

平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2023 年第 1 季度报告

2023 年 3 月 31 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

报告送出日期：2023 年 4 月 22 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 2023 年 04 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 03 月 31 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	平安沪深 300 指数量化增强
基金主代码	005113
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2017 年 12 月 26 日
报告期末基金份额总额	395,763,321.97 份
投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过全样本复制的方式拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的投资管理，以达到或超越具有良好市场代表性、流动性与投资性的沪深 300 指数的收益率水平，为投资者提供一个有效分享中国经济持续增长过程中带来的系统性投资机会。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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	
下属分级基金的基金简称	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
下属分级基金的交易代码	005113	005114
报告期末下属分级基金的份额总额	281,986,158.62 份	113,777,163.35 份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 1 月 1 日-2023 年 3 月 31 日）	
	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
1. 本期已实现收益	-5,738,149.53	-2,548,793.86
2. 本期利润	-2,141,582.07	-2,000,224.81
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0096	-0.0212
4. 期末基金资产净值	356,218,345.96	139,392,005.97
5. 期末基金份额净值	1.2632	1.2251

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安沪深 300 指数量化增强 A

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	1.09%	0.75%	4.41%	0.81%	-3.32%	-0.06%
过去六个月	3.10%	0.99%	6.18%	1.04%	-3.08%	-0.05%
过去一年	-2.73%	1.06%	-3.78%	1.09%	1.05%	-0.03%
过去三年	34.28%	1.19%	9.71%	1.14%	24.57%	0.05%
过去五年	36.24%	1.24%	4.30%	1.22%	31.94%	0.02%
自基金合同	26.32%	1.23%	0.82%	1.22%	25.50%	0.01%

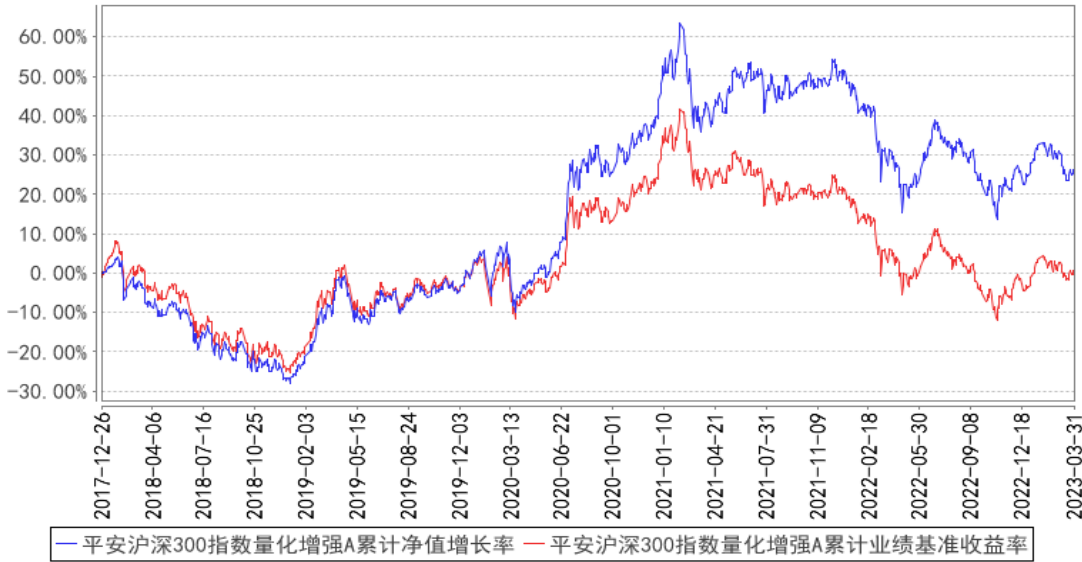
生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

平安沪深 300 指数量化增强 C

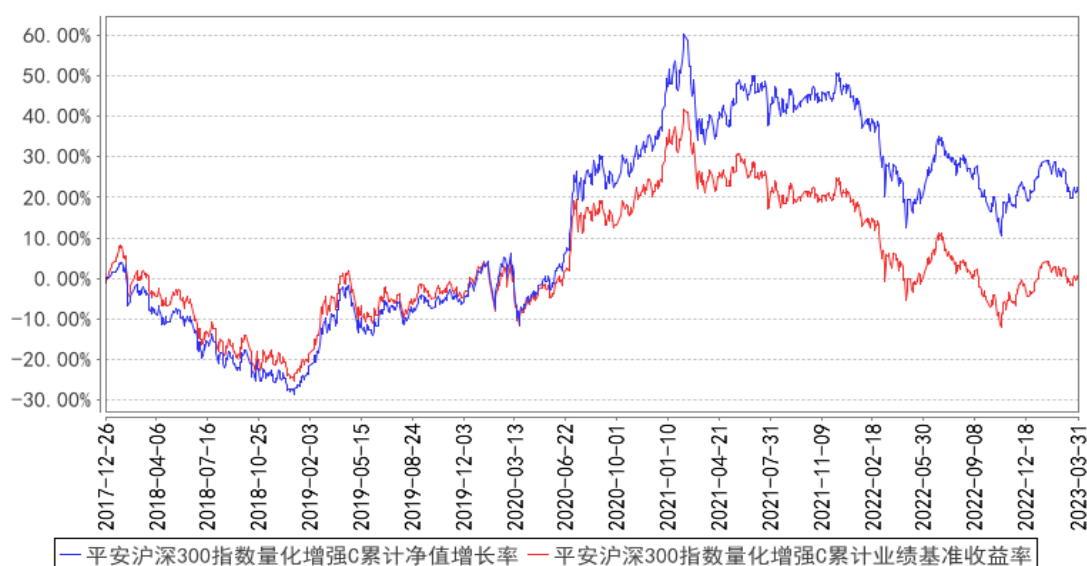
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.96%	0.75%	4.41%	0.81%	-3.45%	-0.06%
过去六个月	2.85%	0.99%	6.18%	1.04%	-3.33%	-0.05%
过去一年	-3.22%	1.06%	-3.78%	1.09%	0.56%	-0.03%
过去三年	32.30%	1.19%	9.71%	1.14%	22.59%	0.05%
过去五年	32.33%	1.24%	4.30%	1.22%	28.03%	0.02%
自基金合同生效起至今	22.51%	1.23%	0.82%	1.22%	21.69%	0.01%

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

平安沪深300指数量化增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



平安沪深300指数量化增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2017 年 12 月 26 日正式生效；

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

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
俞瑶	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金经理	2021 年 11 月 4 日	—	11 年	俞瑶女士，香港科技大学投资管理专业硕士，曾先后担任南京证券股份有限公司投资顾问、深圳市万博汇投资控股有限公司运营风险管理经理、天风证券股份有限公司项目经理。2015 年 9 月加入平安基金管理有限公司，曾担任投资经理，现任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、平安双季增享 6 个月持有期债券型证券投资基金基金经理。

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决

定确认的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确认的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

一季度 A 股市场整体呈现震荡走势，报告期内沪深 300 指数上涨 4.63%。从板块上来看，一季度表现亮眼的为中特估、数字经济、人工智能等主题投资板块；从风格上来说，价值风格持续占优，成长风格相对弱势。3 月 PMI 延续扩张，生产、内需或有亮点，印证了经济修复的持续性；但 PMI 高位回落、1-2 月工业企业利润下降尚难指向经济将进入强复苏，后续不确定性仍存在。整体来看，目前经济修复的确定性较强，但修复斜率存在一定的不确定性。

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

指数的行业和风格偏离较小，所以本基金的股票交易换手率较低，通过长期持有优质个股，有效地降低了交易成本，在控制跟踪误差较小的同时，争取实现较高的超额收益与信息比率，给投资者带来相对基准指数更好的回报。此外本基金积极参与沪深两市新股询价申购，增厚基金的投资收益。

本基金跟踪的沪深 300 指数，整体偏向金融、食品饮料、电力设备新能源、医药、电子等行业，以沪深两市较大市值股票为主。目前我们对市场的判断为震荡上行。从情绪上来说，美联储加息进程接近尾声，银行业危机担忧缓解，外围扰动持续缓解带动市场情绪回暖。同时随着上市公司一季报披露期的来临，市场或将逐渐回归基本面为主导的行情，市场结构可能更加均衡。在配置结构上，后续还将继续重点关注景气度延续的方向，如国防军工和新能源中的新能源车、光伏、风电、储能等方向，以及困境反转相关板块，重点关注此前受疫情影响和房地产政策影响的行业或板块，以及未来一年周期反转的行业，包括出行链、大消费、金融地产及其产业链、半导体等。整体还将维持均衡配置。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安沪深 300 指数量化增强 A 的基金份额净值 1.2632 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.09%，同期业绩比较基准收益率为 4.41%；截至本报告期末平安沪深 300 指数量化增强 C 的基金份额净值 1.2251 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.96%，同期业绩比较基准收益率为 4.41%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	467,407,836.95	93.90
	其中：股票	467,407,836.95	93.90
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,409,469.70	0.68
	其中：债券	3,409,469.70	0.68
	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	26,564,519.73	5.34
8	其他资产	372,978.71	0.07
9	合计	497,754,805.09	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	5,574,601.40	1.12
B	采矿业	13,098,775.20	2.64
C	制造业	210,120,062.15	42.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,648,972.24	2.35
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	820,218.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	14,560,496.00	2.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,206,657.72	3.67
J	金融业	91,708,845.01	18.50
K	房地产业	5,705,553.00	1.15
L	租赁和商务服务业	5,478,801.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	8,906,776.00	1.80
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	2,155,239.00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	875,140.00	0.18
S	综合	-	-
	合计	388,860,136.72	78.46

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,013,166.08	13.72
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	1,495,913.62	0.30
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	4,077,727.65	0.82
J	金融业	1,609,945.00	0.32
K	房地产业	2,282,387.00	0.46
L	租赁和商务服务业	1,031,240.00	0.21
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	37,320.88	0.01
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	78,547,700.23	15.85

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	35,700	14,495,985.00	2.92
2	601601	中国太保	475,200	12,317,184.00	2.49
3	600036	招商银行	351,481	12,045,253.87	2.43
4	300059	东方财富	520,078	10,417,162.34	2.10
5	002271	东方雨虹	302,050	10,112,634.00	2.04
6	000858	五粮液	50,602	9,968,594.00	2.01
7	000568	泸州老窖	37,000	9,427,230.00	1.90
8	600600	青岛啤酒	62,200	7,501,320.00	1.51
9	600519	贵州茅台	3,500	6,370,000.00	1.29
10	002142	宁波银行	221,960	6,061,727.60	1.22

5.3.2 报告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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603255	鼎际得	102,500	6,033,150.00	1.22
2	600702	舍得酒业	28,100	5,535,700.00	1.12
3	601636	旗滨集团	434,800	4,534,964.00	0.92
4	688212	澳华内镜	47,996	3,116,860.24	0.63
5	300360	炬华科技	202,100	3,086,067.00	0.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	3,409,469.70	0.69
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	3,409,469.70	0.69

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	34,000	3,409,469.70	0.69

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期无国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

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

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 11 日作出甬银保监罚决字（2022）28 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位，根据相关规定，对其处以罚款 220 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 11 日作出甬银保监罚决字（2022）30 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）代理保险销售不规范，根据相关规定，对其处以罚款 30 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波银保监局于 2022 年 4 月 21 日作出甬银保监罚决字（2022）35 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位、授信管理不审慎、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错，根据相关规定，对其处以罚款 270 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于 2022 年 5 月 27 日作出甬银保监罚决字（2022）44 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司（以下简称“公司”）非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、违规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、违规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在欠缺，根据相关规定，对其处以罚款 290 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于 2022 年 9 月 8 日作出甬银保监罚决字（2022）60 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司柜面业务内控管理不到位，根据相关规定，对其处以 25 万元人民币的罚款。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 9 月 9 日作出银保监罚决字（2022）48 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司个人经营贷款挪用至房地产市场，个人经营贷款“三查”不到位，总行对分支机构管控不力承担管理责任，依据相关规定，对其处以罚款 460 万元。

中国人民银行于 2022 年 8 月 31 日作出银罚决字〔2022〕1 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司存在以下违法违规情况：1. 违反账户管理规定；2. 违反清算管理规定；3. 违反特约商户实名制管理规定；4. 违反支付机构备付金管理规定；5. 违反人民币反假有关规定；6. 占压财政存款或者资金；7. 违反国库科目设置和使用规定；8. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；9. 未按规定履行客户身份识别义务；10. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；11. 与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户；12. 违反个人金融信息保护规定；13. 违反金融营销宣传管理规定，依据相关规定，对其提出警告，没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 万元。

中国银行保险监督管理委员会宁波监管局于 2023 年 1 月 9 日作出甬银保监罚决字〔2023〕1 号处罚决定，由于宁波银行股份有限公司违规开展异地互联网贷款业务、互联网贷款业务整改不到位、资信见证业务开展不审慎、资信见证业务整改不到位、贷款“三查”不尽职、新产品管理不严格，依据相关规定，对其处以罚款 220 万元。

本基金管理人对上述公司进行了深入的了解和分析，认为该事项有利于公司规范开展业务，对公司的经营情况暂不会造成重大不利影响。我们对上述证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	163,292.59
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	209,686.12
6	其他应收款	—
7	其他	—
8	合计	372,978.71

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中无流通受限的股票。

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
报告期期初基金份额总额	162,540,912.19	54,088,524.96
报告期期间基金总申购份额	140,929,213.94	113,347,780.97
减：报告期期间基金总赎回份额	21,483,967.51	53,659,142.58
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	281,986,158.62	113,777,163.35

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

注：无

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：无

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2023/01/01--2023/02/19	60,593,020.76	-	-	60,593,020.76	15.31

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

为更好地满足投资者的需求，提升平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金（以下简称“本基金”）的市场竞争力，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）根据《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》的有关规定和《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同》的约定，经与基金托管人平安银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，于 2023 年 3 月 16 日启动了本基金证券交易模式的转换工作，上述转换工作已于 2023 年 3 月 17 日完成，修订后的《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金托管协议》自 2023 年 3 月 17 日起生效。

关于本基金证券交易模式转换的有关事项，详见 2023 年 3 月 14 日披露的《平安基金管理有限公司关于平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金证券交易模式转换有关事项的公告》。本公告未尽事宜，敬请投资者参见《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同》、《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金招募说明书》及其更新等相关的文件。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- （1）中国证监会准予平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同
- （3）平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金托管协议
- （4）法律意见书
- （5）基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所

9.3 查阅方式

(1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2023 年 4 月 22 日