

# 平安深证 300 指数增强型证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 28 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 08 月 27 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 2025 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	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	10
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	15
<b>§ 7 投资组合报告</b>	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	47
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	47

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 .....	47
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 .....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	47
7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	48
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>49</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	49
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 .....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4 基金投资策略的改变 .....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	49
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 .....	49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	52
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>53</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 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	53
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录 .....	53
12.2 存放地点 .....	53
12.3 查阅方式 .....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安深证 300 指数增强型证券投资基金
基金简称	平安深证 300 指数增强
基金主代码	700002
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011 年 12 月 20 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	36,147,068.42 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	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、跟踪深证 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	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、跟踪深证 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。以有效降低基金运作成本并提高本基金的投资收益率。其中指数复制策略采用全样本复制的方式，即按照标的指数的成份股及其权重构建跟踪组合以拟合标的指数的业绩表现。股票增强策略在控制跟踪偏离度和跟踪误差的基础上，辅以有限度的增强操作及一级市场股票投资，以求获取超越标的指数的收益率表现。
业绩比较基准	深证 300 指数收益率 X95%+商业银行活期存款利率（税后）X5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李海波
	联系电话	0755-88622632
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn
客户服务电话	400-800-4800	95566
传真	0755-23997878	010-66594942
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 1 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 1 号

邮政编码	518048	100818
法定代表人	罗春风	葛海蛟

## 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	fund.pingan.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	平安基金管理有限公司	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2025年1月1日-2025年6月30日)
本期已实现收益	962,040.30
本期利润	326,056.49
加权平均基金份额本期利润	0.0089
本期加权平均净值利润率	0.43%
本期基金份额净值增长率	0.14%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)
期末可供分配利润	39,393,793.67
期末可供分配基金份额利润	1.0898
期末基金资产净值	75,540,862.09
期末基金份额净值	2.090
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)
基金份额累计净值增长率	125.31%

- 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	3.93%	0.75%	3.78%	0.75%	0.15%	0.00%
过去三个月	-0.67%	1.39%	-0.46%	1.38%	-0.21%	0.01%
过去六个月	0.14%	1.29%	-0.20%	1.26%	0.34%	0.03%
过去一年	12.73%	1.64%	15.51%	1.70%	-2.78%	-0.06%
过去三年	-21.99%	1.27%	-20.08%	1.31%	-1.91%	-0.04%
自基金合同生效起至今	125.31%	1.47%	55.51%	1.47%	69.80%	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

平安深证300指数增强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 2011 年 12 月 20 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。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 2025 年 6 月 30 日，平安基金共管理 230 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6600 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		
俞瑶	平安深证 300 指数 增强型证 券投资基金 基金经理	2021 年 11 月 4 日	-	13 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管理人、平安中证 500 指数增强型发起式证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：无。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，上半年深证 300 指数涨幅为 -0.27%。1-2 月份，AI 成为市场交易主线，中国本土研发的大模型 DeepSeek R1 横空出世，成功缩小了市场对于中美 AI 发展前景的认知差异，引发了中国 AI 产业链的价值重估。以 AI 为代表的科技板块引领了市场开启一轮上涨。3 月份由于外部关税等不确定性因素扰动，以及前期 AI 行情过热，叠加个股进入财报披露期，市场风格发生明显转换，逐步向红利低波等方向聚焦。第二季度创新药、新消费、AI 硬件等方向呈现出趋势性行情。而固态电池、稳定币、核聚变等主题行情也反复活跃。

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。策略主要是从公司基本面角度出发进行选股，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。

#### 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 2.090 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.14%，业绩比较基准收益率为 -0.20%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

本基金跟踪的深证 300 指数，整体偏向电力设备新能源、医药、食品饮料、非银行金融等行业，且以深市较大市值股票为主。当前行情预计以结构性机会为主，而中报业绩为核心指引。产品的持仓配置会以业绩为主线，重点关注资源品、军工、AI 算力等方向的机会，后续会持续留意 AI 国产替代和应用端可能的产业催化。

#### 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，由研究部及投资管理部门、运营部、风险管理部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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在平安深证 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）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、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行

了应尽的义务。

## 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：平安深证 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6. 4. 7. 1	4,012,090.74	3,649,873.24
结算备付金		469,377.60	83,749.46
存出保证金		22,545.80	12,714.32
交易性金融资产	6. 4. 7. 2	70,517,306.19	73,961,903.88
其中：股票投资		70,517,306.19	73,151,156.70
基金投资		-	-
债券投资		-	810,747.18
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	-	-
应收清算款		1,615,041.28	648,905.94
应收股利		-	-
应收申购款		8,783.76	15,608.52
递延所得税资产		-	-
其他资产	6. 4. 7. 8	-	-

资产总计		76,645,145.37	78,372,755.36
负债和净资产	附注号	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
<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		804,017.29	914,133.37
应付赎回款		102,187.92	30,474.20
应付管理人报酬		51,936.19	56,756.42
应付托管费		9,165.25	10,015.84
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	136,976.63	182,452.46
负债合计		1,104,283.28	1,193,832.29
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	36,147,068.42	36,977,626.35
未分配利润	6.4.7.12	39,393,793.67	40,201,296.72
净资产合计		75,540,862.09	77,178,923.07
负债和净资产总计		76,645,145.37	78,372,755.36

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 2.090 元，基金份额总额 36,147,068.42 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025 年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年6月30日
<b>一、营业收入</b>		798,004.80	-2,961,314.75
1. 利息收入		7,513.81	10,427.40
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,513.81	10,427.40
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		-	-
其他利息收入		-	-

2. 投资收益（损失以“-”号填列）		1,420,120.62	-10,775,878.34
其中：股票投资收益	6. 4. 7. 14	622,468.56	-11,680,998.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 15	52.82	705.29
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	-	-
股利收益	6. 4. 7. 19	797,599.24	904,414.68
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	-635,983.81	7,795,174.77
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	6,354.18	8,961.42
<b>减：二、营业总支出</b>		471,948.31	536,044.45
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	319,087.08	319,055.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	56,309.53	56,303.79
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		-	-
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	96,551.70	160,685.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		326,056.49	-3,497,359.20
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		326,056.49	-3,497,359.20
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		326,056.49	-3,497,359.20

### 6.3 净资产变动表

会计主体：平安深证 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	36,977,626.35	40,201,296.72	77,178,923.07
二、本期期初净资产	36,977,626.35	40,201,296.72	77,178,923.07
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-830,557.93	-807,503.05	-1,638,060.98
(一)、综合收益总额	-	326,056.49	326,056.49
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-830,557.93	-1,133,559.54	-1,964,117.47
其中:1. 基金申购款	4,107,704.84	4,239,985.79	8,347,690.63
2. 基金赎回款	-4,938,262.77	-5,373,545.33	-10,311,808.10
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	36,147,068.42	39,393,793.67	75,540,862.09
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	39,782,709.01	37,478,248.52	77,260,957.53
二、本期期初净资产	39,782,709.01	37,478,248.52	77,260,957.53
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-498,455.52	-3,932,879.57	-4,431,335.09
(一)、综合收益总额	-	-3,497,359.20	-3,497,359.20
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-498,455.52	-435,520.37	-933,975.89
其中:1. 基金申购款	4,963,120.41	4,404,589.12	9,367,709.53

2. 基金赎回款	-5,461,575.93	-4,840,109.49	-10,301,685.42
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	39,284,253.49	33,545,368.95	72,829,622.44

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

平安深证 300 指数增强型证券投资基金(原名为平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金，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[2011]1689 号《关于核准平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金募集的批复》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《平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 417,679,038.56 元，业经安永华明会计师事务所安永华明(2011)验字第 60937497\_H02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2011 年 12 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 417,710,046.22 份基金份额，其中认购资金利息折合 31,007.66 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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》，平安大华深证 300 指数增强型证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安深证 300 指数增强型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、中期票据、货币市场工具、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规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。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例范围为 90%-95%，其中投资于标的指数成份股的资产占基金资产的比例不低于 80%；除股票外的其他资产占基金资产的比例范围为 5%-10%，在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，基金保留的现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为深证 300 指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%。

#### **6.4.2 会计报表的编制基础**

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安深证 300 指数增强型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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

##### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红

利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
活期存款	4,012,090.74
等于： 本金	4,011,724.90
加： 应计利息	365.84
定期存款	—
等于： 本金	—
加： 应计利息	—
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	—
合计	4,012,090.74

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	67,671,073.68	—	70,517,306.19	2,846,232.51
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	67,671,073.68	—	70,517,306.19	2,846,232.51

### 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

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

**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**

注：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**

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**

注：本基金本报告期末无其他资产。

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2025年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	90.14

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	79,620.23
其中：交易所市场	79,620.23
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	49,588.57
其他	7,677.69
合计	136,976.63

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	36,977,626.35	36,977,626.35
本期申购	4,107,704.84	4,107,704.84
本期赎回(以“-”号填列)	-4,938,262.77	-4,938,262.77
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	36,147,068.42	36,147,068.42

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	46,334,373.35	-6,133,076.63	40,201,296.72
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	46,334,373.35	-6,133,076.63	40,201,296.72
本期利润	962,040.30	-635,983.81	326,056.49
本期基金份额交易产生的变动数	-1,112,672.75	-20,886.79	-1,133,559.54
其中：基金申购款	5,174,899.55	-934,913.76	4,239,985.79
基金赎回款	-6,287,572.30	914,026.97	-5,373,545.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	46,183,740.90	-6,789,947.23	39,393,793.67

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
活期存款利息收入	6,718.87
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	764.86
其他	30.08
合计	7,513.81

### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	622,468.56
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	622,468.56

#### 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
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	405,821,209.16
减：卖出股票成本总额	404,793,691.37
减：交易费用	405,049.23
买卖股票差价收入	622,468.56

#### 6.4.7.14.3 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

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,972.82
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	-3,920.00
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	—
合计	52.82

#### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	812,720.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	803,920.00
减：应计利息总额	12,720.00
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	-3,920.00

#### 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

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	797,599.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	797,599.24

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-635,983.81
股票投资	-637,903.81
债券投资	1,920.00
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-635,983.81

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	6,196.00
基金转换费收入	158.18
合计	6,354.18

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减。赎回费计入基金财产的比例根据《平安深证 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》确认。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

#### 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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	9,916.99
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	3,073.89
指数使用费	43,889.24
合计	96,551.70

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
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

平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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
上海陆金所基金销售有限公司(“陆基金”)	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
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	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

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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 (%)
方正证券	172,697,074.70	21.36	25,065,823.11	16.99
平安证券	-	-	991,975.00	0.67

###### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025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 (%)
方正证券	32,103.76	21.36	32,103.76	40.32
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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 (%)
方正证券	23,569.70	20.38	4,194.92	14.03
平安证券	938.23	0.81	-	-

注：1、上述佣金按协议约定的佣金费率计算，佣金费率由协议签订方参考市场价格确定。

2、于 2024 年 7 月 1 日前，该类佣金协议的服务范围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。自 2024 年 7 月 1 日起，该类佣金协议的服务范围仅包括佣金收取方为本基金提供的证券交易服务。

3、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	319,087.08	319,055.01
其中：应付销售机构的客户维护 费	111,232.03	110,223.56
应支付基金管理人的净管理费	207,855.05	208,831.45

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 0.85% 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 × 0.85% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	56,309.53	56,303.79

注：支付基金托管行的托管费按前一日基金资产净值 0.15% 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 × 0.15% / 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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

注：无。

#### 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 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
中国银行-活期	4,012,090.74	6,718.87	5,648,989.72	9,622.47

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

注：本基金本报告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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2025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
001335	信凯科技	2025年4月2日	6个月	新股锁定	12.80	28.05	57	729.60	1,598.85	-
001388	信通电子	2025年6月24日	6个月	新股锁定	16.42	16.42	43	706.06	706.06	-
001388	信通电子	2025年6月24日	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	383	6,288.86	6,288.86	-
001390	古麒绒材	2025年5月21日	6个月	新股锁定	12.08	18.12	68	821.44	1,232.16	-
301560	众捷汽车	2025年4月17日	6个月	新股锁定	16.50	27.45	83	1,369.50	2,278.35	-
301590	优优绿能	2025年5月28日	6个月	新股锁定	89.60	139.48	17	1,523.20	2,371.16	-
301595	太力科技	2025年5月12日	6个月	新股锁定	17.05	29.10	93	1,585.65	2,706.30	-
301636	泽润新能	2025年4月30日	6个月	新股锁定	33.06	47.46	48	1,586.88	2,278.08	-
301665	泰禾股份	2025年4月2日	6个月	新股锁定	10.27	22.39	191	1,961.57	4,276.49	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上

市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688313	仕佳光子	2025年6月30日	重大事项停牌	38.05	2025年7月11日	39.98	10,131	377,222.43	385,484.55	

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、风控负责人、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）

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券投资（上年度末：本基金未持有除国债、央行票据及政策性金融债之外的债券和资产支持证券）。

#### **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 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
货币资金	4,012,090.74	-	-	-	4,012,090.74
结算备付金	469,377.60	-	-	-	469,377.60
存出保证金	22,545.80	-	-	-	22,545.80
交易性金融资产	-	-	-	70,517,306.19	70,517,306.19
应收申购款	-	-	-	8,783.76	8,783.76
应收清算款	-	-	-	1,615,041.28	1,615,041.28
资产总计	4,504,014.14	-	-	72,141,131.23	76,645,145.37
负债					
应付赎回款	-	-	-	102,187.92	102,187.92
应付管理人报酬	-	-	-	51,936.19	51,936.19
应付托管费	-	-	-	9,165.25	9,165.25
应付清算款	-	-	-	804,017.29	804,017.29
其他负债	-	-	-	136,976.63	136,976.63
负债总计	-	-	-	1,104,283.28	1,104,283.28
利率敏感度缺口	4,504,014.14	-	-	71,036,847.95	75,540,862.09
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,649,873.24	-	-	-	3,649,873.24
结算备付金	83,749.46	-	-	-	83,749.46
存出保证金	12,714.32	-	-	-	12,714.32
交易性金融资产	810,747.18	-	-	73,151,156.70	73,961,903.88
应收申购款	-	-	-	15,608.52	15,608.52
应收清算款	-	-	-	648,905.94	648,905.94
资产总计	4,557,084.20	-	-	73,815,671.16	78,372,755.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	30,474.20	30,474.20
应付管理人报酬	-	-	-	56,756.42	56,756.42
应付托管费	-	-	-	10,015.84	10,015.84
应付清算款	-	-	-	914,133.37	914,133.37
其他负债	-	-	-	182,452.46	182,452.46
负债总计	-	-	-	1,193,832.29	1,193,832.29
利率敏感度缺口	4,557,084.20	-	-	72,621,838.87	77,178,923.07

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月）

		31 日)
市场利率上升 25 个基点	-	-631.62
市场利率下降 25 个基点	-	632.65

#### 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 2025年6月30日		上年度末 2024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	70,517,306.19	93.35	73,151,156.70	94.78
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	70,517,306.19	93.35	73,151,156.70	94.78

#### 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	
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（2025 年 6 月 30 日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,524,437.44
	沪深 300 指数下降 5%	-4,524,437.44
		4,379,410.26
		-4,379,410.26

#### 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	70,108,085.33	72,923,726.70
第二层次	392,479.47	1,038,177.18
第三层次	16,741.39	-
合计	70,517,306.19	73,961,903.88

###### 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等投资，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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 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	70,517,306.19	92.00
	其中：股票	70,517,306.19	92.00
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	4,481,468.34	5.85
8	其他各项资产	1,646,370.84	2.15
9	合计	76,645,145.37	100.00

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,630,320.00	2.16
B	采矿业	732,018.00	0.97
C	制造业	47,859,370.94	63.36

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	223,503.00	0.30
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	372,812.00	0.49
G	交通运输、仓储和邮政业	937,284.00	1.24
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,742,694.00	4.95
J	金融业	5,824,736.00	7.71
K	房地产业	641,695.00	0.85
L	租赁和商务服务业	556,260.00	0.74
M	科学研究和技术服务业	581,025.00	0.77
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	294,310.00	0.39
S	综合	—	—
	合计	63,396,027.94	83.92

### 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	4,726,084.40	6.26
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	1,598.85	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	—	—

	业		
J	金融业	2,015,151.00	2.67
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	378,444.00	0.50
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	7,121,278.25	9.43

### 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	300750	宁德时代	18,920	4,772,002.40	6.32
2	000333	美的集团	35,800	2,584,760.00	3.42
3	300059	东方财富	93,000	2,151,090.00	2.85
4	002594	比亚迪	4,700	1,559,977.00	2.07
5	000651	格力电器	32,600	1,464,392.00	1.94
6	000858	五粮液	12,300	1,462,470.00	1.94
7	002475	立讯精密	32,712	1,134,779.28	1.50
8	000725	京东方A	240,700	960,393.00	1.27
9	300124	汇川技术	13,800	891,066.00	1.18
10	002371	北方华创	2,000	884,420.00	1.17
11	300760	迈瑞医疗	3,900	876,525.00	1.16
12	300308	中际旭创	6,000	875,160.00	1.16
13	002714	牧原股份	18,800	789,788.00	1.05
14	300558	贝达药业	13,500	782,325.00	1.04
15	002352	顺丰控股	15,900	775,284.00	1.03
16	000063	中兴通讯	23,200	753,768.00	1.00
17	300274	阳光电源	11,100	752,247.00	1.00

18	002142	宁波银行	26,300	719,568.00	0.95
19	002179	中航光电	17,796	718,246.56	0.95
20	300498	温氏股份	40,900	698,572.00	0.92
21	002230	科大讯飞	14,100	675,108.00	0.89
22	000768	中航西飞	24,500	669,830.00	0.89
23	300476	胜宏科技	4,600	618,148.00	0.82
24	002202	金风科技	59,300	607,825.00	0.80
25	000100	TCL 科技	134,400	581,952.00	0.77
26	000338	潍柴动力	37,600	578,288.00	0.77
27	300502	新易盛	4,540	576,670.80	0.76
28	002027	分众传媒	76,200	556,260.00	0.74
29	000568	泸州老窖	4,700	532,980.00	0.71
30	000792	盐湖股份	29,400	502,152.00	0.66
31	000893	亚钾国际	16,100	485,254.00	0.64
32	000977	浪潮信息	8,400	427,392.00	0.57
33	002241	歌尔股份	17,600	410,432.00	0.54
34	300033	同花顺	1,500	409,515.00	0.54
35	002463	沪电股份	9,600	408,768.00	0.54
36	300014	亿纬锂能	8,900	407,709.00	0.54
37	000625	长安汽车	31,900	407,044.00	0.54
38	002311	海大集团	6,400	374,976.00	0.50
39	000776	广发证券	21,300	358,053.00	0.47
40	002384	东山精密	9,400	355,038.00	0.47
41	000002	万科 A	53,500	343,470.00	0.45
42	002028	思源电气	4,700	342,677.00	0.45
43	002050	三花智控	12,600	332,388.00	0.44
44	000166	申万宏源	65,000	326,300.00	0.43
45	000938	紫光股份	13,500	323,865.00	0.43
46	300433	蓝思科技	14,500	323,350.00	0.43
47	002049	紫光国微	4,900	322,714.00	0.43
48	002625	光启技术	8,000	319,840.00	0.42
49	300408	三环集团	9,500	317,300.00	0.42
50	002422	科伦药业	8,500	305,320.00	0.40
51	000988	华工科技	6,300	296,163.00	0.39
52	000538	云南白药	5,300	295,687.00	0.39
53	300339	润和软件	5,800	294,814.00	0.39
54	000157	中联重科	38,400	277,632.00	0.37
55	002460	赣锋锂业	8,200	276,914.00	0.37
56	002517	恺英网络	14,200	274,202.00	0.36
57	000975	山金国际	13,800	261,372.00	0.35
58	000807	云铝股份	16,000	255,680.00	0.34
59	300418	昆仑万维	7,500	252,225.00	0.33
60	301236	软通动力	4,600	251,344.00	0.33

61	002236	大华股份	15,800	250,904.00	0.33
62	002074	国轩高科	7,700	249,942.00	0.33
63	002466	天齐锂业	7,300	233,892.00	0.31
64	002736	国信证券	20,300	233,856.00	0.31
65	002001	新和成	10,800	229,716.00	0.30
66	002648	卫星化学	13,200	228,756.00	0.30
67	000963	华东医药	5,600	226,016.00	0.30
68	002966	苏州银行	25,700	225,646.00	0.30
69	300207	欣旺达	11,200	224,672.00	0.30
70	002340	格林美	35,200	223,520.00	0.30
71	000783	长江证券	31,800	220,374.00	0.29
72	002797	第一创业	31,000	219,480.00	0.29
73	001979	招商蛇口	25,000	219,250.00	0.29
74	000661	长春高新	2,200	218,196.00	0.29
75	002558	巨人网络	9,100	214,305.00	0.28
76	000408	藏格矿业	5,000	213,350.00	0.28
77	000895	双汇发展	8,700	212,367.00	0.28
78	002916	深南电路	1,950	210,229.50	0.28
79	002156	通富微电	8,200	210,084.00	0.28
80	000831	中国稀土	5,800	209,496.00	0.28
81	300661	圣邦股份	2,860	208,122.20	0.28
82	002128	电投能源	10,200	201,756.00	0.27
83	300803	指南针	2,500	201,650.00	0.27
84	300450	先导智能	8,100	201,285.00	0.27
85	000066	中国长城	13,600	201,280.00	0.27
86	002465	海格通信	14,400	200,736.00	0.27
87	002600	领益智造	23,300	200,147.00	0.26
88	300347	泰格医药	3,700	197,284.00	0.26
89	002185	华天科技	19,300	194,930.00	0.26
90	002920	德赛西威	1,900	194,047.00	0.26
91	300251	光线传媒	9,500	192,565.00	0.25
92	002850	科达利	1,700	192,389.00	0.25
93	002472	双环传动	5,500	184,195.00	0.24
94	002595	豪迈科技	3,100	183,582.00	0.24
95	300866	安克创新	1,600	181,760.00	0.24
96	300454	深信服	1,900	178,942.00	0.24
97	002493	荣盛石化	21,600	178,848.00	0.24
98	002532	天山铝业	21,500	178,665.00	0.24
99	002353	杰瑞股份	5,100	178,500.00	0.24
100	000933	神火股份	10,700	178,048.00	0.24
101	300759	康龙化成	7,200	176,688.00	0.23
102	002601	龙佰集团	10,600	171,826.00	0.23
103	000630	铜陵有色	51,400	171,676.00	0.23

104	002555	三七互娱	9,900	171,171.00	0.23
105	000786	北新建材	6,300	166,824.00	0.22
106	002624	完美世界	10,800	163,836.00	0.22
107	300442	润泽科技	3,300	163,449.00	0.22
108	002180	纳思达	7,100	162,874.00	0.22
109	001965	招商公路	13,500	162,000.00	0.21
110	301269	华大九天	1,300	161,044.00	0.21
111	002938	鹏鼎控股	5,000	160,150.00	0.21
112	000932	华菱钢铁	35,800	157,520.00	0.21
113	300896	爱美客	900	157,329.00	0.21
114	002294	信立泰	3,300	156,189.00	0.21
115	002065	东华软件	16,100	154,560.00	0.20
116	300496	中科创达	2,700	154,494.00	0.20
117	300017	网宿科技	14,400	154,368.00	0.20
118	300395	菲利华	3,000	153,300.00	0.20
119	000878	云南铜业	12,000	152,640.00	0.20
120	002008	大族激光	6,200	151,094.00	0.20
121	000426	兴业银锡	9,500	150,100.00	0.20
122	302132	中航成飞	1,700	149,498.00	0.20
123	003816	中国广核	41,000	149,240.00	0.20
124	000301	东方盛虹	17,900	149,107.00	0.20
125	300122	智飞生物	7,600	148,884.00	0.20
126	002709	天赐材料	8,200	148,584.00	0.20
127	002281	光迅科技	3,000	147,960.00	0.20
128	002738	中矿资源	4,600	147,936.00	0.20
129	300748	金力永磁	6,200	147,808.00	0.20
130	000034	神州数码	3,900	146,796.00	0.19
131	000423	东阿阿胶	2,800	146,440.00	0.19
132	002273	水晶光电	7,300	145,781.00	0.19
133	300037	新宙邦	4,100	144,320.00	0.19
134	000999	华润三九	4,550	142,324.00	0.19
135	002157	正邦科技	52,000	141,960.00	0.19
136	300054	鼎龙股份	4,900	140,532.00	0.19
137	000733	振华科技	2,800	140,140.00	0.19
138	300765	新诺威	2,700	139,563.00	0.18
139	002223	鱼跃医疗	3,900	138,840.00	0.18
140	300223	北京君正	2,000	138,400.00	0.18
141	000519	中兵红箭	6,300	137,907.00	0.18
142	002436	兴森科技	10,400	137,696.00	0.18
143	002410	广联达	10,200	136,782.00	0.18
144	300628	亿联网络	3,920	136,259.20	0.18
145	300832	新产业	2,400	136,128.00	0.18
146	300316	晶盛机电	5,000	135,750.00	0.18

147	300373	扬杰科技	2,600	134,940.00	0.18
148	000021	深科技	7,200	134,928.00	0.18
149	300001	特锐德	5,600	134,232.00	0.18
150	300073	当升科技	3,000	131,610.00	0.17
151	300474	景嘉微	1,800	131,400.00	0.17
152	002152	广电运通	9,600	129,024.00	0.17
153	002459	晶澳科技	12,900	128,742.00	0.17
154	000750	国海证券	31,200	128,544.00	0.17
155	300012	华测检测	10,900	127,421.00	0.17
156	002821	凯莱英	1,400	123,550.00	0.16
157	300699	光威复材	3,900	123,513.00	0.16
158	000728	国元证券	15,600	123,084.00	0.16
159	002444	巨星科技	4,800	122,448.00	0.16
160	300383	光环新网	8,500	121,550.00	0.16
161	002812	恩捷股份	4,100	120,089.00	0.16
162	002683	广东宏大	3,500	118,790.00	0.16
163	000729	燕京啤酒	9,100	117,663.00	0.16
164	000400	许继电气	5,400	117,558.00	0.16
165	000887	中鼎股份	6,600	116,094.00	0.15
166	002409	雅克科技	2,100	114,849.00	0.15
167	002673	西部证券	14,500	114,260.00	0.15
168	002405	四维图新	13,300	113,582.00	0.15
169	300604	长川科技	2,500	112,275.00	0.15
170	001696	宗申动力	5,000	112,250.00	0.15
171	000738	航发控制	5,400	112,050.00	0.15
172	000960	锡业股份	7,300	111,690.00	0.15
173	002007	华兰生物	7,100	111,257.00	0.15
174	002080	中材科技	5,700	111,150.00	0.15
175	000623	吉林敖东	6,500	110,175.00	0.15
176	002318	久立特材	4,700	109,933.00	0.15
177	002025	航天电器	2,100	107,961.00	0.14
178	300413	芒果超媒	4,900	106,918.00	0.14
179	000617	中油资本	14,300	104,390.00	0.14
180	300144	宋城演艺	11,900	101,745.00	0.13
181	002138	顺络电子	3,600	101,232.00	0.13
182	300724	捷佳伟创	1,800	97,740.00	0.13
183	000009	中国宝安	11,000	97,680.00	0.13
184	002926	华西证券	10,800	96,552.00	0.13
185	002414	高德红外	9,400	96,350.00	0.13
186	000528	柳工	10,000	96,100.00	0.13
187	002939	长城证券	11,300	94,694.00	0.13
188	000513	丽珠集团	2,600	93,704.00	0.12
189	002385	大北农	23,100	93,324.00	0.12

190	300763	锦浪科技	1,600	91,824.00	0.12
191	300285	国瓷材料	5,200	90,220.00	0.12
192	002568	百润股份	3,500	89,635.00	0.12
193	301358	湖南裕能	2,800	87,332.00	0.12
194	002841	视源股份	2,500	86,500.00	0.11
195	000723	美锦能源	19,800	85,536.00	0.11
196	002064	华峰化学	12,900	85,269.00	0.11
197	002262	恩华药业	4,100	85,198.00	0.11
198	000921	海信家电	3,100	79,670.00	0.11
199	300676	华大基因	1,600	79,632.00	0.11
200	002831	裕同科技	3,400	79,628.00	0.11
201	002203	海亮股份	7,700	79,464.00	0.11
202	002244	滨江集团	8,100	78,975.00	0.10
203	301308	江波龙	900	78,741.00	0.10
204	000050	深天马 A	9,100	77,532.00	0.10
205	000739	普洛药业	5,400	75,600.00	0.10
206	000708	中信特钢	6,400	75,264.00	0.10
207	000598	兴蓉环境	10,300	74,263.00	0.10
208	002756	永兴材料	2,300	73,025.00	0.10
209	002653	海思科	1,700	71,774.00	0.10
210	300888	稳健医疗	1,700	69,870.00	0.09

### 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	601198	东兴证券	66,900	745,935.00	0.99
2	600480	凌云股份	36,800	447,856.00	0.59
3	688591	泰凌微	9,342	447,481.80	0.59
4	688520	神州细胞	6,667	399,019.95	0.53
5	002487	大金重工	12,100	398,090.00	0.53
6	688313	仕佳光子	10,131	385,484.55	0.51
7	300443	金雷股份	16,900	381,940.00	0.51
8	688382	益方生物	11,578	379,989.96	0.50
9	600415	小商品城	18,300	378,444.00	0.50
10	600183	生益科技	12,500	376,875.00	0.50
11	600030	中信证券	13,600	375,632.00	0.50
12	688062	迈威生物	13,271	375,303.88	0.50
13	600391	航发科技	12,500	365,000.00	0.48
14	603236	移远通信	4,000	343,200.00	0.45
15	688002	睿创微纳	4,350	303,282.00	0.40
16	600919	江苏银行	16,900	201,786.00	0.27
17	600926	杭州银行	11,300	190,066.00	0.25
18	600000	浦发银行	12,400	172,112.00	0.23

19	601838	成都银行	8,200	164,820.00	0.22
20	601328	交通银行	20,600	164,800.00	0.22
21	300161	华中数控	3,700	98,013.00	0.13
22	001388	信通电子	426	6,994.92	0.01
23	301665	泰禾股份	191	4,276.49	0.01
24	301595	太力科技	93	2,706.30	0.00
25	688800	瑞可达	49	2,410.80	0.00
26	301590	优优绿能	17	2,371.16	0.00
27	301560	众捷汽车	83	2,278.35	0.00
28	301636	泽润新能	48	2,278.08	0.00
29	001335	信凯科技	57	1,598.85	0.00
30	001390	吉麒绒材	68	1,232.16	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	688578	艾力斯	4,712,754.14	6.11
2	300274	阳光电源	4,035,183.00	5.23
3	688235	百济神州	3,761,128.32	4.87
4	688200	华峰测控	3,545,152.81	4.59
5	688382	益方生物	3,340,672.94	4.33
6	000333	美的集团	3,293,594.00	4.27
7	002444	巨星科技	2,978,649.00	3.86
8	300765	新诺威	2,946,082.00	3.82
9	300308	中际旭创	2,842,626.00	3.68
10	002714	牧原股份	2,822,256.00	3.66
11	300498	温氏股份	2,812,870.00	3.64
12	603697	有友食品	2,769,283.00	3.59
13	300415	伊之密	2,714,857.00	3.52
14	688068	热景生物	2,708,610.61	3.51
15	301220	亚香股份	2,569,721.00	3.33
16	002258	利尔化学	2,537,010.00	3.29
17	300723	一品红	2,410,256.50	3.12
18	002415	海康威视	2,404,519.00	3.12
19	688192	迪哲医药	2,366,040.34	3.07
20	300638	广和通	2,338,545.00	3.03
21	605009	豪悦护理	2,314,422.68	3.00
22	688428	诺诚健华	2,306,357.48	2.99
23	600415	小商品城	2,297,754.00	2.98
24	605338	巴比食品	2,277,211.00	2.95
25	300990	同飞股份	2,269,571.00	2.94
26	601100	恒立液压	2,233,598.00	2.89

27	300476	胜宏科技	2,179,782.00	2.82
28	600389	江山股份	2,165,912.00	2.81
29	688266	泽璟制药	2,113,282.92	2.74
30	002352	顺丰控股	2,082,185.00	2.70
31	300850	新强联	2,073,181.22	2.69
32	000858	五粮液	2,065,513.00	2.68
33	003006	百亚股份	2,063,816.00	2.67
34	603173	福斯达	2,056,852.00	2.67
35	300100	双林股份	2,055,014.20	2.66
36	603308	应流股份	2,011,300.00	2.61
37	002850	科达利	1,968,079.00	2.55
38	002518	科士达	1,928,508.00	2.50
39	002294	信立泰	1,900,786.00	2.46
40	300033	同花顺	1,889,527.20	2.45
41	002050	三花智控	1,881,625.00	2.44
42	301061	匠心家居	1,881,014.20	2.44
43	688333	铂力特	1,863,523.90	2.41
44	000566	海南海药	1,851,115.00	2.40
45	301031	中熔电气	1,837,977.80	2.38
46	002080	中材科技	1,837,947.00	2.38
47	300015	爱尔眼科	1,836,396.00	2.38
48	002422	科伦药业	1,835,668.00	2.38
49	002891	中宠股份	1,827,351.00	2.37
50	300442	润泽科技	1,818,927.00	2.36
51	002304	洋河股份	1,779,033.00	2.31
52	601083	锦江航运	1,776,164.00	2.30
53	688313	仕佳光子	1,774,365.38	2.30
54	300866	安克创新	1,757,795.00	2.28
55	000661	长春高新	1,752,159.00	2.27
56	300502	新易盛	1,750,464.00	2.27
57	601702	华峰铝业	1,738,445.00	2.25
58	000893	亚钾国际	1,733,573.00	2.25
59	688433	华曙高科	1,725,220.05	2.24
60	688331	荣昌生物	1,710,420.86	2.22
61	600521	华海药业	1,693,767.00	2.19
62	002126	银轮股份	1,687,471.00	2.19
63	603699	纽威股份	1,687,002.00	2.19
64	300852	四会富仕	1,658,069.00	2.15
65	002779	中坚科技	1,658,022.00	2.15
66	601689	拓普集团	1,629,015.00	2.11
67	603236	移远通信	1,628,173.00	2.11
68	000811	冰轮环境	1,625,697.00	2.11
69	688059	华锐精密	1,587,461.19	2.06

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	688578	艾力斯	4,893,273.26	6.34
2	000333	美的集团	3,965,145.00	5.14
3	688235	百济神州	3,898,168.42	5.05
4	300274	阳光电源	3,630,009.00	4.70
5	688200	华峰测控	3,565,333.36	4.62
6	603697	有友食品	3,543,907.00	4.59
7	002444	巨星科技	3,314,790.00	4.29
8	688382	益方生物	3,049,962.16	3.95
9	301220	亚香股份	2,973,670.00	3.85
10	688068	热景生物	2,968,990.75	3.85
11	300765	新诺威	2,937,429.95	3.81
12	300308	中际旭创	2,930,441.80	3.80
13	002714	牧原股份	2,796,627.36	3.62
14	300415	伊之密	2,730,692.00	3.54
15	002415	海康威视	2,679,990.00	3.47
16	002258	利尔化学	2,584,204.00	3.35
17	300723	一品红	2,555,644.00	3.31
18	300638	广和通	2,471,911.32	3.20
19	688428	诺诚健华	2,331,654.52	3.02
20	601100	恒立液压	2,310,243.00	2.99
21	688192	迪哲医药	2,300,174.69	2.98
22	605338	巴比食品	2,277,564.00	2.95
23	605009	豪悦护理	2,235,018.00	2.90
24	300990	同飞股份	2,205,535.00	2.86
25	600389	江山股份	2,133,826.00	2.76
26	300476	胜宏科技	2,129,328.00	2.76
27	603308	应流股份	2,121,232.00	2.75
28	300850	新强联	2,115,907.27	2.74
29	003006	百亚股份	2,099,745.00	2.72
30	300498	温氏股份	2,093,384.00	2.71
31	002352	顺丰控股	2,087,144.00	2.70
32	688266	泽璟制药	2,081,315.31	2.70
33	301061	匠心家居	2,075,901.60	2.69
34	300100	双林股份	2,007,280.00	2.60
35	300442	润泽科技	2,004,946.00	2.60
36	603173	福斯达	1,984,569.00	2.57
37	300033	同花顺	1,949,198.00	2.53
38	300015	爱尔眼科	1,946,938.00	2.52

39	002518	科士达	1,936,245.00	2.51
40	002050	三花智控	1,934,308.00	2.51
41	000566	海南海药	1,927,348.00	2.50
42	688333	铂力特	1,917,819.18	2.48
43	000858	五粮液	1,907,229.00	2.47
44	002891	中宠股份	1,906,713.00	2.47
45	002294	信立泰	1,901,328.00	2.46
46	600415	小商品城	1,885,553.00	2.44
47	002850	科达利	1,841,049.00	2.39
48	688433	华曙高科	1,828,589.69	2.37
49	002080	中材科技	1,822,784.00	2.36
50	301031	中熔电气	1,793,936.56	2.32
51	601689	拓普集团	1,789,230.00	2.32
52	601083	锦江航运	1,759,800.00	2.28
53	300866	安克创新	1,726,115.00	2.24
54	601702	华峰铝业	1,719,947.00	2.23
55	002304	洋河股份	1,719,732.00	2.23
56	688331	荣昌生物	1,717,936.21	2.23
57	002126	银轮股份	1,700,713.00	2.20
58	002779	中坚科技	1,691,964.00	2.19
59	300502	新易盛	1,690,102.00	2.19
60	603699	纽威股份	1,681,832.00	2.18
61	000811	冰轮环境	1,681,326.10	2.18
62	600521	华海药业	1,676,924.00	2.17
63	300059	东方财富	1,672,428.00	2.17
64	000661	长春高新	1,665,475.00	2.16
65	300852	四会富仕	1,661,398.00	2.15
66	000977	浪潮信息	1,602,548.00	2.08
67	688059	华锐精密	1,599,555.36	2.07
68	002594	比亚迪	1,551,303.00	2.01
69	002475	立讯精密	1,545,992.00	2.00

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	402,797,744.67
卖出股票收入（成交）总额	405,821,209.16

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**

本基金本报告期无股指期货投资。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明****7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期无国债期货投资。

**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**

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	22,545.80
2	应收清算款	1,615,041.28
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	8,783.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,646,370.84

### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
4,485	8,059.55	3,084.72	0.01	36,143,983.70	99.99

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	58,501.49	0.1618

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	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	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011 年 12 月 20 日) 基金份额总额	417,710,046.22
本报告期期初基金份额总额	36,977,626.35
本报告期基金总申购份额	4,107,704.84
减：本报告期基金总赎回份额	4,938,262.77
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	36,147,068.42
--------------	---------------

## § 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

#### 一、基金管理人的重大人事变动

本报告期内，李海波先生新任公司督察长，原督察长陈特正先生转任风控负责人；游自强先生新任公司信息技术负责人，副总经理林婉文女士不再兼任信息技术负责人。

#### 二、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，聘任边济东先生为资产托管部总经理。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼或仲裁。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用容诚会计师事务所（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，基金管理人及其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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单 元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
国泰海通	2	487,061,334	60.24	90,545.42	60.24	

证券		. 19				
方正证券	2	172,697,074 . 70	21. 36	32,103. 76	21. 36	
华泰证券	3	148,758,044 . 51	18. 40	27,652. 24	18. 40	
财通证券	1	-	-	-	-	
诚通证券	1	-	-	-	-	
德邦证券	2	-	-	-	-	
东方证券	3	-	-	-	-	
广发证券	3	-	-	-	-	
国海证券	1	-	-	-	-	
国金证券	1	-	-	-	-	
国联民生 证券	2	-	-	-	-	
国盛证券	1	-	-	-	-	
国投证券	3	-	-	-	-	
国信证券	2	-	-	-	-	
华福证券	2	-	-	-	-	
华西证券	1	-	-	-	-	
平安证券	2	-	-	-	-	
申万宏源 证券	2	-	-	-	-	
天风证券	1	-	-	-	-	
西南证券	1	-	-	-	-	
兴业证券	2	-	-	-	-	
银河证券	2	-	-	-	-	
长城证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	-	-	-	-	
招商证券	2	-	-	-	-	
浙商证券	2	-	-	-	-	
中金公司	2	-	-	-	-	
中泰证券	1	-	-	-	-	
中信建投 证券	1	-	-	-	-	
中信证券	2	-	-	-	-	
中邮证券	2	-	-	-	-	

注：1、基金交易单元的选择标准如下：

(1) 财务状况良好

(2) 经营行为规范

(3) 合规风控能力较高

2、基金管理人根据上述标准，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。

3、报告期内新增交易单元的情况：无。

4、报告期内退租交易单元的情况：减少方正证券交易单元 1 个。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联民生证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

## 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旗下证券投资基金估值调整的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月15日
2	平安深证 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年01月21日
3	平安基金管理有限公司关于旗下基金估值调整情况的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年02月08日
4	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年02月28日
5	平安基金管理有限公司关于终止与北京加和基金销售有限公司相关销售业务合作的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月10日
6	平安基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月11日
7	关于平安基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月20日
8	平安深证 300 指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月20日
9	平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月20日
10	平安深证 300 指数增强型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	2025年03月25日
11	平安深证 300 指数增强型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	2025年03月25日
12	平安深证 300 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月27日
13	平安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况	中国证监会规定报刊及网站	2025年03月31日
14	平安深证 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025年04月21日
15	平安基金管理有限公司关于新增中国邮政储蓄银行股份有限公司为旗下基金销售机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025年05月19日

16	平安基金管理有限公司关于终止与民商基金销售(上海)有限公司相关销售业务合作的公告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 05 月 30 日
17	平安深证 300 指数增强型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	2025 年 05 月 30 日
18	平安深证 300 指数增强型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	2025 年 05 月 30 日
19	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	2025 年 06 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

为降低投资者的理财成本，经与基金托管人协商一致，自 2025 年 3 月 21 起，平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担，并相应修订各基金基金合同有关内容。本次调整后，基金管理人旗下全部指数基金指数使用费均由基金管理人承担。详细内容可阅读本公司于 2025 年 3 月 20 日发布的《关于平安基金管理有限公司旗下部分指数基金指数使用费调整为基金管理人承担并修订基金合同的公告》。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准平安深证 300 指数增强型证券投资基金募集的文件
- (2) 平安深证 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- (3) 平安深证 300 指数增强型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

2025 年 08 月 28 日