0.62 |
| 37 | 600031 | 三一重工 | 2,520,700 | 32,970,756.00 | 0.61 |
| 38 | 002304 | 洋河股份 | 260,481 | 31,664,070.36 | 0.59 |
| 39 | 600028 | 中国石化 | 5,749,400 | 31,449,218.00 | 0.59 |
| 40 | 300059 | 东方财富 | 2,305,876 | 31,244,619.80 | 0.58 |
| 41 | 600309 | 万华化学 | 676,001 | 28,926,082.79 | 0.54 |
| 42 | 601088 | 中国神华 | 1,414,900 | 28,835,662.00 | 0.54 |
| 43 | 601229 | 上海银行 | 2,348,900 | 27,834,465.00 | 0.52 |
| 44 | 002142 | 宁波银行 | 1,124,404 | 27,255,552.96 | 0.51 |
| 45 | 600690 | 海尔智家 | 1,569,200 | 27,131,468.00 | 0.51 |
| 46 | 002475 | 立讯精密 | 1,060,325 | 26,285,456.75 | 0.49 |
| 47 | 601818 | 光大银行 | 6,834,000 | 26,037,540.00 | 0.48 |
| 48 | 000568 | 泸州老窖 | 314,200 | 25,396,786.00 | 0.47 |
| 49 | 000338 | 潍柴动力 | 2,061,400 | 25,334,606.00 | 0.47 |
| 50 | 600340 | 华夏幸福 | 772,200 | 25,150,554.00 | 0.47 |
| 51 | 601012 | 隆基股份 | 1,088,052 | 25,144,881.72 | 0.47 |
| 52 | 600019 | 宝钢股份 | 3,821,300 | 24,838,450.00 | 0.46 |
| 53 | 600050 | 中国联通 | 4,004,400 | 24,667,104.00 | 0.46 |
| 54 | 601857 | 中国石油 | 3,477,000 | 23,921,760.00 | 0.45 |
| 55 | 002027 | 分众传媒 | 4,413,000 | 23,344,770.00 | 0.43 |
| 56 | 601989 | 中国重工 | 3,928,713 | 21,843,644.28 | 0.41 |
| 57 | 600919 | 江苏银行 | 2,974,700 | 21,596,322.00 | 0.40 |
| 58 | 601939 | 建设银行 | 2,885,021 | 21,464,556.24 | 0.40 |
| 59 | 001979 | 招商蛇口 | 1,018,739 | 21,291,645.10 | 0.40 |
| 60 | 002714 | 牧原股份 | 359,660 | 21,144,411.40 | 0.39 |
| 61 | 601009 | 南京银行 | 2,553,600 | 21,092,736.00 | 0.39 |
| 62 | 600999 | 招商证券 | 1,226,595 | 20,962,508.55 | 0.39 |
| 63 | 601390 | 中国中铁 | 3,203,200 | 20,884,864.00 | 0.39 |
| 64 | 002230 | 科大讯飞 | 627,403 | 20,854,875.72 | 0.39 |
| 65 | 601006 | 大秦铁路 | 2,553,257 | 20,655,849.13 | 0.38 |
| 66 | 600015 | 华夏银行 | 2,645,400 | 20,369,580.00 | 0.38 |
| 67 | 601628 | 中国人寿 | 716,500 | 20,291,280.00 | 0.38 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 68 | 000661 | 长春高新 | 58,800 | 19,874,400.00 | 0.37 |
| 69 | 002594 | 比亚迪 | 391,600 | 19,861,952.00 | 0.37 |
| 70 | 601336 | 新华保险 | 360,200 | 19,821,806.00 | 0.37 |
| 71 | 601186 | 中国铁建 | 1,975,900 | 19,660,205.00 | 0.37 |
| 72 | 601899 | 紫金矿业 | 5,192,750 | 19,576,667.50 | 0.36 |
| 73 | 000166 | 申万宏源 | 3,878,161 | 19,429,586.61 | 0.36 |
| 74 | 600570 | 恒生电子 | 277,080 | 18,883,002.00 | 0.35 |
| 75 | 000538 | 云南白药 | 224,000 | 18,686,080.00 | 0.35 |
| 76 | 002024 | 苏宁易购 | 1,602,700 | 18,398,996.00 | 0.34 |
| 77 | 600352 | 浙江龙盛 | 1,115,900 | 17,597,743.00 | 0.33 |
| 78 | 000776 | 广发证券 | 1,267,100 | 17,409,954.00 | 0.32 |
| 79 | 601669 | 中国电建 | 3,289,600 | 17,401,984.00 | 0.32 |
| 80 | 601933 | 永辉超市 | 1,643,000 | 16,775,030.00 | 0.31 |
| 81 | 300015 | 爱尔眼科 | 535,739 | 16,591,836.83 | 0.31 |
| 82 | 600958 | 东方证券 | 1,534,000 | 16,383,120.00 | 0.31 |
| 83 | 601225 | 陕西煤业 | 1,713,400 | 15,831,816.00 | 0.29 |
| 84 | 000876 | 新希望 | 905,800 | 15,733,746.00 | 0.29 |
| 85 | 601155 | 新城控股 | 389,300 | 15,498,033.00 | 0.29 |
| 86 | 000100 | TCL 集团 | 4,653,800 | 15,497,154.00 | 0.29 |
| 87 | 300142 | 沃森生物 | 531,200 | 15,064,832.00 | 0.28 |
| 88 | 600436 | 片仔癀 | 130,300 | 15,010,560.00 | 0.28 |
| 89 | 600406 | 国电南瑞 | 792,100 | 14,764,744.00 | 0.27 |
| 90 | 002202 | 金风科技 | 1,184,848 | 14,727,660.64 | 0.27 |
| 91 | 600741 | 华域汽车 | 673,973 | 14,557,816.80 | 0.27 |
| 92 | 600588 | 用友网络 | 536,247 | 14,414,319.36 | 0.27 |
| 93 | 002736 | 国信证券 | 1,055,100 | 13,885,116.00 | 0.26 |
| 94 | 600660 | 福耀玻璃 | 602,271 | 13,689,619.83 | 0.25 |
| 95 | 601377 | 兴业证券 | 2,026,300 | 13,657,262.00 | 0.25 |
| 96 | 000157 | 中联重科 | 2,205,600 | 13,255,656.00 | 0.25 |
| 97 | 600010 | 包钢股份 | 7,829,900 | 13,232,531.00 | 0.25 |
| 98 | 600547 | 山东黄金 | 318,700 | 13,120,879.00 | 0.24 |
| 99 | 000783 | 长江证券 | 1,677,900 | 13,104,399.00 | 0.24 |
| 100 | 600795 | 国电电力 | 5,128,000 | 13,025,120.00 | 0.24 |
| 101 | 002008 | 大族激光 | 368,800 | 12,679,344.00 | 0.24 |
| 102 | 600705 | 中航资本 | 2,312,186 | 12,532,048.12 | 0.23 |
| 103 | 601901 | 方正证券 | 1,753,600 | 12,468,096.00 | 0.23 |
| 104 | 601111 | 中国国航 | 1,301,900 | 12,459,183.00 | 0.23 |
| 105 | 000069 | 华侨城 A | 1,763,400 | 12,255,630.00 | 0.23 |
| 106 | 603993 | 洛阳钼业 | 3,073,000 | 12,169,080.00 | 0.23 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 107 | 600111 | 北方稀土 | 935,300 | 12,009,252.00 | 0.22 |
| 108 | 600703 | 三安光电 | 1,050,422 | 11,848,760.16 | 0.22 |
| 109 | 601108 | 财通证券 | 1,076,000 | 11,814,480.00 | 0.22 |
| 110 | 600011 | 华能国际 | 1,895,300 | 11,807,719.00 | 0.22 |
| 111 | 600438 | 通威股份 | 837,100 | 11,769,626.00 | 0.22 |
| 112 | 600089 | 特变电工 | 1,620,200 | 11,746,450.00 | 0.22 |
| 113 | 600383 | 金地集团 | 978,800 | 11,677,084.00 | 0.22 |
| 114 | 600029 | 南方航空 | 1,500,400 | 11,583,088.00 | 0.22 |
| 115 | 601800 | 中国交建 | 1,022,600 | 11,575,832.00 | 0.22 |
| 116 | 600886 | 国投电力 | 1,458,300 | 11,330,991.00 | 0.21 |
| 117 | 002236 | 大华股份 | 770,350 | 11,185,482.00 | 0.21 |
| 118 | 601985 | 中国核电 | 1,999,400 | 11,116,664.00 | 0.21 |
| 119 | 600196 | 复星医药 | 438,200 | 11,086,460.00 | 0.21 |
| 120 | 600271 | 航天信息 | 478,500 | 11,029,425.00 | 0.21 |
| 121 | 601600 | 中国铝业 | 2,809,300 | 11,012,456.00 | 0.21 |
| 122 | 002422 | 科伦药业 | 369,200 | 10,976,316.00 | 0.20 |
| 123 | 002007 | 华兰生物 | 358,700 | 10,936,763.00 | 0.20 |
| 124 | 600606 | 绿地控股 | 1,585,800 | 10,831,014.00 | 0.20 |
| 125 | 000895 | 双汇发展 | 431,310 | 10,735,305.90 | 0.20 |
| 126 | 300003 | 乐普医疗 | 465,640 | 10,719,032.80 | 0.20 |
| 127 | 601555 | 东吴证券 | 1,045,300 | 10,714,325.00 | 0.20 |
| 128 | 002001 | 新和成 | 554,600 | 10,698,234.00 | 0.20 |
| 129 | 600115 | 东方航空 | 1,705,800 | 10,695,366.00 | 0.20 |
| 130 | 002311 | 海大集团 | 338,300 | 10,453,470.00 | 0.19 |
| 131 | 600109 | 国金证券 | 1,053,400 | 10,239,048.00 | 0.19 |
| 132 | 600061 | 国投资本 | 727,890 | 10,197,738.90 | 0.19 |
| 133 | 600221 | 海航控股 | 5,014,500 | 10,179,435.00 | 0.19 |
| 134 | 002044 | 美年健康 | 813,838 | 10,124,144.72 | 0.19 |
| 135 | 600332 | 白云山 | 243,999 | 9,996,639.03 | 0.19 |
| 136 | 300124 | 汇川技术 | 435,100 | 9,968,141.00 | 0.19 |
| 137 | 000963 | 华东医药 | 379,620 | 9,854,935.20 | 0.18 |
| 138 | 601788 | 光大证券 | 851,500 | 9,724,130.00 | 0.18 |
| 139 | 002410 | 广联达 | 295,600 | 9,722,284.00 | 0.18 |
| 140 | 600177 | 雅戈尔 | 1,530,798 | 9,720,567.30 | 0.18 |
| 141 | 000413 | 东旭光电 | 1,876,200 | 9,643,668.00 | 0.18 |
| 142 | 600522 | 中天科技 | 1,050,900 | 9,636,753.00 | 0.18 |
| 143 | 600018 | 上港集团 | 1,410,500 | 9,619,610.00 | 0.18 |
| 144 | 600487 | 亨通光电 | 570,809 | 9,566,758.84 | 0.18 |
| 145 | 000768 | 中航飞机 | 603,500 | 9,505,125.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 146 | 600637 | 东方明珠 | 898,424 | 9,469,388.96 | 0.18 |
| 147 | 601618 | 中国中冶 | 3,104,754 | 9,438,452.16 | 0.18 |
| 148 | 603019 | 中科曙光 | 266,280 | 9,346,428.00 | 0.17 |
| 149 | 600100 | 同方股份 | 1,020,900 | 9,239,145.00 | 0.17 |
| 150 | 601607 | 上海医药 | 503,168 | 9,132,499.20 | 0.17 |
| 151 | 000425 | 徐工机械 | 2,045,700 | 9,123,822.00 | 0.17 |
| 152 | 300033 | 同花顺 | 92,460 | 9,094,365.60 | 0.17 |
| 153 | 300122 | 智飞生物 | 207,600 | 8,947,560.00 | 0.17 |
| 154 | 002352 | 顺丰控股 | 263,000 | 8,931,480.00 | 0.17 |
| 155 | 600893 | 航发动力 | 392,963 | 8,924,189.73 | 0.17 |
| 156 | 300017 | 网宿科技 | 825,200 | 8,895,656.00 | 0.17 |
| 157 | 002271 | 东方雨虹 | 391,600 | 8,873,656.00 | 0.17 |
| 158 | 300408 | 三环集团 | 455,735 | 8,864,045.75 | 0.17 |
| 159 | 600176 | 中国巨石 | 916,800 | 8,737,104.00 | 0.16 |
| 160 | 600516 | 方大炭素 | 692,552 | 8,511,464.08 | 0.16 |
| 161 | 600498 | 烽火通信 | 305,500 | 8,511,230.00 | 0.16 |
| 162 | 601877 | 正泰电器 | 366,685 | 8,466,756.65 | 0.16 |
| 163 | 601919 | 中远海控 | 1,686,300 | 8,465,226.00 | 0.16 |
| 164 | 300136 | 信维通信 | 339,581 | 8,302,755.45 | 0.15 |
| 165 | 601727 | 上海电气 | 1,535,300 | 8,259,914.00 | 0.15 |
| 166 | 600004 | 白云机场 | 451,000 | 8,208,200.00 | 0.15 |
| 167 | 000728 | 国元证券 | 879,400 | 8,064,098.00 | 0.15 |
| 168 | 600867 | 通化东宝 | 522,695 | 8,049,503.00 | 0.15 |
| 169 | 601998 | 中信银行 | 1,335,300 | 7,971,741.00 | 0.15 |
| 170 | 002460 | 赣锋锂业 | 339,750 | 7,960,342.50 | 0.15 |
| 171 | 000423 | 东阿阿胶 | 198,100 | 7,888,342.00 | 0.15 |
| 172 | 600023 | 浙能电力 | 1,777,000 | 7,854,340.00 | 0.15 |
| 173 | 600809 | 山西汾酒 | 112,500 | 7,768,125.00 | 0.14 |
| 174 | 600489 | 中金黄金 | 752,400 | 7,727,148.00 | 0.14 |
| 175 | 002673 | 西部证券 | 764,500 | 7,706,160.00 | 0.14 |
| 176 | 002466 | 天齐锂业 | 298,745 | 7,552,273.60 | 0.14 |
| 177 | 600066 | 宇通客车 | 579,400 | 7,543,788.00 | 0.14 |
| 178 | 600068 | 葛洲坝 | 1,204,500 | 7,504,035.00 | 0.14 |
| 179 | 601018 | 宁波港 | 1,700,900 | 7,466,951.00 | 0.14 |
| 180 | 600926 | 杭州银行 | 895,200 | 7,457,016.00 | 0.14 |
| 181 | 002179 | 中航光电 | 222,410 | 7,441,838.60 | 0.14 |
| 182 | 002241 | 歌尔股份 | 835,818 | 7,430,422.02 | 0.14 |
| 183 | 300144 | 宋城演艺 | 316,500 | 7,323,810.00 | 0.14 |
| 184 | 600170 | 上海建工 | 1,944,300 | 7,310,568.00 | 0.14 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 185 | 002081 | 金螳螂 | 703,500 | 7,253,085.00 | 0.14 |
| 186 | 300024 | 机器人 | 475,900 | 7,247,957.00 | 0.13 |
| 187 | 601997 | 贵阳银行 | 826,840 | 7,152,166.00 | 0.13 |
| 188 | 601198 | 东兴证券 | 601,448 | 7,145,202.24 | 0.13 |
| 189 | 600362 | 江西铜业 | 452,200 | 7,117,628.00 | 0.13 |
| 190 | 002146 | 荣盛发展 | 757,800 | 7,115,742.00 | 0.13 |
| 191 | 600482 | 中国动力 | 301,017 | 7,110,021.54 | 0.13 |
| 192 | 600398 | 海澜之家 | 783,559 | 7,106,880.13 | 0.13 |
| 193 | 600219 | 南山铝业 | 3,123,560 | 7,059,245.60 | 0.13 |
| 194 | 600085 | 同仁堂 | 242,300 | 7,026,700.00 | 0.13 |
| 195 | 000961 | 中南建设 | 807,900 | 6,996,414.00 | 0.13 |
| 196 | 601021 | 春秋航空 | 155,000 | 6,975,000.00 | 0.13 |
| 197 | 002602 | 世纪华通 | 632,856 | 6,910,787.52 | 0.13 |
| 198 | 600674 | 川投能源 | 766,700 | 6,823,630.00 | 0.13 |
| 199 | 601881 | 中国银河 | 554,716 | 6,795,271.00 | 0.13 |
| 200 | 601838 | 成都银行 | 766,800 | 6,770,844.00 | 0.13 |
| 201 | 000703 | 恒逸石化 | 494,700 | 6,757,602.00 | 0.13 |
| 202 | 000630 | 铜陵有色 | 2,722,600 | 6,697,596.00 | 0.12 |
| 203 | 000786 | 北新建材 | 367,300 | 6,659,149.00 | 0.12 |
| 204 | 603156 | 养元饮品 | 179,210 | 6,645,106.80 | 0.12 |
| 205 | 002493 | 荣盛石化 | 542,650 | 6,544,359.00 | 0.12 |
| 206 | 002739 | 万达电影 | 353,800 | 6,524,072.00 | 0.12 |
| 207 | 002456 | 欧菲光 | 825,900 | 6,475,056.00 | 0.12 |
| 208 | 300070 | 碧水源 | 829,500 | 6,461,805.00 | 0.12 |
| 209 | 600535 | 天士力 | 389,964 | 6,453,904.20 | 0.12 |
| 210 | 603986 | 兆易创新 | 73,800 | 6,398,460.00 | 0.12 |
| 211 | 000629 | 攀钢钒钛 | 1,886,500 | 6,395,235.00 | 0.12 |
| 212 | 600297 | 广汇汽车 | 1,405,000 | 6,266,300.00 | 0.12 |
| 213 | 002050 | 三花智控 | 585,490 | 6,176,919.50 | 0.12 |
| 214 | 601138 | 工业富联 | 511,000 | 6,157,550.00 | 0.11 |
| 215 | 002555 | 三七互娱 | 454,100 | 6,153,055.00 | 0.11 |
| 216 | 600663 | 陆家嘴 | 389,800 | 6,041,900.00 | 0.11 |
| 217 | 600369 | 西南证券 | 1,210,300 | 5,978,882.00 | 0.11 |
| 218 | 603799 | 华友钴业 | 279,724 | 5,960,918.44 | 0.11 |
| 219 | 300296 | 利亚德 | 758,600 | 5,939,838.00 | 0.11 |
| 220 | 603833 | 欧派家居 | 54,653 | 5,881,755.86 | 0.11 |
| 221 | 000596 | 古井贡酒 | 49,600 | 5,878,096.00 | 0.11 |
| 222 | 600118 | 中国卫星 | 260,600 | 5,876,530.00 | 0.11 |
| 223 | 002624 | 完美世界 | 224,400 | 5,791,764.00 | 0.11 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 224 | 600208 | 新湖中宝 | 1,843,167 | 5,787,544.38 | 0.11 |
| 225 | 000625 | 长安汽车 | 862,900 | 5,721,027.00 | 0.11 |
| 226 | 600346 | 恒力石化 | 462,880 | 5,628,620.80 | 0.10 |
| 227 | 002065 | 东华软件 | 800,900 | 5,598,291.00 | 0.10 |
| 228 | 002508 | 老板电器 | 203,871 | 5,533,058.94 | 0.10 |
| 229 | 000656 | 金科股份 | 914,200 | 5,512,626.00 | 0.10 |
| 230 | 603160 | 汇顶科技 | 39,400 | 5,468,720.00 | 0.10 |
| 231 | 000709 | 河钢股份 | 1,824,100 | 5,454,059.00 | 0.10 |
| 232 | 000627 | 天茂集团 | 839,900 | 5,450,951.00 | 0.10 |
| 233 | 600027 | 华电国际 | 1,437,000 | 5,417,490.00 | 0.10 |
| 234 | 600153 | 建发股份 | 609,300 | 5,410,584.00 | 0.10 |
| 235 | 002032 | 苏泊尔 | 71,200 | 5,399,096.00 | 0.10 |
| 236 | 601992 | 金隅集团 | 1,426,000 | 5,361,760.00 | 0.10 |
| 237 | 601878 | 浙商证券 | 572,700 | 5,326,110.00 | 0.10 |
| 238 | 600038 | 中直股份 | 129,687 | 5,319,760.74 | 0.10 |
| 239 | 600760 | 中航沈飞 | 183,200 | 5,318,296.00 | 0.10 |
| 240 | 600583 | 海油工程 | 948,300 | 5,310,480.00 | 0.10 |
| 241 | 002153 | 石基信息 | 142,200 | 5,146,218.00 | 0.10 |
| 242 | 601117 | 中国化学 | 849,800 | 5,115,796.00 | 0.10 |
| 243 | 600977 | 中国电影 | 319,300 | 5,000,238.00 | 0.09 |
| 244 | 603858 | 步长制药 | 193,380 | 4,983,402.60 | 0.09 |
| 245 | 002558 | 巨人网络 | 269,697 | 4,900,394.49 | 0.09 |
| 246 | 600688 | 上海石化 | 939,000 | 4,845,240.00 | 0.09 |
| 247 | 600415 | 小商品城 | 1,166,400 | 4,805,568.00 | 0.09 |
| 248 | 601216 | 君正集团 | 1,453,700 | 4,782,673.00 | 0.09 |
| 249 | 600816 | 安信信托 | 943,385 | 4,764,094.25 | 0.09 |
| 250 | 000671 | 阳光城 | 719,900 | 4,664,952.00 | 0.09 |
| 251 | 601238 | 广汽集团 | 409,340 | 4,474,086.20 | 0.08 |
| 252 | 601319 | 中国人保 | 467,600 | 4,437,524.00 | 0.08 |
| 253 | 002252 | 上海莱士 | 631,800 | 4,391,010.00 | 0.08 |
| 254 | 601633 | 长城汽车 | 528,700 | 4,372,349.00 | 0.08 |
| 255 | 600566 | 济川药业 | 144,614 | 4,354,327.54 | 0.08 |
| 256 | 600188 | 兖州煤业 | 391,284 | 4,253,257.08 | 0.08 |
| 257 | 002010 | 传化智联 | 563,300 | 4,241,649.00 | 0.08 |
| 258 | 002310 | 东方园林 | 686,800 | 4,120,800.00 | 0.08 |
| 259 | 600704 | 物产中大 | 760,275 | 4,120,690.50 | 0.08 |
| 260 | 000402 | 金融街 | 522,600 | 4,097,184.00 | 0.08 |
| 261 | 601066 | 中信建投 | 193,000 | 4,068,440.00 | 0.08 |
| 262 | 002294 | 信立泰 | 179,747 | 4,022,737.86 | 0.07 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 263 | 002601 | 龙鳞佰利 | 268,800 | 3,986,304.00 | 0.07 |
| 264 | 300072 | 三聚环保 | 502,215 | 3,982,564.95 | 0.07 |
| 265 | 603259 | 药明康德 | 45,100 | 3,909,268.00 | 0.07 |
| 266 | 000898 | 鞍钢股份 | 1,025,700 | 3,887,403.00 | 0.07 |
| 267 | 002120 | 韵达股份 | 122,500 | 3,775,450.00 | 0.07 |
| 268 | 601898 | 中煤能源 | 783,500 | 3,760,800.00 | 0.07 |
| 269 | 601360 | 三六零 | 174,422 | 3,729,142.36 | 0.07 |
| 270 | 002773 | 康弘药业 | 112,110 | 3,690,661.20 | 0.07 |
| 271 | 300413 | 芒果超媒 | 89,700 | 3,682,185.00 | 0.07 |
| 272 | 000938 | 紫光股份 | 126,852 | 3,456,717.00 | 0.06 |
| 273 | 600372 | 中航电子 | 232,400 | 3,448,816.00 | 0.06 |
| 274 | 601228 | 广州港 | 825,000 | 3,448,500.00 | 0.06 |
| 275 | 002468 | 申通快递 | 134,200 | 3,346,948.00 | 0.06 |
| 276 | 002938 | 鹏鼎控股 | 113,600 | 3,335,296.00 | 0.06 |
| 277 | 002411 | 延安必康 | 191,207 | 3,327,001.80 | 0.06 |
| 278 | 600025 | 华能水电 | 797,400 | 3,245,418.00 | 0.06 |
| 279 | 000415 | 渤海租赁 | 824,900 | 3,233,608.00 | 0.06 |
| 280 | 600339 | 中油工程 | 745,950 | 3,147,909.00 | 0.06 |
| 281 | 600998 | 九州通 | 246,976 | 3,052,623.36 | 0.06 |
| 282 | 300251 | 光线传媒 | 390,988 | 2,658,718.40 | 0.05 |
| 283 | 002939 | 长城证券 | 150,300 | 2,508,507.00 | 0.05 |
| 284 | 601808 | 中海油服 | 260,199 | 2,505,716.37 | 0.05 |
| 285 | 300433 | 蓝思科技 | 352,138 | 2,454,401.86 | 0.05 |
| 286 | 601162 | 天风证券 | 225,000 | 2,439,000.00 | 0.05 |
| 287 | 002925 | 盈趣科技 | 61,200 | 2,387,412.00 | 0.04 |
| 288 | 000408 | 藏格控股 | 263,500 | 2,179,145.00 | 0.04 |
| 289 | 600390 | 五矿资本 | 226,400 | 2,134,952.00 | 0.04 |
| 290 | 002945 | 华林证券 | 113,700 | 2,103,450.00 | 0.04 |
| 291 | 600233 | 圆通速递 | 163,800 | 2,019,654.00 | 0.04 |
| 292 | 601828 | 美凯龙 | 165,800 | 2,014,470.00 | 0.04 |
| 293 | 000553 | 安道麦 A | 187,200 | 2,006,784.00 | 0.04 |
| 294 | 603260 | 合盛硅业 | 40,700 | 1,915,342.00 | 0.04 |
| 295 | 002625 | 光启技术 | 193,070 | 1,793,620.30 | 0.03 |
| 296 | 601298 | 青岛港 | 200,000 | 1,678,000.00 | 0.03 |
| 297 | 601212 | 白银有色 | 376,200 | 1,651,518.00 | 0.03 |
| 298 | 601577 | 长沙银行 | 156,000 | 1,488,240.00 | 0.03 |
| 299 | 600733 | 北汽蓝谷 | 168,000 | 1,387,680.00 | 0.03 |
| 300 | 600299 | 安迪苏 | 123,700 | 1,282,769.00 | 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 | 0.01 |
| 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 | 300498 | 温氏股份 | 63,353,029.43 | 1.47 |
| 2 | 601166 | 兴业银行 | 24,873,198.73 | 0.58 |
| 3 | 000651 | 格力电器 | 23,320,454.92 | 0.54 |
| 4 | 000333 | 美的集团 | 20,137,722.69 | 0.47 |
| 5 | 601088 | 中国神华 | 19,625,627.97 | 0.46 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 18,215,615.80 | 0.42 |
| 7 | 601108 | 财通证券 | 17,759,293.10 | 0.41 |
| 8 | 000858 | 五粮液 | 15,969,119.37 | 0.37 |
| 9 | 002027 | 分众传媒 | 15,025,657.61 | 0.35 |
| 10 | 300059 | 东方财富 | 12,835,188.00 | 0.30 |
| 11 | 600519 | 贵州茅台 | 12,446,528.00 | 0.29 |
| 12 | 002714 | 牧原股份 | 12,057,767.53 | 0.28 |
| 13 | 601318 | 中国平安 | 11,865,853.71 | 0.28 |
| 14 | 000002 | 万科A | 11,155,421.92 | 0.26 |
| 15 | 000661 | 长春高新 | 10,620,764.23 | 0.25 |
| 16 | 000166 | 申万宏源 | 10,443,754.60 | 0.24 |

| | | | | |
|----|--------|------|---------------|------|
| 17 | 603019 | 中科曙光 | 10,280,856.15 | 0.24 |
| 18 | 601838 | 成都银行 | 9,631,923.46 | 0.22 |
| 19 | 603156 | 养元饮品 | 9,188,580.11 | 0.21 |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 8,836,929.84 | 0.21 |

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 | 000651 | 格力电器 | 28,808,569.51 | 0.67 |
| 2 | 000333 | 美的集团 | 26,632,701.67 | 0.62 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 23,079,598.85 | 0.54 |
| 4 | 600519 | 贵州茅台 | 19,641,065.00 | 0.46 |
| 5 | 000858 | 五粮液 | 19,515,566.00 | 0.45 |
| 6 | 000002 | 万科A | 15,118,623.23 | 0.35 |
| 7 | 601166 | 兴业银行 | 12,029,809.00 | 0.28 |
| 8 | 002415 | 海康威视 | 11,895,557.08 | 0.28 |
| 9 | 000001 | 平安银行 | 11,724,826.36 | 0.27 |
| 10 | 000661 | 长春高新 | 11,177,770.00 | 0.26 |
| 11 | 002027 | 分众传媒 | 9,748,061.38 | 0.23 |
| 12 | 000725 | 京东方A | 9,621,721.00 | 0.22 |
| 13 | 600036 | 招商银行 | 9,562,137.49 | 0.22 |
| 14 | 601088 | 中国神华 | 9,382,938.00 | 0.22 |
| 15 | 600276 | 恒瑞医药 | 9,347,663.34 | 0.22 |
| 16 | 300059 | 东方财富 | 9,128,655.09 | 0.21 |
| 17 | 601108 | 财通证券 | 8,638,376.35 | 0.20 |
| 18 | 002304 | 洋河股份 | 8,475,516.52 | 0.20 |
| 19 | 002714 | 牧原股份 | 7,631,038.72 | 0.18 |
| 20 | 000063 | 中兴通讯 | 7,583,890.00 | 0.18 |

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 | 738,955,364.87 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 757,178,558.48 |

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 |
|-------------------|-----------|----------|---------------|--------------|--------------|
| IF1909 | 沪深 300 指数 | 19 | 21,613,260.00 | 1,472,310.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 1,472,310.00 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | 1,186,176.70 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 1,783,458.00 |

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

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

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

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

7.12.2

基金投资的前十名股票中，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 | 2,307,634.94 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 9,111.74 |
| 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 | 2,510,431.05 |

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**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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 |
| 2 | 300788 | 中信出版 | 23,106.60 | 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 |
| 3,880 | 352,280.93 | 1,081,060,982.00 | 79.09% | 52,845,452.00 | 3.87% |

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 |
|---------------------------------|----------------|--------|
| 平安沪深 300 交易型开放式指数证 券投资基金联接基金 | 232,943,558.00 | 17.04% |

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 | 921,673,706.00 | 67.43% |
| 2 | 平安大华基金-平安银行-平安证券 股份有限公司 | 101,212,936.00 | 7.40% |
| 3 | 新华资管-中国银行-新华资产-明仁 五号资产管理产品 | 7,000,000.00 | 0.51% |
| 4 | 新华人寿保险股份有限公司 | 6,688,672.00 | 0.49% |
| 5 | 中信证券股份有限公司 | 6,172,885.00 | 0.45% |
| 6 | 新华人寿保险股份有限公司-新分红 产品 | 4,898,000.00 | 0.36% |
| 7 | 方正证券股份有限公司 | 3,119,140.00 | 0.23% |
| 8 | 联储证券有限责任公司 | 2,729,700.00 | 0.20% |
| 9 | 海通证券股份有限公司 | 2,700,000.00 | 0.20% |
| 10 | 中国国际金融股份有限公司 | 2,106,897.00 | 0.23% |
| 11 | 平安沪深 300 交易型开放式指数证 券投资基金联接基 | 232,943,558.00 | 17.04% |

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（2017 年 12 月 25 日）基金份额总额 | 5,723,055,617.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 1,402,849,992.00 |
| 本报告期期间基金总申购份额 | 222,300,000.00 |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 258,300,000.00 |
| 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 | 1,366,849,992.00 |

§ 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 | |
| 广发证券 | 1 | 502,471,656.84 | 33.63% | 357,397.11 | 33.63% | - |
| 平安证券 | 2 | 470,105,270.97 | 31.47% | 334,388.57 | 31.47% | - |
| 招商证券 | 3 | 363,213,428.95 | 24.31% | 258,357.86 | 24.31% | - |
| 东方证券 | 2 | 79,567,410.01 | 5.33% | 56,596.99 | 5.33% | - |
| 中信建投 | 2 | 78,659,813.61 | 5.26% | 55,951.49 | 5.27% | - |
| 长城证券 | 2 | - | - | - | - | 新增 2 个 |
| 中泰证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 4 | - | - | - | - | - |

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。其中招商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 |
| 广发证券 | - | - | 185,000,000.00 | 39.19% | - | - |
| 平安证券 | - | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|-------|---|---|----------------|--------|---|---|
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | 287,000,000.00 | 60.81% | - | - |
| 中信建投 | - | - | - | - | - | - |
| 长城证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证券 | - | - | - | - | - | - |
| 爱建证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 平安沪深 300 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19日 |
| 4 | 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2018 年第 2 期）以及摘要 | 中国证监会指定报刊及网站 | 2019年2月2日 |
| 5 | 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 |
| 6 | 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 |
| 7 | 平安沪深 300 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27日 |
| 8 | 平安沪深 300 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19日 |
| 9 | 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 |
| 10 | 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 |
| 11 | 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者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 2019/01/01--2019/06/30 | 921,673,706.00 | 0.00 | 0.00 | 921,673,706.00 | 67.43% |
| 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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
- 3、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
- 4、平安沪深 300 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 23 日