

# 平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 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：2023 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1. 1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56

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 .....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	56
7.12 投资组合报告附注 .....	56
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
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 .....	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	58
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情况 .....	58
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	61
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>62</b>
12.1 备查文件目录 .....	62
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 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	沪深 300ETF 平安
基金主代码	510390
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	150,949,992.00 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 年 1 月 26 日

### 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	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	北京市西城区复兴门内大街 55

	5033 号平安金融中心 34 层	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-17,013,872.90
本期利润	757,090.75
加权平均基金份额本期利润	0.0046
本期加权平均净值利润率	0.11%
本期基金份额净值增长率	0.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-25,134,142.45
期末可供分配基金份额利润	-0.1665
期末基金资产净值	605,653,491.98
期末基金份额净值	4.0123
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	6.35%

- 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. 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	2.05%	0.86%	1.16%	0.87%	0.89%	-0.01%
过去三个月	-4.06%	0.83%	-5.15%	0.83%	1.09%	0.00%
过去六个月	0.25%	0.84%	-0.75%	0.84%	1.00%	0.00%
过去一年	-12.03%	0.98%	-14.33%	0.99%	2.30%	-0.01%
过去三年	2.25%	1.19%	-7.72%	1.20%	9.97%	-0.01%
自基金合同生效起至今	6.35%	1.26%	-5.23%	1.26%	11.58%	0.00%

#### 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



注：1、本基金基金合同于2017年12月25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成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、海外、专户七大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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	ETF 指数 投资中心 投资执行 总经理， 平安沪深 300 交 易型开放 式指 数证 券投 资基 金基 金经 理	2017 年 12 月 25 日	-	12 年	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 指数投资中心投资执行总经理。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、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数量型发起式证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

王仁增	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2021 年 7 月 8 日	-	9 年	<p>王仁增先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任财通基金管理有限公司产品经理、华安基金管理有限公司高级产品经理。2021 年 6 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心高级研究员、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金基金经理。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 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、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业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联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安上海金交易</p>
-----	-------------------------------	----------------	---	-----	--

					型开放式证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金基金经理助理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格执行交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3 日内、5 日内三个不同的时间窗口，对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析，各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差，不存在不公平交易的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内，所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的 5%。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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，本基金的年化跟踪误差 0.10%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 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 4.0123 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.25%，业绩比较基准收益率为-0.75%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2023 年下半年，市场对于政策面的预期更加积极。但在基本面上，投资者可能需要更多的耐心。无论是宏观经济还是微观企业盈利，当前经济修复的内生动能还不够强、需求依然偏弱，随着稳增长政策发力，有望推动基本面持续改善。在交易层面，市场交易量持续低位震荡表达了投资者对于当前市场保持较为谨慎的情绪。但随着政策推进，情绪面不会长期处在较低位置。从中长期角度看，当前 A 股市场估值较为合理，我们对 A 股市场前景保持相对乐观。

作为一只以紧密跟踪标的指数为目标的基金，本基金始终秉持持有人利益至上，严格按照基金合同的要求，做好投资组合管理。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值委员会的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 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

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他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，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6. 4. 7. 1	1, 218, 457. 18	14, 428, 645. 72
结算备付金		698, 049. 53	1, 894, 688. 76
存出保证金		1, 711, 627. 79	877, 546. 97
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	589, 280, 370. 71	741, 747, 957. 98
其中：股票投资		589, 280, 370. 71	741, 747, 957. 98
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6. 4. 7. 3	-	-
买入返售金融资产	6. 4. 7. 4	9, 995, 064. 11	-1, 170. 40
债权投资	6. 4. 7. 5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	6. 4. 7. 7	-	-
应收清算款		3, 465, 994. 12	3, 907, 376. 48
应收股利		9, 459. 14	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	81, 205. 46	1, 493. 36
资产总计		606, 460, 228. 04	762, 856, 538. 87
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		119, 525. 54	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		250, 284. 94	243, 323. 44
应付托管费		50, 057. 00	48, 664. 68
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6. 4. 7. 9	386, 868. 58	10, 766, 266. 08
负债合计		806, 736. 06	11, 058, 254. 20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6. 4. 7. 10	630, 787, 634. 43	784, 984, 818. 50
其他综合收益	6. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	6. 4. 7. 12	-25, 134, 142. 45	-33, 186, 533. 83
净资产合计		605, 653, 491. 98	751, 798, 284. 67
负债和净资产总计		606, 460, 228. 04	762, 856, 538. 87

注： 报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.0123 元，基金份额总额 150,949,992.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至2023 年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年6月30日
<b>一、营业收入</b>		3,094,472.81	-159,079,026.69
1. 利息收入		297,643.43	753,861.82
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 13	30,763.40	53,585.29
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		10,981.04	52,965.24
证券出借利息收入		255,898.99	647,311.29
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 号填列）		-15,534,304.42	-68,227,722.31
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	-22,760,327.74	-71,832,011.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	-	194,526.66
资产支持证券投资 收益	6. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	6. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	6. 4. 7. 18	-218,646.36	-3,436,948.99
股利收益	6. 4. 7. 19	7,444,669.68	6,846,711.83
以摊余成本计量的 金融资产终止确认产生的 收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	17,770,963.65	-92,803,441.43
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. 21	560,170.15	1,198,275.23
<b>减：二、营业总支出</b>		2,337,382.06	3,242,245.94
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	1,687,534.63	2,395,796.38
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	337,506.92	479,159.23
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		1,165.78	0.33
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	311,174.73	367,290.00

<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		757,090.75	-162,321,272.63
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		757,090.75	-162,321,272.63
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		757,090.75	-162,321,272.63

### 6.3 净资产(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管理人

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	784,984,818.50	-	-33,186,533.83	751,798,284.67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	784,984,818.50	-	-33,186,533.83	751,798,284.67
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-154,197,184.07	-	8,052,391.38	-146,144,792.69
(一)、综合收益总额	-	-	757,090.75	757,090.75
(二)、本期基金份额交易产	-154,197,184.07	-	7,295,300.63	-146,901,883.44

生的基 金净值 变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申 购款	109,066,300.94	-	-317,960.25	108,748,340.69
2 .基金赎 回款	-263,263,485.01	-	7,613,260.88	-255,650,224.13
(三)、 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)	-	-	-	-
(四)、 其他综 合收益 结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净 资产(基 金净值)	630,787,634.43	-	-25,134,142.45	605,653,491.98
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期 期末净 资产(基 金净值)	1,352,881,764.81	-	261,664,353.47	1,614,546,118.28
加:会计 政策变 更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,352,881,764.81	-	261,664,353.47	1,614,546,118.28
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-759,703,199.72	-	-207,426,312.45	-967,129,512.17
(一)、综合收益总额	-	-	-162,321,272.63	-162,321,272.63
(二)、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)	-759,703,199.72	-	-45,105,039.82	-804,808,239.54
其中:1.基金申购款	120,349,021.77	-	6,419,351.49	126,768,373.26
2.基金赎回款	-880,052,221.49	-	-51,524,391.31	-931,576,612.80
(三)、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	593,178,565.09	-	54,238,041.02	647,416,606.11

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安沪深 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 1,369,549,992.000 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金管理信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期的年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在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日前取得的基金、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基金份额净值、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 2023年6月30日
活期存款	1,218,457.18
等于：本金	1,217,543.89
加：应计利息	913.29
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,218,457.18

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	644,595,983.81	-	589,280,370.71	-55,315,613.10
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	644,595,983.81	-	589,280,370.71	-55,315,613.10	

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	13,802,460.00	-	-	-
其中：股指期货投资	13,802,460.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	13,802,460.00	-	-	-

注：(1) 衍生金融资产项下的股指期货投资期末合同/名义金额为初始的合约价值。

(2) 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。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2309	IF2309	11.00	12,668,700.00	18,240.00
IF2312	IF2312	1.00	1,154,160.00	2,160.00
合计				20,400.00
减：可抵销期货暂收款				20,400.00
净额				0.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	9,995,064.11	-
银行间市场	-	-
合计	9,995,064.11	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	5,589.22
待摊费用	75,616.24
合计	81,205.46

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
应付券商交易单元保证金	-	
应付赎回费	-	
应付证券出借违约金	-	
应付交易费用	98,073.60	
其中：交易所市场	98,073.60	
银行间市场	-	
应付利息	-	
预提费用	288,794.98	
合计	386,868.58	

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	187,849,992.00	784,984,818.50
本期申购	26,100,000.00	109,066,300.94
本期赎回(以“-”号填列)	-63,000,000.00	-263,263,485.01
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	150,949,992.00	630,787,634.43

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。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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	234,558,453.64	-267,744,987.47	-33,186,533.83
本期利润	-17,013,872.90	17,770,963.65	757,090.75
本期基金份额交易产生的变动数	-44,070,504.35	51,365,804.98	7,295,300.63

其中：基金申购款	31,079,636.30	-31,397,596.55	-317,960.25
基金赎回款	-75,150,140.65	82,763,401.53	7,613,260.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	173,474,076.39	-198,608,218.84	-25,134,142.45

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	13,582.09
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	16,792.82
其他	388.49
合计	30,763.40

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-15,116,307.66
股票投资收益——赎回差价收入	-7,644,020.08
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-22,760,327.74

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	143,949,002.19
减：卖出股票成本总额	158,740,624.06
减：交易费用	324,685.79
买卖股票差价收入	-15,116,307.66

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	255,650,224.13
减：现金支付赎回款总额	105,447,100.13
减：赎回股票成本总额	157,847,144.08
减：交易费用	-

赎回差价收入	-7,644,020.08
--------	---------------

**6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

**6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

**6.4.7.15 债券投资收益****6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

#### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.18.2 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
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-218,646.36

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,444,669.68
其中：证券出借权益补偿收入	108,143.84
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,444,669.68

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	17,678,803.65
股票投资	17,678,803.65
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	92,160.00
权证投资	-
期货投资	92,160.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	17,770,963.65

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	560,170.15
合计	560,170.15

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	28,760.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	383.00
指数使用费	98,551.13
其他	123,972.33
合计	311,174.73

#### 6.4.7.24 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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“工商银	基金托管人

行”)	
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
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
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300ETF联接基金”)	本基金管理人管理的其他基金
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300ETF联接基金”)	本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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	32,420,985.81	14.35	551,867,294.13	85.81

###### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
平安证券	-	-	901,517.60	100.00

###### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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 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	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
平安证券	-	-	400,000,000.00	100.00

#### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	23,385.42	14.35	23,385.42	23.84
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	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 (%)
	394,286.03	85.77	133,879.38	78.85

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等服务等。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,687,534.63	2,395,796.38
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的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日

	月 30 日	6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	337,506.92	479,159.23

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	1,481,700.00	1,041.51	-	-
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	9,501,300.00	6,224.24	282,400.00	185.04

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	2023042000003531	海康威视	2023-04-20	83,240.00	2,000	14	2.70	87.40	-	-
平安证券	202304	中国电	2023-03	34,100.00	5,000	14	2.90	38.46	-	-

	200000 3535	信	4-20	0						
平安证券	202304 210000 5114	中兴通讯	2023-0 4-21	643,632. 00	17,600	14	3.20	800.96	-	-
平安证券	202304 210000 5115	歌尔股份	2023-0 4-21	203,148. 00	10,800	14	3.20	252.81	-	-
平安证券	202304 210000 5119	海螺水泥	2023-0 4-21	581,516. 00	21,100	14	2.10	474.90	-	-
平安证券	202304 210000 5121	中国船舶	2023-0 4-21	385,164. 00	15,600	14	3.00	449.36	-	-
平安证券	202304 260000 4603	招商银行	2023-0 4-26	135,280. 00	4,000	14	3.00	157.83	-	-
平安证券	202305 040004 3717	中国电信	2023-0 5-04	33,250.0 0	5,000	14	2.80	36.21	-	-
平安证券	202305 050000 6557	海螺水泥	2023-0 5-05	570,966. 00	21,100	14	2.00	444.08	-	-
平安证券	202305 080000 5216	中国船舶	2023-0 5-08	431,652. 00	15,600	14	3.50	587.53	-	-
平安证券	202305 160000 3723	中国石油	2023-0 5-16	82,720.0 0	11,000	14	3.10	99.72	-	-
平安证券	202305 190000 7099	海螺水泥	2023-0 5-19	556,407. 00	21,100	14	1.90	411.12	-	-
平安证券	202305 220002 8358	中国船舶	2023-0 5-22	449,280. 00	15,600	14	3.60	628.99	-	-
平安证券	202305 310000 4520	分众传媒	2023-0 5-31	64,200.0 0	10,000	7	2.80	34.95	-	-
平安证券	202305 310000 4524	民生银行	2023-0 5-31	3,960.00	1,000	7	1.30	1.00	-	-
平安证券	202305 310000 4532	农业银行	2023-0 5-31	3,520.00	1,000	7	2.00	1.37	-	-

平安证券	202305 300001 7500	隆基绿能	2023-0 5-30	118,000. 00	4,000	14	2.90	133.08	-	-
平安证券	202306 020001 3986	海螺水泥	2023-0 6-02	537,417. 00	21,100	14	2.70	564.29	-	-
平安证券	202306 210000 5799	山西焦煤	2023-0 6-21	17,900.0 0	2,000	14	3.20	22.28	17,900 .00	22.28
平安证券	202306 210000 5807	海螺水泥	2023-0 6-21	412,972. 00	17,200	14	2.50	401.50	412,97 2.00	401.50
平安证券	202306 210000 5809	中信证券	2023-0 6-21	198,500. 00	10,000	14	1.30	100.35	198,50 0.00	100.35
平安证券	202306 280000 9657	福耀玻璃	2023-0 6-28	34,910.0 0	1,000	14	3.00	40.73	34,910 .00	40.73
上年度可比期间										
2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:股)	出借期限(单位:天)	费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	202203 040000 0900	先导智能	2022 年 3 月 4 日	63,300.0 0	1,000	28	3.10	152.62	-	-

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末		上年度末	
	2023 年 6 月 30 日	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	2022 年 12 月 31 日	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
平安 300ETF 联接基金	120,164,157.00	79.6053	117,475,057.00	62.5366

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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-活期	1,218,457.18	13,582.09	12,655,948.34	17,304.19

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
				数量(单位： 股/张)	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位： 股/张)	总金额
平安证券股份有限公司	600030	中信证券	网上定价	61,649	889,595.07

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人的最终控股母公司中国平安保险(集团)股份有限公司发行的股票中国平安、基金管理人关联方平安银行发行的股票平安银行、本基金托管行发行的股票工商银行。

(1)于2023年6月30日，本基金持有1,092,500.00股工商银行的普通股，成本总额为人民币5,183,592.91元，估值总额为人民币5,265,850.00元，占基金资产净值的比例为0.87%(2022年6月30日，本基金持有1,050,600股工商银行的普通股，成本总额为人民币5,377,203.28元，估值总额为人民币5,011,362.00元，占基金资产净值的比例为0.77%)。

(2)于2023年6月30日，本基金持有338,962.00股中国平安的普通股，成本总额为人民币19,028,200.45元，估值总额为人民币15,727,836.80元，占基金资产净值的比例为2.60%(2022年6月30日，本基金持有324,662股中国平安的普通股，成本总额为人民币21,659,852.22元，估值总额为人民币15,158,468.78元，占基金资产净值的比例为2.34%)。

(3)于2023年6月30日，本基金持有303,326.00股平安银行的普通股，成本总额为人民币

4,524,765.32 元，估值总额为人民币 3,406,350.98 元，占基金资产净值的比例为 0.56% (2022 年 6 月 30 日，本基金持有 290,426 股平安银行的普通股，成本总额为人民币 4,921,694.13 元，估值总额为人民币 4,350,581.48 元，占基金资产净值的比例为 0.67%)。

(4) 于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有 127,600.00 股方正证券的普通股，成本总额为人民币 923,054.15 元，估值总额为人民币 834,504.00 元，占基金资产净值的比例为 0.14%。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 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	受限期	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
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	1,082	12,854.16	22,743.64	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
301246	宏源药业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁定	50.00	30.71	801	40,050.00	24,598.71	-

注：1. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

2. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期内无暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期内无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
1	000063	中兴通讯	2023年7月11日	45.54	17,900	815,166.00
2	000069	华侨城A	2023年7月3日-2023年7月11日	4.40	3,000	13,200.00
3	000100	TCL科技	2023年7月4日-2023年7月14日	3.94	95,900	377,846.00
4	000157	中联重科	2023年7月5日	6.75	1,000	6,750.00
5	000301	东方盛虹	2023年7月5日	11.82	9,200	108,744.00
6	000617	中油资本	2023年7月12日	7.23	18,100	130,863.00
7	000625	长安汽车	2023年7月3日-2023年7月14日	12.93	34,000	439,620.00
8	000723	美锦能源	2023年7月10日-2023年7月10日	7.54	18,600	140,244.00
9	000876	新希望	2023年7月13日	11.68	18,300	213,744.00
10	000977	浪潮信息	2023年7月11日	48.50	4,500	218,250.00
11	000983	山西焦煤	2023年7月5日-2023年7月11日	9.10	3,000	27,300.00
12	001979	招商蛇口	2023年7月12日-2023年7月14日	13.03	22,200	289,266.00
13	002050	三花智控	2023年7月10日	30.26	15,300	462,978.00
14	002064	华峰化学	2023年7月14日	6.86	17,500	120,050.00
15	002120	韵达股份	2023年7月14日	9.56	1,000	9,560.00
16	002230	科大讯飞	2023年7月12日	67.96	12,200	829,112.00
17	002236	大华股份	2023年7月10日	19.75	1,000	19,750.00
18	002352	顺丰控股	2023年7月14日	45.09	12,600	568,134.00

19	002414	高德红外	2023年7月5日	7.77	6,000	46,620.00
20	002415	海康威视	2023年7月3日	33.11	23,500	778,085.00
21	002459	晶澳科技	2023年7月12日	41.70	11,800	492,060.00
22	002493	荣盛石化	2023年7月13日-2023年7月14日	11.64	19,700	229,308.00
23	002555	三七互娱	2023年7月4日	34.88	10,000	348,800.00
24	002601	龙佰集团	2023年7月13日	16.50	10,300	169,950.00
25	300059	东方财富	2023年7月13日-2023年7月13日	14.20	52,500	745,500.00
26	300207	欣旺达	2023年7月14日	16.32	10,600	172,992.00
27	600011	华能国际	2023年7月11日-2023年7月14日	9.26	30,700	284,282.00
28	600015	华夏银行	2023年7月5日-2023年7月12日	5.41	5,600	30,296.00
29	600025	华能水电	2023年7月12日	7.13	7,000	49,910.00
30	600030	中信证券	2023年7月5日	19.78	10,000	197,800.00
31	600031	三一重工	2023年7月13日	16.63	52,200	868,086.00
32	600048	保利发展	2023年7月12日	13.03	1,700	22,151.00
33	600050	中国联通	2023年7月13日	4.80	11,000	52,800.00
34	600061	国投资本	2023年7月4日-2023年7月4日	7.12	19,000	135,280.00
35	600089	特变电工	2023年7月5日-2023年7月14日	22.29	4,600	102,534.00
36	600111	北方稀土	2023年7月4日	23.98	1,000	23,980.00
37	600115	中国东航	2023年7月4日-2023年7月13日	4.76	42,200	200,872.00
38	600150	中国船舶	2023年7月5日-2023年7月5日	32.91	15,900	523,269.00
39	600176	中国巨石	2023年7月12日	14.16	1,000	14,160.00
40	600183	生益科技	2023年7月14日	14.20	1,000	14,200.00

41	600219	南山铝业	2023年7月11日-2023年7月14日	3.02	46,000	138,920.00
42	600346	恒力石化	2023年7月3日	14.33	1,000	14,330.00
43	600383	金地集团	2023年7月11日	7.21	3,400	24,514.00
44	600406	国电南瑞	2023年7月10日-2023年7月12日	23.10	3,000	69,300.00
45	600438	通威股份	2023年7月5日-2023年7月12日	34.31	19,200	658,752.00
46	600547	山东黄金	2023年7月14日	23.48	10,000	234,800.00
47	600584	长电科技	2023年7月12日	31.17	4,000	124,680.00
48	600585	海螺水泥	2023年7月5日	23.74	17,200	408,328.00
49	600606	绿地控股	2023年7月5日	2.75	2,600	7,150.00
50	600660	福耀玻璃	2023年7月12日-2023年7月14日	35.85	3,100	111,135.00
51	600674	川投能源	2023年7月12日-2023年7月13日	15.05	3,400	51,170.00
52	600732	爱旭股份	2023年7月11日	30.75	5,000	153,750.00
53	600905	三峡能源	2023年7月3日-2023年7月14日	5.37	75,700	406,509.00
54	601006	大秦铁路	2023年7月3日	7.43	42,800	318,004.00
55	601012	隆基绿能	2023年7月13日	28.67	43,400	1,244,278.00
56	601111	中国国航	2023年7月4日-2023年7月4日	8.24	20,200	166,448.00
57	601138	工业富联	2023年7月12日-2023年7月13日	25.20	28,500	718,200.00
58	601216	君正集团	2023年7月5日-2023年7月14日	4.10	16,500	67,650.00
59	601225	陕西煤业	2023年7月11日	18.19	10,000	181,900.00
60	601360	三六零	2023年7月13日	12.54	22,400	280,896.00
61	601390	中国中铁	2023年7月11日	7.58	15,700	119,006.00
62	601615	明阳智能	2023年7月3日-2023年7月14日	16.88	2,000	33,760.00

63	601628	中国人寿	2023年7月11日	34.96	8,000	279,680.00
64	601658	邮储银行	2023年7月4日-2023年7月14日	4.89	12,000	58,680.00
65	601669	中国电建	2023年7月12日	5.74	49,400	283,556.00
66	601728	中国电信	2023年7月5日-2023年7月14日	5.63	57,600	324,288.00
67	601800	中国交建	2023年7月10日	10.91	10,000	109,100.00
68	601838	成都银行	2023年7月3日	12.21	1,300	15,873.00
69	601868	中国能建	2023年7月10日-2023年7月14日	2.34	38,700	90,558.00
70	601872	招商轮船	2023年7月14日	5.79	23,200	134,328.00
71	601919	中远海控	2023年7月3日-2023年7月13日	9.40	7,200	67,680.00
72	601988	中国银行	2023年7月3日-2023年7月12日	3.91	11,900	46,529.00
73	601989	中国重工	2023年7月14日	4.82	20,700	99,774.00
74	601998	中信银行	2023年7月13日	5.98	26,900	160,862.00
75	603019	中科曙光	2023年7月13日	50.90	10,000	509,000.00
76	603288	海天味业	2023年7月14日	46.85	12,000	562,200.00
77	603799	华友钴业	2023年7月13日	45.91	10,400	477,464.00
78	603993	洛阳钼业	2023年7月14日	5.33	3,700	19,721.00
79	688223	晶科能源	2023年7月10日	14.06	3,100	43,586.00
合计	-	-	-	-	1,353,800	19,109,871.00

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、

风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本期末，本基金未持有债券投资（上年末：同）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎

回需求匹配与平衡。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，

并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

#### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	1,218,457.18	-	-	-	1,218,457.18
结算备付金	698,049.53	-	-	-	698,049.53
存出保证金	52,884.59	-	-	1,658,743.20	1,711,627.79
交易性金融资产	-	-	-	589,280,370.71	589,280,370.71
买入返售金融资产	9,995,064.11	-	-	-	9,995,064.11
应收股利	-	-	-	9,459.14	9,459.14
应收清算款	-	-	-	3,465,994.12	3,465,994.12
其他资产	-	-	-	81,205.46	81,205.46
<b>资产总计</b>	<b>11,964,455.41</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>594,495,772.63</b>	<b>606,460,228.04</b>
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	250,284.94	250,284.94
应付托管费	-	-	-	50,057.00	50,057.00
应付清算款	-	-	-	119,525.54	119,525.54
其他负债	-	-	-	386,868.58	386,868.58
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>806,736.06</b>	<b>806,736.06</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>11,964,455.41</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>593,689,036.57</b>	<b>605,653,491.98</b>
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	14,428,645.72	-	-	-	14,428,645.72
结算备付金	1,894,688.76	-	-	-	1,894,688.76
存出保证金	36,205.37	-	-	841,341.60	877,546.97
交易性金融资产	-	-	-	741,747,957.98	741,747,957.98
买入返售金融资产	-1,170.40	-	-	-	-1,170.40
应收清算款	-	-	-	3,907,376.48	3,907,376.48
其他资产	-	-	-	1,493.36	1,493.36

资产总计	16,358,369.45	-	-	746,498,169.42	762,856,538.87
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	243,323.44	243,323.44
应付托管费	-	-	-	48,664.68	48,664.68
其他负债	-	-	-	10,766,266.08	10,766,266.08
负债总计	-	-	-	11,058,254.20	11,058,254.20
利率敏感度缺口	16,358,369.45	-	-	735,439,915.22	751,798,284.67

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金未持有债券资产（上年末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年末：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 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 2023年6月30日		上年度末 2022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	589,280,370.71	97.30	741,747,957.98	98.66

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	589, 280, 370. 71	97. 30	741, 747, 957. 98	98. 66

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
分析		本期末（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	30, 111, 512. 11	37, 499, 489. 63
	沪深 300 指数下降 5%	-30, 111, 512. 11	-37, 499, 489. 63

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	589, 230, 856. 96	739, 746, 373. 05
第二层次	-	-

第三层次	49,513.75	2,001,584.93
合计	589,280,370.71	741,747,957.98

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

### § 7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	589,280,370.71	97.17
	其中：股票	589,280,370.71	97.17
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	9,995,064.11	1.65
	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	1,916,506.71	0.32
8	其他各项资产	5,268,286.51	0.87
9	合计	606,460,228.04	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 19,109,871.00 元，占净值比例 3.16%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	6,595,725.85	1.09
B	采矿业	22,933,845.58	3.79
C	制造业	332,919,709.74	54.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,636,053.88	2.91
E	建筑业	13,982,111.43	2.31
F	批发和零售业	1,940,665.40	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	18,348,778.58	3.03
H	住宿和餐饮业	596,994.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,266,330.47	4.83
J	金融业	120,760,870.54	19.94
K	房地产业	8,858,918.24	1.46
L	租赁和商务服务业	5,495,859.96	0.91
M	科学研究和技术服务业	5,747,274.28	0.95
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	3,356,236.45	0.55
R	文化、体育和娱乐业	791,482.56	0.13
S	综合	-	-
	合计	589,230,856.96	97.29

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	26,770.11	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	22,743.64	0.00
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	-	-
J	金融业	-	-
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	49,513.75	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

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	19,676	33,272,116.00	5.49
2	300750	宁德时代	82,560	18,888,902.40	3.12
3	601318	中国平安	338,962	15,727,836.80	2.60
4	600036	招商银行	386,603	12,665,114.28	2.09
5	000858	五粮液	60,610	9,913,977.70	1.64
6	000333	美的集团	153,598	9,049,994.16	1.49
7	002594	比亚迪	28,300	7,309,041.00	1.21
8	601166	兴业银行	453,779	7,101,641.35	1.17
9	600900	长江电力	306,298	6,756,933.88	1.12
10	600276	恒瑞医药	139,153	6,665,428.70	1.10
11	600030	中信证券	305,441	6,041,622.98	1.00
12	601899	紫金矿业	513,250	5,835,652.50	0.96
13	300059	东方财富	396,962	5,636,860.40	0.93
14	600887	伊利股份	198,497	5,621,435.04	0.93
15	601012	隆基绿能	189,074	5,420,751.58	0.90
16	601398	工商银行	1,092,500	5,265,850.00	0.87
17	600309	万华化学	58,701	5,156,295.84	0.85

18	000651	格力电器	140,416	5,126,588.16	0.85
19	002475	立讯精密	155,565	5,048,084.25	0.83
20	601328	交通银行	857,200	4,971,760.00	0.82
21	002415	海康威视	145,916	4,831,278.76	0.80
22	000568	泸州老窖	23,000	4,820,110.00	0.80
23	000725	京东方 A	1,168,800	4,780,392.00	0.79
24	000063	中兴通讯	99,500	4,531,230.00	0.75
25	300760	迈瑞医疗	15,100	4,526,980.00	0.75
26	601816	京沪高铁	765,800	4,028,108.00	0.67
27	603259	药明康德	63,988	3,987,092.28	0.66
28	002230	科大讯飞	57,703	3,921,495.88	0.65
29	300274	阳光电源	32,500	3,790,475.00	0.63
30	600028	中国石化	592,600	3,768,936.00	0.62
31	601668	中国建筑	654,300	3,755,682.00	0.62
32	300124	汇川技术	57,950	3,720,969.50	0.61
33	002714	牧原股份	85,077	3,585,995.55	0.59
34	601288	农业银行	997,200	3,520,116.00	0.58
35	002352	顺丰控股	76,413	3,445,462.17	0.57
36	000001	平安银行	303,326	3,406,350.98	0.56
37	601888	中国中免	30,432	3,363,648.96	0.56
38	002129	TCL 中环	101,050	3,354,860.00	0.55
39	000792	盐湖股份	169,700	3,253,149.00	0.54
40	601088	中国神华	103,200	3,173,400.00	0.52
41	601138	工业富联	124,400	3,134,880.00	0.52
42	002142	宁波银行	123,874	3,134,012.20	0.52
43	688981	中芯国际	61,300	3,096,876.00	0.51
44	600031	三一重工	185,700	3,088,191.00	0.51
45	300498	温氏股份	164,018	3,009,730.30	0.50
46	000002	万 科 A	212,854	2,984,213.08	0.49
47	600048	保利发展	224,550	2,925,886.50	0.48
48	600016	民生银行	777,300	2,914,875.00	0.48
49	600406	国电南瑞	125,624	2,901,914.40	0.48
50	600438	通威股份	83,800	2,875,178.00	0.47
51	600050	中国联通	597,000	2,865,600.00	0.47
52	600809	山西汾酒	15,220	2,816,765.40	0.47
53	600837	海通证券	302,300	2,787,206.00	0.46
54	600690	海尔智家	117,500	2,758,900.00	0.46
55	601601	中国太保	106,027	2,754,581.46	0.45
56	601728	中国电信	485,800	2,735,054.00	0.45
57	688111	金山办公	5,760	2,719,987.20	0.45
58	600919	江苏银行	370,030	2,719,720.50	0.45
59	600436	片仔癀	9,400	2,691,784.00	0.44
60	600089	特变电工	120,600	2,688,174.00	0.44

61	300015	爱尔眼科	144,561	2,681,606.55	0.44
62	601857	中国石油	354,500	2,648,115.00	0.44
63	600000	浦发银行	364,275	2,637,351.00	0.44
64	600941	中国移动	28,100	2,621,730.00	0.43
65	002371	北方华创	8,200	2,604,730.00	0.43
66	601988	中国银行	652,600	2,551,666.00	0.42
67	603501	韦尔股份	25,944	2,543,549.76	0.42
68	002304	洋河股份	18,681	2,453,749.35	0.41
69	601766	中国中车	376,930	2,450,045.00	0.40
70	603288	海天味业	52,176	2,444,445.60	0.40
71	601390	中国中铁	318,500	2,414,230.00	0.40
72	600905	三峡能源	444,200	2,385,354.00	0.39
73	300014	亿纬锂能	38,022	2,300,331.00	0.38
74	600150	中国船舶	69,400	2,283,954.00	0.38
75	000938	紫光股份	70,973	2,260,490.05	0.37
76	002466	天齐锂业	32,045	2,240,265.95	0.37
77	603986	兆易创新	20,733	2,202,881.25	0.36
78	601688	华泰证券	159,701	2,199,082.77	0.36
79	601225	陕西煤业	120,300	2,188,257.00	0.36
80	002459	晶澳科技	51,228	2,136,207.60	0.35
81	002460	赣锋锂业	35,000	2,133,600.00	0.35
82	002027	分众传媒	313,100	2,132,211.00	0.35
83	601169	北京银行	459,154	2,125,883.02	0.35
84	688012	中微公司	13,449	2,104,096.05	0.35
85	000338	潍柴动力	168,200	2,095,772.00	0.35
86	600570	恒生电子	47,164	2,088,893.56	0.34
87	601985	中国核电	292,300	2,060,715.00	0.34
88	600104	上汽集团	144,906	2,053,318.02	0.34
89	002050	三花智控	66,717	2,018,856.42	0.33
90	000625	长安汽车	154,096	1,992,461.28	0.33
91	002049	紫光国微	21,140	1,971,305.00	0.33
92	601211	国泰君安	139,800	1,955,802.00	0.32
93	600111	北方稀土	78,500	1,882,430.00	0.31
94	601919	中远海控	197,470	1,856,218.00	0.31
95	603019	中科曙光	36,340	1,849,706.00	0.31
96	000100	TCL 科技	466,180	1,836,749.20	0.30
97	603799	华友钴业	39,751	1,824,968.41	0.30
98	601628	中国人寿	51,700	1,807,432.00	0.30
99	002179	中航光电	39,480	1,790,418.00	0.30
100	600585	海螺水泥	75,089	1,782,612.86	0.29
101	600660	福耀玻璃	49,669	1,780,633.65	0.29
102	601229	上海银行	308,570	1,774,277.50	0.29
103	601818	光大银行	575,800	1,767,706.00	0.29

104	002812	恩捷股份	18,300	1,763,205.00	0.29
105	600893	航发动力	41,663	1,760,678.38	0.29
106	600009	上海机场	38,617	1,753,984.14	0.29
107	002271	东方雨虹	62,456	1,702,550.56	0.28
108	601989	中国重工	353,070	1,701,797.40	0.28
109	002555	三七互娱	48,200	1,681,216.00	0.28
110	601658	邮储银行	343,800	1,681,182.00	0.28
111	300122	智飞生物	37,171	1,642,958.20	0.27
112	600958	东方证券	162,352	1,574,814.40	0.26
113	600999	招商证券	114,994	1,560,468.58	0.26
114	000977	浪潮信息	32,008	1,552,388.00	0.26
115	600019	宝钢股份	276,038	1,551,333.56	0.26
116	600760	中航沈飞	34,195	1,538,775.00	0.25
117	300896	爱美客	3,400	1,512,830.00	0.25
118	002709	天赐材料	35,800	1,474,602.00	0.24
119	688036	传音控股	9,997	1,469,559.00	0.24
120	300316	晶盛机电	20,300	1,439,270.00	0.24
121	688599	天合光能	33,600	1,431,696.00	0.24
122	601186	中国铁建	144,700	1,425,295.00	0.24
123	688008	澜起科技	24,554	1,409,890.68	0.23
124	600426	华鲁恒升	46,000	1,408,980.00	0.23
125	601360	三六零	110,822	1,389,707.88	0.23
126	600584	长电科技	44,500	1,387,065.00	0.23
127	601006	大秦铁路	186,257	1,383,889.51	0.23
128	000661	长春高新	10,010	1,364,363.00	0.23
129	000776	广发证券	92,400	1,359,204.00	0.22
130	601600	中国铝业	246,200	1,351,638.00	0.22
131	002410	广联达	41,304	1,341,966.96	0.22
132	002920	德赛西威	8,600	1,339,966.00	0.22
133	002241	歌尔股份	74,718	1,326,244.50	0.22
134	600745	闻泰科技	26,911	1,315,947.90	0.22
135	300142	沃森生物	49,700	1,314,565.00	0.22
136	600547	山东黄金	55,940	1,313,471.20	0.22
137	601377	兴业证券	214,140	1,310,536.80	0.22
138	600588	用友网络	63,771	1,307,305.50	0.22
139	601939	建设银行	207,921	1,301,585.46	0.21
140	000166	申万宏源	279,561	1,291,571.82	0.21
141	601009	南京银行	160,200	1,281,600.00	0.21
142	600011	华能国际	136,300	1,262,138.00	0.21
143	000596	古井贡酒	5,100	1,261,638.00	0.21
144	600010	包钢股份	703,600	1,259,444.00	0.21
145	300450	先导智能	34,820	1,259,439.40	0.21
146	001979	招商蛇口	96,022	1,251,166.66	0.21

147	600085	同仁堂	21,300	1,226,028.00	0.20
148	601669	中国电建	213,500	1,225,490.00	0.20
149	600196	复星医药	39,500	1,220,550.00	0.20
150	300408	三环集团	41,335	1,213,182.25	0.20
151	601800	中国交建	111,100	1,212,101.00	0.20
152	002311	海大集团	25,800	1,208,472.00	0.20
153	603659	璞泰来	31,247	1,194,260.34	0.20
154	600886	国投电力	93,800	1,186,570.00	0.20
155	000538	云南白药	22,320	1,171,353.60	0.19
156	000963	华东医药	26,920	1,167,520.40	0.19
157	300033	同花顺	6,660	1,167,364.80	0.19
158	603993	洛阳钼业	218,800	1,166,204.00	0.19
159	600845	宝信软件	22,689	1,152,828.09	0.19
160	000768	中航西飞	42,969	1,149,420.75	0.19
161	600600	青岛啤酒	11,000	1,139,930.00	0.19
162	601689	拓普集团	14,000	1,129,800.00	0.19
163	300782	卓胜微	11,548	1,115,883.24	0.18
164	002252	上海莱士	146,200	1,097,962.00	0.18
165	002493	荣盛石化	94,275	1,097,361.00	0.18
166	600926	杭州银行	92,900	1,091,575.00	0.18
167	601100	恒立液压	16,756	1,077,913.48	0.18
168	000733	振华科技	11,200	1,073,520.00	0.18
169	600176	中国巨石	75,311	1,066,403.76	0.18
170	600015	华夏银行	196,900	1,065,229.00	0.18
171	600795	国电电力	275,800	1,056,314.00	0.17
172	300347	泰格医药	16,300	1,052,002.00	0.17
173	002180	纳思达	30,700	1,051,475.00	0.17
174	600732	爱旭股份	34,020	1,046,115.00	0.17
175	600674	川投能源	69,300	1,042,965.00	0.17
176	000157	中联重科	153,700	1,037,475.00	0.17
177	600029	南方航空	170,500	1,028,115.00	0.17
178	603369	今世缘	19,372	1,022,841.60	0.17
179	002236	大华股份	51,500	1,017,125.00	0.17
180	600115	中国东航	212,400	1,011,024.00	0.17
181	000425	徐工机械	146,400	991,128.00	0.16
182	601788	光大证券	61,100	970,879.00	0.16
183	000301	东方盛虹	82,100	970,422.00	0.16
184	601995	中金公司	27,200	966,144.00	0.16
185	600346	恒力石化	67,280	964,122.40	0.16
186	601633	长城汽车	38,300	964,011.00	0.16
187	601066	中信建投	39,800	963,160.00	0.16
188	601336	新华保险	26,100	959,697.00	0.16
189	300496	中科创达	9,900	953,865.00	0.16

190	601877	正泰电器	34,185	945,215.25		0.16
191	601868	中国能建	401,900	940,446.00		0.16
192	601117	中国化学	113,500	939,780.00		0.16
193	002074	国轩高科	34,000	939,080.00		0.16
194	002202	金风科技	87,848	932,945.76		0.15
195	600741	华域汽车	48,867	902,084.82		0.15
196	601111	中国国航	108,800	896,512.00		0.15
197	002001	新和成	57,739	889,180.60		0.15
198	688126	沪硅产业	42,400	886,160.00		0.15
199	002821	凯莱英	7,513	885,482.18		0.15
200	600989	宝丰能源	70,000	882,700.00		0.15
201	601618	中国中冶	221,554	879,569.38		0.15
202	688223	晶科能源	62,100	873,126.00		0.14
203	002841	视源股份	13,058	872,796.72		0.14
204	300454	深信服	7,700	872,025.00		0.14
205	601838	成都银行	70,300	858,363.00		0.14
206	603806	福斯特	23,078	858,270.82		0.14
207	688396	华润微	16,234	850,823.94		0.14
208	601615	明阳智能	50,400	850,752.00		0.14
209	600188	兖矿能源	28,400	849,728.00		0.14
210	000876	新希望	71,700	837,456.00		0.14
211	601901	方正证券	127,600	834,504.00		0.14
212	300661	圣邦股份	10,010	822,121.30		0.14
213	600039	四川路桥	83,080	815,014.80		0.13
214	605117	德业股份	5,400	807,570.00		0.13
215	000895	双汇发展	32,910	805,965.90		0.13
216	688303	大全能源	19,700	796,865.00		0.13
217	000786	北新建材	32,400	794,124.00		0.13
218	300413	芒果超媒	23,136	791,482.56		0.13
219	002736	国信证券	90,300	788,319.00		0.13
220	600460	士兰微	26,000	787,020.00		0.13
221	603392	万泰生物	11,779	786,483.83		0.13
222	300769	德方纳米	7,100	782,633.00		0.13
223	002648	卫星化学	52,217	781,166.32		0.13
224	003816	中国广核	249,900	777,189.00		0.13
225	600233	圆通速递	53,200	774,592.00		0.13
226	601607	上海医药	34,500	773,145.00		0.13
227	603260	合盛硅业	11,000	770,220.00		0.13
228	002007	华兰生物	34,030	762,612.30		0.13
229	300999	金龙鱼	19,000	759,810.00		0.13
230	300207	欣旺达	46,300	755,616.00		0.12
231	002601	龙佰集团	44,800	739,200.00		0.12
232	601238	广汽集团	70,840	738,152.80		0.12

233	300751	迈为股份	4,320	731,721.60	0.12
234	300433	蓝思科技	62,138	730,742.88	0.12
235	600383	金地集团	100,100	721,721.00	0.12
236	300759	康龙化成	18,500	708,180.00	0.12
237	601021	春秋航空	12,200	701,134.00	0.12
238	600332	白云山	21,817	695,525.96	0.11
239	600132	重庆啤酒	7,400	681,984.00	0.11
240	600763	通策医疗	6,965	674,629.90	0.11
241	600219	南山铝业	218,100	658,662.00	0.11
242	300223	北京君正	7,400	653,494.00	0.11
243	300763	锦浪科技	6,200	645,420.00	0.11
244	600875	东方电气	34,600	645,290.00	0.11
245	000983	山西焦煤	70,400	640,640.00	0.11
246	601865	福莱特	16,400	631,564.00	0.10
247	002756	永兴材料	10,010	626,726.10	0.10
248	600918	中泰证券	89,400	617,754.00	0.10
249	000723	美锦能源	81,300	613,002.00	0.10
250	601878	浙商证券	61,900	611,572.00	0.10
251	600362	江西铜业	32,000	607,360.00	0.10
252	601699	潞安环能	37,000	603,840.00	0.10
253	601319	中国人保	102,867	600,743.28	0.10
254	600754	锦江酒店	14,100	596,994.00	0.10
255	600061	国投资本	82,845	589,856.40	0.10
256	601998	中信银行	97,700	584,246.00	0.10
257	601872	招商轮船	100,900	584,211.00	0.10
258	603290	斯达半导	2,700	581,040.00	0.10
259	600803	新奥股份	30,100	571,298.00	0.09
260	000617	中油资本	78,200	565,386.00	0.09
261	000069	华侨城 A	126,500	556,600.00	0.09
262	601799	星宇股份	4,500	556,200.00	0.09
263	603486	科沃斯	7,100	552,167.00	0.09
264	300628	亿联网络	15,741	552,036.87	0.09
265	000408	藏格矿业	24,300	548,451.00	0.09
266	603833	欧派家居	5,674	543,569.20	0.09
267	688363	华熙生物	6,066	540,844.56	0.09
268	688005	容百科技	10,000	540,200.00	0.09
269	300601	康泰生物	20,820	528,619.80	0.09
270	600183	生益科技	37,125	527,175.00	0.09
271	002938	鹏鼎控股	21,700	527,093.00	0.09
272	600884	杉杉股份	34,800	526,872.00	0.09
273	603899	晨光股份	11,500	513,360.00	0.08
274	300919	中伟股份	8,300	500,075.00	0.08
275	000708	中信特钢	31,230	494,683.20	0.08

276	002916	深南电路	6,396	482,066.52	0.08
277	601898	中煤能源	56,600	477,704.00	0.08
278	603185	弘元绿能	6,400	477,120.00	0.08
279	601881	中国银河	40,016	464,585.76	0.08
280	600018	上港集团	86,600	454,650.00	0.08
281	688561	奇安信	8,500	440,385.00	0.07
282	000877	天山股份	53,700	437,118.00	0.07
283	002064	华峰化学	63,600	436,296.00	0.07
284	601216	君正集团	106,400	436,240.00	0.07
285	002120	韵达股份	45,071	430,878.76	0.07
286	601155	新城控股	29,100	419,331.00	0.07
287	600025	华能水电	57,900	412,827.00	0.07
288	002414	高德红外	52,853	410,667.81	0.07
289	600606	绿地控股	136,183	374,503.25	0.06
290	300957	贝泰妮	3,900	346,632.00	0.06
291	603195	公牛集团	3,596	345,431.76	0.06
292	688187	时代电气	8,200	343,252.00	0.06
293	688065	凯赛生物	5,500	342,430.00	0.06
294	601698	中国卫通	13,700	272,356.00	0.04
295	601808	中海油服	19,301	267,897.88	0.04
296	000800	一汽解放	31,000	259,470.00	0.04
297	300979	华利集团	5,200	253,448.00	0.04
298	605499	东鹏饮料	1,400	242,060.00	0.04
299	601236	红塔证券	31,380	233,781.00	0.04
300	001289	龙源电力	5,500	123,750.00	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301246	宏源药业	801	24,598.71	0.00
2	001287	中电港	1,082	22,743.64	0.00
3	001367	海森药业	55	2,171.40	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	300750	宁德时代	4,032,326.00	0.54
2	000858	五粮液	2,506,206.10	0.33
3	002594	比亚迪	1,807,074.00	0.24
4	600519	贵州茅台	1,600,574.00	0.21
5	000333	美的集团	1,578,585.04	0.21
6	002371	北方华创	1,400,414.00	0.19

7	300059	东方财富	1,272,328.80	0.17
8	600028	中国石化	1,132,190.00	0.15
9	600941	中国移动	1,103,105.00	0.15
10	002415	海康威视	1,096,021.00	0.15
11	300760	迈瑞医疗	1,039,300.00	0.14
12	000651	格力电器	1,015,315.00	0.14
13	002129	TCL中环	978,681.00	0.13
14	000568	泸州老窖	973,586.00	0.13
15	600905	三峡能源	943,329.00	0.13
16	002475	立讯精密	936,951.00	0.12
17	000725	京东方A	910,913.00	0.12
18	600732	爱旭股份	892,892.00	0.12
19	300124	汇川技术	877,319.00	0.12
20	002352	顺丰控股	859,565.24	0.11

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	300750	宁德时代	9,018,401.80	1.20
2	000858	五粮液	5,324,026.00	0.71
3	002594	比亚迪	3,804,733.00	0.51
4	000333	美的集团	3,591,625.00	0.48
5	600519	贵州茅台	2,941,961.00	0.39
6	300059	东方财富	2,848,000.68	0.38
7	300760	迈瑞医疗	2,432,843.00	0.32
8	002415	海康威视	2,394,439.00	0.32
9	000651	格力电器	2,314,074.00	0.31
10	002371	北方华创	2,239,994.00	0.30
11	002475	立讯精密	2,193,179.00	0.29
12	000568	泸州老窖	2,059,339.00	0.27
13	002352	顺丰控股	2,045,489.00	0.27
14	000725	京东方A	2,030,484.00	0.27
15	300124	汇川技术	1,995,082.00	0.27
16	000001	平安银行	1,847,785.00	0.25
17	002142	宁波银行	1,785,049.00	0.24
18	002129	TCL中环	1,773,038.00	0.24
19	300274	阳光电源	1,664,593.00	0.22
20	002714	牧原股份	1,622,831.00	0.22

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交量）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	83,205,829.02
卖出股票收入(成交)总额	143,949,002.19

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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

### 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

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金本报告期无国债期货投资。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.12 投资组合报告附注

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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、招商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

### 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	1,711,627.79
2	应收清算款	3,465,994.12
3	应收股利	9,459.14
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	5,589.22
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	5,268,286.51

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限的股票。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301246	宏源药业	24,598.71	0.00	新股锁定
2	001287	中电港	22,743.64	0.00	新股锁定
3	001367	海森药业	2,171.40	0.00	新股锁定

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 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 (%)
1,370	110,182.48	140,829,208.00	93.30	10,120,784.00	6.70

### 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 300ETF 联接基金	120,164,157.00	79.61

### 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	中国国际金融股份有限公司	12,407,400.00	8.22
2	中信证券股份有限公司	3,424,381.00	2.27
3	国泰君安证券股份有限公司	1,029,600.00	0.68
4	广发证券股份有限公司	972,507.00	0.64
5	招商证券股份有限公司	865,400.00	0.57
6	梁碧娟	717,909.00	0.48
7	青岛鹿秀投资管理有限公司—鹿秀长颈鹿 6 号私募证券投资基金管理人	400,000.00	0.26
8	招商证券资管—深圳市众智投资有限公司—招商资管智贏臻选 FOF1 号单一资产管理计划	372,600.00	0.25
9	陈伟生	324,800.00	0.22
10	华泰证券股份有限公司	300,000.00	0.20
11	中国工商银行股份有限公司—平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	120,164,157.00	79.61

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：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）	5,723,055,617.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	187,849,992.00
本报告期基金总申购份额	26,100,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	63,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	150,949,992.00

## § 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

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司2023年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自2023年3月17日公司2023年第二次股东会做出决议之日起生效。

报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，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

报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
海通证券	6	126,965,273. 35	56.20	91,580.56	56.20	-
平安证券	2	32,420,985.8 1	14.35	23,385.42	14.35	-
广发证券	2	23,841,679.2 2	10.55	17,196.45	10.55	-
国盛证券	1	12,251,766.9 5	5.42	8,837.31	5.42	-
中泰证券	2	11,200,474.4 3	4.96	8,078.78	4.96	-
长江证券	1	8,526,262.27	3.77	6,150.05	3.77	-
太平洋证 券	3	5,586,424.73	2.47	4,029.47	2.47	-
中信建投 证券	2	5,116,396.62	2.26	3,690.42	2.26	-
东方财富富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例(%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例(%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例(%)
海通证 券	-	-	8,200,000.00	9.51	-	-

平安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	46,000,000.00	53.36	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	5,000,000.00	5.80	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	27,000,000.00	31.32	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 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提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月05日
2	平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月19日
3	平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年01月19日
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分上交所上市基金变更扩位简称的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年03月31日
5	平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年03月31日
6	平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023年04月03日
7	平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023年04月21日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增万联证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023年05月23日

9	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增中国中金财富证券有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 23 日
10	关于平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购赎回的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 26 日
11	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 31 日
12	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）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 31 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2023/01/01-- 2023/06/30	117,475,0 57.00	10,370,8 00.00	7,681,700 .00	120,164,157.0 0	79.61
产品特有风险							
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。							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (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) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

## 12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日