

平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资
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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 08 月 30 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 2025 年 08 月 29 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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	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
§ 4 管理人报告	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合规守信情况的说明	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	10
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
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
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	50
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	50

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	51
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	51
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	51
7.12	投资组合报告附注	51
§ 8	基金份额持有人信息	52
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2	期末上市基金前十名持有人	52
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	53
§ 9	开放式基金份额变动	53
§ 10	重大事件揭示	53
10.1	基金份额持有人大会决议	53
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	54
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	54
10.4	基金投资策略的改变	54
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	54
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	54
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	54
10.8	其他重大事件	55
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	57
§ 12	备查文件目录	58
12.1	备查文件目录	58
12.2	存放地点	58
12.3	查阅方式	58

§ 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	128,449,992.00 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	李海波	郭明
	联系电话	0755-88622632	(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	廖林

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	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(2025 年 1 月 1 日-2025 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,336,323.89
本期利润	7,706,783.92
加权平均基金份额本期利 润	0.0560
本期加权平均净值利润率	1.33%
本期基金份额净值增长率	1.36%
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	19,115,251.05
期末可供分配基金份额利 润	0.1488
期末基金资产净值	555,880,212.30
期末基金份额净值	4.3276
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	14.71%

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	3.25%	0.58%	2.50%	0.58%	0.75%	0.00%
过去三个月	2.38%	1.08%	1.25%	1.10%	1.13%	-0.02%
过去六个月	1.36%	1.01%	0.03%	1.02%	1.33%	-0.01%
过去一年	17.03%	1.37%	13.71%	1.38%	3.32%	-0.01%
过去三年	-5.12%	1.09%	-12.24%	1.10%	7.12%	-0.01%
自基金合同生效起至今	14.71%	1.23%	-2.92%	1.24%	17.63%	-0.01%

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		
李严	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2023 年 12 月 25 日	-	4 年	李严先生，复旦大学应用统计学专业硕士，曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 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，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 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、平安中证 500 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联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证

					<p>A500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任平安 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、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、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金、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、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。</p>
--	--	--	--	--	--

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合规守信情况的说明

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

4.3 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

作为一只投资于沪深 300 指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。报告期内，本基金的日均偏离度为 0.02%，年化跟踪误差 0.48%，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 4.3276 元，本报告期基金份额净值增长率为 1.36%，业绩比较基准收益率为 0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025 年上半年，我们已经充分见证了 A 股市场的韧性和想象空间。整个上半年，新质生产力“deepseek”时刻带来盈利增长新锚的想象力，让投资者看到了本轮股市不仅仅是流动性补充和

估值的修复，更有望看到盈利的改善带来中国资产持续性投资价值。对于海外超预期利空因素带来的影响，A 股市场能够快速反应并且实现新高，说明 A 股市场的抗风险能力相较于以往有了更加明显的提升，这是未来慢牛的重要基础。

对于下半年展望。国内方面，财政货币协同发力，强调积极扩大内需，刺激服务业的不断发展和维稳制造业的利润修复，内生增长动能正稳步积累，全年经济增速实现 5%可期。上半年以来 A 股市场走出震荡上行的慢牛格局，筹码结构相对于历史数次牛市更加牢靠稳固，伴随投资热点层出不穷，增量资金逐步入场，市场的“资金-主题-增长”正循环正在形成，长期配置价值逐步凸显。

作为指数化产品管理者，积极做好组合管理，为投资者提供优质投资工具。

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

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 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合规守信、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 2025 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
资产：			
货币资金	6.4.7.1	8,975,410.41	5,549,686.45
结算备付金		2,039,913.94	1,004,621.45
存出保证金		707,103.83	25,181.03
交易性金融资产	6.4.7.2	545,923,650.64	596,373,836.20
其中：股票投资		545,923,650.64	596,373,836.20
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	-	-
应收清算款		103,648.62	119,313.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	-

资产总计		557,825,343.68	603,072,638.63
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
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		894,082.05	58,064.06
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		232,537.23	257,560.64
应付托管费		46,507.45	51,512.11
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	772,004.65	469,571.00
负债合计		1,945,131.38	836,707.81
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	536,764,961.25	589,417,658.26
未分配利润	6.4.7.12	19,115,251.05	12,818,272.56
净资产合计		555,880,212.30	602,235,930.82
负债和净资产总计		557,825,343.68	603,072,638.63

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.3276 元，基金份额总额 128,449,992.00 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：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
一、营业总收入		9,632,214.14	13,246,047.25
1. 利息收入		18,594.91	18,866.87
其中：存款利息收入	6.4.7.13	18,594.91	18,866.87
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“-”填列）		4,240,891.66	-14,730,890.79
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,407,357.37	-21,026,998.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	12,466.93	-
资产支持证券投资 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	121,785.82	-120,878.75
股利收益	6.4.7.19	7,513,996.28	6,138,239.91
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		-	278,746.06
3. 公允价值变动收益 （损失以“-”号填 列）	6.4.7.20	5,370,460.03	27,869,773.20
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	2,267.54	88,297.97
减：二、营业总支出		1,925,430.22	1,928,760.95
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,435,411.60	1,391,401.79
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	287,082.33	278,280.37
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		445.45	202.15
8. 其他费用	6.4.7.23	202,490.84	258,876.64
三、利润总额（亏损总 额以“-”号填列）		7,706,783.92	11,317,286.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		7,706,783.92	11,317,286.30
五、其他综合收益的税 后净额		-	-
六、综合收益总额		7,706,783.92	11,317,286.30

6.3 净资产变动表

会计主体：平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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	589,417,658.26	12,818,272.56	602,235,930.82
二、本期期初净资产	589,417,658.26	12,818,272.56	602,235,930.82
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-52,652,697.01	6,296,978.49	-46,355,718.52
(一)、综合收益总额	-	7,706,783.92	7,706,783.92
(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)	-52,652,697.01	-1,409,805.43	-54,062,502.44
其中：1. 基金申购款	11,282,720.79	-227,751.30	11,054,969.49
2. 基金赎回款	-63,935,417.80	-1,182,054.13	-65,117,471.93
(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	536,764,961.25	19,115,251.05	555,880,212.30
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	683,440,331.45	-89,693,507.67	593,746,823.78
二、本期期初净资产	683,440,331.45	-89,693,507.67	593,746,823.78
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-90,261,766.28	21,426,127.36	-68,835,638.92
(一)、综合收益总额	-	11,317,286.30	11,317,286.30
(二)、本期基金份额交易产生的净资产	-90,261,766.28	10,108,841.06	-80,152,925.22

产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	22,565,441.58	-3,229,101.44	19,336,340.14
2. 基金赎回款	-112,827,207.86	13,337,942.50	-99,489,265.36
（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	593,178,565.17	-68,267,380.31	524,911,184.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金,以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2017]2055 号《关于准予平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 5,721,050,037.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1086 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,723,055,617.00 份,其中认购资金利息折合 2,005,580.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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 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	8,975,410.41
等于：本金	8,974,734.39
加：应计利息	676.02
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	8,975,410.41

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	538,024,316.24	-	545,923,650.64	7,899,334.40
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	538,024,316.24	-	545,923,650.64	7,899,334.40

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 2025年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	5,631,000.00	-	-	
其中： 股指期货投资	5,631,000.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	5,631,000.00	-	-	

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
IF2509	IF2509	5.00	5,830,500.00	199,500.00
合计				199,500.00
减：可抵销期货暂收款				199,500.00
净额				0.00

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,057.18
其中：交易所市场	9,057.18
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	127,794.08
应退退补款	531,277.01
现金差额	103,876.38
合计	772,004.65

注：应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，替代价格与实际买入成本(实际卖出金额)或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

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	141,049,992.00	589,417,658.26
本期申购	2,700,000.00	11,282,720.79
本期赎回（以“-”号填列）	-15,300,000.00	-63,935,417.80
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	128,449,992.00	536,764,961.25

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	142,647,882.50	-129,829,609.94	12,818,272.56
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	142,647,882.50	-129,829,609.94	12,818,272.56

本期利润	2,336,323.89	5,370,460.03	7,706,783.92
本期基金份额交易产生的变动数	-12,848,372.23	11,438,566.80	-1,409,805.43
其中：基金申购款	2,754,247.07	-2,981,998.37	-227,751.30
基金赎回款	-15,602,619.30	14,420,565.17	-1,182,054.13
本期已分配利润	-	-	-
本期末	132,135,834.16	-113,020,583.11	19,115,251.05

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		10,432.90
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		8,128.44
其他		33.57
合计		18,594.91

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		-5,285,930.57
股票投资收益——赎回差价收入		1,878,573.20
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		-3,407,357.37

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		39,505,971.18
减：卖出股票成本总额		44,757,119.72
减：交易费用		34,782.03
买卖股票差价收入		-5,285,930.57

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	
	2025年1月1日至2025年6月30日	

赎回基金份额对价总额	65,117,471.93
减：现金支付赎回款总额	24,633,203.93
减：赎回股票成本总额	38,605,694.80
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,878,573.20

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

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	8.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,458.49
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	12,466.93

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	98,471.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	86,000.00
减：应计利息总额	8.67
减：交易费用	3.93
买卖债券差价收入	12,458.49

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
	2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	121,785.82

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	7,513,996.28
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	7,513,996.28

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	5,170,960.03
股票投资	5,170,960.03
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	199,500.00
权证投资	-
期货投资	199,500.00
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	5,370,460.03

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	-
替代损益	2,267.54
合计	2,267.54

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	313.00
指数使用费	38,533.93
其他	84,300.75
合计	202,490.84

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(“工商银行”)	基金托管人
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

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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	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 (%)
平安证券	47,823,707.83	79.56	24,640,357.93	30.35

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 (%)
平安证券	8,890.02	79.56	7,139.63	78.83
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 (%)
平安证券	18,132.74	30.35	17,108.69	48.00

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	1,435,411.60	1,391,401.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	51,233.57	40,776.74
应支付基金管理人的净管理费	1,384,178.03	1,350,625.05

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 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	287,082.33	278,280.37

注：支付基金托管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

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%）
平安 300ETF 联接基金	114,329,351.00	89.0069	122,399,651.00	86.7775

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

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
工商银行-活期	8,975,410.41	10,432.90	7,063,443.07	9,261.94

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

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

为了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平安集团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和基金管理人关联方方正证券发行的股票方正证券。

(1) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 917,700.00 股工商银行的普通股，成本总额为人民币 4,585,315.03 元，估值总额为人民币 6,965,343.00 元，占基金资产净值的比例为 1.25% (2024 年 12 月 31 日：数量：1,018,000 股；成本：5,048,641.01 元；市值 7,044,560.00 元；占基金资产净值的比例为 1.17%)。

(2) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 282,662.00 股中国平安的普通股，成本总额为人民币 15,196,719.60 元，估值总额为人民币 15,682,087.76 元，占基金资产净值的比例为 2.82% (2024

年 12 月 31 日：数量：312,562 股；成本：16,821,632.38 元；市值：16,456,389.30 元；占基金资产净值的比例：2.73%）。

(3) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 254,126.00 股平安银行的普通股，成本总额为人民币 3,482,882.21 元，估值总额为人民币 3,067,300.82 元，占基金资产净值的比例为 0.55%（2024 年 12 月 31 日：数量：281,826 股；成本：3,876,464.33 元；市值：3,297,364.20 元；占基金资产净值的比例：0.55%）。

(4) 于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有 107,600.00 股方正证券的普通股，成本总额为人民币 812,766.76 元，估值总额为人民币 851,116.00 元，占基金资产净值的比例为 0.15%（2024 年 12 月 31 日：数量：143,500 股；成本：1,084,041.88 元；市值：1,195,355.00 元；占基金资产净值的比例：0.20%）。

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	80	1,024.00	2,244.00	-
001382	新亚电缆	2025 年 3 月 13 日	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
001388	信通电子	2025 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-
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	843	13,842.06	13,842.06	-
001390	古	2025	6 个月	新股	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-

	麒 绒 材	年 5 月 21 日		锁定							
301479	弘 景 光 电	2025 年 3 月 6 日	6 个月	新股 锁定	29.93	77.87	182	5,447.00	14,172.34	-	
301501	恒 鑫 生 活	2025 年 3 月 11 日	6 个月	新股 锁定	27.49	45.22	350	9,620.72	15,827.00	-	
301535	浙 江 华 远	2025 年 3 月 18 日	6 个月	新股 锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-	
301560	众 捷 汽 车	2025 年 4 月 17 日	6 个月	新股 锁定	16.50	27.45	190	3,135.00	5,215.50	-	
301590	优 优 绿 能	2025 年 5 月 28 日	6 个月	新股 锁定	89.60	139.48	73	6,540.80	10,182.04	-	
301595	太 力 科 技	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-	
301636	泽 润 新 能	2025 年 4 月 30 日	6 个月	新股 锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-	
301658	首 航 新 能	2025 年 3 月 26 日	6 个月	新股 锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-	
301665	泰 禾 股 份	2025 年 4 月 2 日	6 个月	新股 锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-	
603014	威 高 血 净	2025 年 5 月 12 日	6 个月	新股 锁定	26.50	32.68	205	5,432.50	6,699.40	-	
603049	中	2025	6 个月	新股	46.50	42.85	268	12,462.00	11,483.80	-	

	策橡胶	年 5 月 27 日		锁定						
603120	肯特催化	2025 年 4 月 9 日	6 个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
603124	江南新材	2025 年 3 月 12 日	6 个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603202	天有为	2025 年 4 月 16 日	6 个月	新股锁定	93.50	90.66	91	8,508.50	8,250.06	-
603210	泰鸿万立	2025 年 4 月 1 日	6 个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603409	汇通控股	2025 年 2 月 25 日	6 个月	新股锁定	24.18	33.32	100	2,418.00	3,332.00	-

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

注：本基金本报告期末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同责任，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会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的发行的证券，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：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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。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员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，并按照合同约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	8,975,410.41	-	-	-	8,975,410.41
结算备付金	2,039,913.94	-	-	-	2,039,913.94
存出保证金	7,443.83	-	-	699,660.00	707,103.83
交易性金融资产	-	-	-	545,923,650.64	545,923,650.64
应收清算款	-	-	-	103,648.62	103,648.62
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	11,022,768.18	-	-	546,802,575.50	557,825,343.68
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	232,537.23	232,537.23
应付托管费	-	-	-	46,507.45	46,507.45
应付清算款	-	-	-	894,082.05	894,082.05
其他负债	-	-	-	772,004.65	772,004.65
负债总计	-	-	-	1,945,131.38	1,945,131.38
利率敏感度缺口	11,022,768.18	-	-	544,857,444.12	555,880,212.30
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	5,549,686.45	-	-	-	5,549,686.45

结算备付金	1,004,621.45	-	-	-	1,004,621.45
存出保证金	25,181.03	-	-	-	25,181.03
交易性金融资产	-	-	-	-596,373,836.20	596,373,836.20
应收清算款	-	-	-	119,313.50	119,313.50
资产总计	6,579,488.93	-	-	-596,493,149.70	603,072,638.63
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	257,560.64	257,560.64
应付托管费	-	-	-	51,512.11	51,512.11
应付清算款	-	-	-	58,064.06	58,064.06
其他负债	-	-	-	469,571.00	469,571.00
负债总计	-	-	-	836,707.81	836,707.81
利率敏感度缺口	6,579,488.93	-	-	-595,656,441.89	602,235,930.82

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：于本报告期末，本基金未持有交易性债券资产投资和交易性资产支持证券投资（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：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，所面临的重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	545,923,650.64	98.21	596,373,836.20	99.03
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	545,923,650.64	98.21	596,373,836.20	99.03

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）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	27,506,792.29	29,743,756.07
	沪深 300 指数下降 5%	-27,506,792.29	-29,743,756.07

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	545,764,965.38	595,205,203.09
第二层次	15,385.54	980,476.00
第三层次	143,299.72	188,157.11
合计	545,923,650.64	596,373,836.20

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	545,923,650.64	97.87
	其中：股票	545,923,650.64	97.87
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	11,015,324.35	1.97
8	其他各项资产	886,368.69	0.16
9	合计	557,825,343.68	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	5,386,501.21	0.97
B	采矿业	27,402,313.76	4.93
C	制造业	272,546,508.67	49.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,852,937.72	3.57
E	建筑业	10,355,967.92	1.86
F	批发和零售业	1,321,119.20	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	19,317,482.97	3.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,878,262.37	4.66
J	金融业	147,247,644.22	26.49
K	房地产业	4,060,466.62	0.73
L	租赁和商务服务业	5,007,154.04	0.90
M	科学研究和技术服务业	5,856,549.40	1.05
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	1,532,057.28	0.28
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	545,764,965.38	98.18

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	156,441.26	0.03
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	2,244.00	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	158,685.26	0.03

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	16,576	23,364,203.52	4.20
2	300750	宁德时代	69,360	17,493,979.20	3.15
3	601318	中国平安	282,662	15,682,087.76	2.82
4	600036	招商银行	325,103	14,938,482.85	2.69
5	601166	兴业银行	436,379	10,185,085.86	1.83

6	600900	长江电力	321,198	9,680,907.72	1.74
7	000333	美的集团	128,998	9,313,655.60	1.68
8	601899	紫金矿业	432,350	8,430,825.00	1.52
9	002594	比亚迪	23,700	7,866,267.00	1.42
10	300059	东方财富	331,862	7,675,968.06	1.38
11	600030	中信证券	256,441	7,082,900.42	1.27
12	601398	工商银行	917,700	6,965,343.00	1.25
13	600276	恒瑞医药	117,053	6,075,050.70	1.09
14	000858	五粮液	50,910	6,053,199.00	1.09
15	601211	国泰海通	295,900	5,669,444.00	1.02
16	601328	交通银行	700,631	5,605,048.00	1.01
17	000651	格力电器	117,516	5,278,818.72	0.95
18	601288	农业银行	835,600	4,913,328.00	0.88
19	002475	立讯精密	133,465	4,629,900.85	0.83
20	600887	伊利股份	165,497	4,614,056.36	0.83
21	600919	江苏银行	386,330	4,612,780.20	0.83
22	688981	中芯国际	52,100	4,593,657.00	0.83
23	603259	药明康德	65,588	4,561,645.40	0.82
24	601816	京沪高铁	768,500	4,418,875.00	0.79
25	600000	浦发银行	307,375	4,266,365.00	0.77
26	000725	京东方 A	961,300	3,835,587.00	0.69
27	002371	北方华创	8,300	3,670,343.00	0.66
28	300760	迈瑞医疗	15,900	3,573,525.00	0.64
29	601088	中国神华	86,400	3,502,656.00	0.63
30	688041	海光信息	24,400	3,447,476.00	0.62
31	300308	中际旭创	23,280	3,395,620.80	0.61
32	601601	中国太保	90,227	3,384,414.77	0.61
33	688256	寒武纪	5,500	3,308,250.00	0.60
34	300502	新易盛	26,040	3,307,600.80	0.60
35	300124	汇川技术	49,150	3,173,615.50	0.57
36	601728	中国电信	406,500	3,150,375.00	0.57
37	601668	中国建筑	540,700	3,119,839.00	0.56
38	600016	民生银行	650,100	3,087,975.00	0.56
39	002352	顺丰控股	63,213	3,082,265.88	0.55
40	000001	平安银行	254,126	3,067,300.82	0.55
41	002714	牧原股份	71,577	3,006,949.77	0.54
42	002230	科大讯飞	60,703	2,906,459.64	0.52
43	601127	赛力斯	21,400	2,874,448.00	0.52
44	603501	豪威集团	22,244	2,839,446.60	0.51
45	600031	三一重工	155,400	2,789,430.00	0.50
46	601229	上海银行	260,170	2,760,403.70	0.50
47	000063	中兴通讯	84,400	2,742,156.00	0.49
48	603019	中科曙光	38,140	2,685,056.00	0.48

49	002415	海康威视	96,616	2,679,161.68	0.48
50	600309	万华化学	49,101	2,664,220.26	0.48
51	600941	中国移动	23,600	2,656,180.00	0.48
52	601169	北京银行	387,254	2,644,944.82	0.48
53	300274	阳光电源	37,880	2,567,127.60	0.46
54	601857	中国石油	296,800	2,537,640.00	0.46
55	601919	中远海控	164,970	2,481,148.80	0.45
56	688008	澜起科技	30,054	2,464,428.00	0.44
57	600690	海尔智家	98,300	2,435,874.00	0.44
58	601688	华泰证券	134,501	2,395,462.81	0.43
59	600660	福耀玻璃	41,984	2,393,507.84	0.43
60	601012	隆基绿能	158,874	2,386,287.48	0.43
61	300498	温氏股份	139,318	2,379,551.44	0.43
62	002142	宁波银行	86,574	2,368,664.64	0.43
63	600406	国电南瑞	105,024	2,353,587.84	0.42
64	600809	山西汾酒	12,820	2,261,319.80	0.41
65	601766	中国中车	321,030	2,260,051.20	0.41
66	601138	工业富联	104,900	2,242,762.00	0.40
67	603986	兆易创新	17,433	2,205,797.49	0.40
68	000568	泸州老窖	19,400	2,199,960.00	0.40
69	600050	中国联通	409,400	2,186,196.00	0.39
70	000338	潍柴动力	141,900	2,182,422.00	0.39
71	600028	中国石化	382,000	2,154,480.00	0.39
72	000100	TCL 科技	491,680	2,128,974.40	0.38
73	688012	中微公司	11,578	2,110,669.40	0.38
74	601988	中国银行	375,500	2,110,310.00	0.38
75	601006	大秦铁路	316,257	2,087,296.20	0.38
76	601818	光大银行	490,100	2,033,915.00	0.37
77	600926	杭州银行	120,200	2,021,764.00	0.36
78	601985	中国核电	215,600	2,009,392.00	0.36
79	601225	陕西煤业	101,700	1,956,708.00	0.35
80	600104	上汽集团	121,806	1,954,986.30	0.35
81	002027	分众传媒	267,000	1,949,100.00	0.35
82	600150	中国船舶	58,600	1,906,844.00	0.34
83	601628	中国人寿	43,700	1,800,003.00	0.32
84	601009	南京银行	154,313	1,793,117.06	0.32
85	605499	东鹏饮料	5,510	1,730,415.50	0.31
86	600999	招商证券	97,994	1,723,714.46	0.31
87	688111	金山办公	6,116	1,712,785.80	0.31
88	603288	海天味业	43,776	1,703,324.16	0.31
89	600760	中航沈飞	28,995	1,699,686.90	0.31
90	688271	联影医疗	13,200	1,686,168.00	0.30
91	000625	长安汽车	131,596	1,679,164.96	0.30

92	000425	徐工机械	215,600	1,675,212.00	0.30
93	601939	建设银行	176,821	1,669,190.24	0.30
94	000792	盐湖股份	96,900	1,655,052.00	0.30
95	600111	北方稀土	66,450	1,654,605.00	0.30
96	600938	中国海油	62,900	1,642,319.00	0.30
97	600905	三峡能源	377,800	1,609,428.00	0.29
98	600089	特变电工	134,220	1,601,244.60	0.29
99	601658	邮储银行	289,200	1,581,924.00	0.28
100	300033	同花顺	5,760	1,572,537.60	0.28
101	002050	三花智控	59,417	1,567,420.46	0.28
102	600436	片仔癀	7,800	1,560,078.00	0.28
103	601888	中国中免	25,532	1,556,686.04	0.28
104	603993	洛阳钼业	184,000	1,549,280.00	0.28
105	600048	保利发展	190,450	1,542,645.00	0.28
106	300015	爱尔眼科	122,761	1,532,057.28	0.28
107	601390	中国中铁	271,700	1,524,237.00	0.27
108	600547	山东黄金	47,540	1,517,952.20	0.27
109	600019	宝钢股份	229,638	1,513,314.42	0.27
110	002463	沪电股份	35,300	1,503,074.00	0.27
111	600415	小商品城	72,600	1,501,368.00	0.27
112	002241	歌尔股份	63,718	1,485,903.76	0.27
113	300014	亿纬锂能	32,322	1,480,670.82	0.27
114	601600	中国铝业	209,200	1,472,768.00	0.26
115	601825	沪农商行	151,400	1,468,580.00	0.26
116	601989	中国重工	303,670	1,409,028.80	0.25
117	000977	浪潮信息	26,908	1,369,079.04	0.25
118	600893	航发动力	35,263	1,359,036.02	0.24
119	600585	海螺水泥	63,089	1,354,520.83	0.24
120	002179	中航光电	33,480	1,351,252.80	0.24
121	601838	成都银行	67,100	1,348,710.00	0.24
122	601916	浙商银行	394,900	1,338,711.00	0.24
123	600958	东方证券	137,852	1,334,407.36	0.24
124	600570	恒生电子	39,764	1,333,684.56	0.24
125	600015	华夏银行	168,100	1,329,671.00	0.24
126	603799	华友钴业	35,751	1,323,502.02	0.24
127	000538	云南白药	23,420	1,306,601.80	0.24
128	000776	广发证券	77,500	1,302,775.00	0.23
129	600584	长电科技	37,900	1,276,851.00	0.23
130	002311	海大集团	21,700	1,271,403.00	0.23
131	601336	新华保险	21,700	1,269,450.00	0.23
132	000938	紫光股份	52,273	1,254,029.27	0.23
133	002028	思源电气	16,600	1,210,306.00	0.22
134	600438	通威股份	71,500	1,197,625.00	0.22

135	000166	申万宏源	235,961	1,184,524.22	0.21
136	002049	紫光国微	17,940	1,181,528.40	0.21
137	601998	中信银行	138,700	1,178,950.00	0.21
138	300408	三环集团	35,235	1,176,849.00	0.21
139	300433	蓝思科技	52,238	1,164,907.40	0.21
140	601077	渝农商行	161,900	1,155,966.00	0.21
141	000002	万 科 A	179,454	1,152,094.68	0.21
142	600795	国电电力	233,300	1,129,172.00	0.20
143	600489	中金黄金	77,000	1,126,510.00	0.20
144	601377	兴业证券	180,840	1,119,399.60	0.20
145	601669	中国电建	229,600	1,118,152.00	0.20
146	601995	中金公司	31,200	1,103,232.00	0.20
147	601689	拓普集团	22,575	1,066,668.75	0.19
148	002422	科伦药业	29,300	1,052,456.00	0.19
149	600009	上海机场	32,717	1,039,419.09	0.19
150	002304	洋河股份	16,081	1,038,028.55	0.19
151	601100	恒立液压	14,056	1,012,032.00	0.18
152	600160	巨化股份	35,000	1,003,800.00	0.18
153	002460	赣锋锂业	29,700	1,002,969.00	0.18
154	601881	中国银河	57,916	993,259.40	0.18
155	002252	上海莱士	144,000	989,280.00	0.18
156	000768	中航西飞	36,169	988,860.46	0.18
157	600183	生益科技	32,525	980,628.75	0.18
158	688036	传音控股	12,176	970,427.20	0.17
159	601186	中国铁建	121,000	969,210.00	0.17
160	300394	天孚通信	12,100	966,064.00	0.17
161	600989	宝丰能源	58,800	949,032.00	0.17
162	000157	中联重科	131,200	948,576.00	0.17
163	600886	国投电力	63,800	940,412.00	0.17
164	601360	三六零	91,822	936,584.40	0.17
165	601788	光大证券	52,000	934,960.00	0.17
166	000963	华东医药	23,120	933,123.20	0.17
167	002074	国轩高科	28,500	925,110.00	0.17
168	600115	中国东航	227,600	917,228.00	0.17
169	300442	润泽科技	18,100	896,493.00	0.16
170	000408	藏格矿业	20,800	887,536.00	0.16
171	002466	天齐锂业	27,245	872,929.80	0.16
172	000807	云铝股份	54,600	872,508.00	0.16
173	002736	国信证券	75,700	872,064.00	0.16
174	600066	宇通客车	35,000	870,100.00	0.16
175	002001	新 和 成	40,639	864,391.53	0.16
176	600426	华鲁恒升	39,700	860,299.00	0.15
177	600196	复星医药	34,200	858,078.00	0.15

178	688169	石头科技	5,460	854,763.00	0.15
179	601901	方正证券	107,600	851,116.00	0.15
180	601800	中国交建	95,200	846,328.00	0.15
181	600029	南方航空	143,400	846,060.00	0.15
182	600011	华能国际	117,700	840,378.00	0.15
183	002236	大华股份	52,800	838,464.00	0.15
184	000975	山金国际	44,200	837,148.00	0.15
185	001979	招商蛇口	95,422	836,850.94	0.15
186	600674	川投能源	51,900	832,476.00	0.15
187	688126	沪硅产业	44,200	827,424.00	0.15
188	000661	长春高新	8,310	824,185.80	0.15
189	601066	中信建投	34,100	820,105.00	0.15
190	301236	软通动力	15,000	819,600.00	0.15
191	300661	圣邦股份	11,223	816,697.71	0.15
192	600346	恒力石化	55,780	795,422.80	0.14
193	601878	浙商证券	72,700	793,157.00	0.14
194	601111	中国国航	99,300	783,477.00	0.14
195	601868	中国能建	348,400	776,932.00	0.14
196	603369	今世缘	19,772	769,723.96	0.14
197	600460	士兰微	31,000	769,420.00	0.14
198	300418	昆仑万维	22,800	766,764.00	0.14
199	002648	卫星化学	44,217	766,280.61	0.14
200	600372	中航机载	63,100	760,986.00	0.14
201	003816	中国广核	206,100	750,204.00	0.13
202	601117	中国化学	97,500	747,825.00	0.13
203	600741	华域汽车	42,067	742,482.55	0.13
204	002916	深南电路	6,835	736,881.35	0.13
205	300347	泰格医药	13,700	730,484.00	0.13
206	601319	中国人保	83,867	730,481.57	0.13
207	601021	春秋航空	13,100	729,015.00	0.13
208	002601	龙佰集团	44,800	726,208.00	0.13
209	002920	德赛西威	7,100	725,123.00	0.13
210	601633	长城汽车	33,700	723,876.00	0.13
211	300896	爱美客	4,140	723,713.40	0.13
212	301269	华大九天	5,800	718,504.00	0.13
213	600176	中国巨石	63,011	718,325.40	0.13
214	600588	用友网络	53,571	716,244.27	0.13
215	000786	北新建材	26,700	707,016.00	0.13
216	600219	南山铝业	182,900	700,507.00	0.13
217	300782	卓胜微	9,748	695,714.76	0.13
218	600482	中国动力	29,900	689,793.00	0.12
219	600039	四川路桥	68,680	679,932.00	0.12
220	000630	铜陵有色	203,400	679,356.00	0.12

221	688396	华润微	14,334	675,991.44	0.12
222	000895	双汇发展	27,410	669,078.10	0.12
223	002493	荣盛石化	80,375	665,505.00	0.12
224	002129	TCL 中环	86,050	660,864.00	0.12
225	302132	中航成飞	7,500	659,550.00	0.12
226	600085	同仁堂	18,000	649,080.00	0.12
227	601877	正泰电器	28,585	648,021.95	0.12
228	600362	江西铜业	27,500	644,325.00	0.12
229	001965	招商公路	53,600	643,200.00	0.12
230	600600	青岛啤酒	9,100	632,086.00	0.11
231	002600	领益智造	73,500	631,365.00	0.11
232	002709	天赐材料	34,700	628,764.00	0.11
233	300122	智飞生物	31,971	626,311.89	0.11
234	688506	百利天恒	2,100	621,852.00	0.11
235	603296	华勤技术	7,700	621,236.00	0.11
236	600161	天坛生物	31,560	605,636.40	0.11
237	002938	鹏鼎控股	18,800	602,164.00	0.11
238	002180	纳思达	26,100	598,734.00	0.11
239	600233	圆通速递	46,400	598,096.00	0.11
240	000301	东方盛虹	70,800	589,764.00	0.11
241	000596	古井贡酒	4,400	585,860.00	0.11
242	603392	万泰生物	9,579	584,319.00	0.11
243	600188	兖矿能源	47,240	574,910.80	0.10
244	688047	龙芯中科	4,300	573,577.00	0.10
245	601618	中国中冶	192,454	573,512.92	0.10
246	300832	新产业	10,000	567,200.00	0.10
247	000876	新希望	60,200	564,676.00	0.10
248	300759	康龙化成	23,000	564,420.00	0.10
249	600023	浙能电力	105,600	559,680.00	0.10
250	000999	华润三九	17,777	556,064.56	0.10
251	688223	晶科能源	105,800	549,102.00	0.10
252	601872	招商轮船	87,200	545,872.00	0.10
253	600875	东方电气	32,400	542,376.00	0.10
254	002459	晶澳科技	53,428	533,211.44	0.10
255	601898	中煤能源	48,600	531,684.00	0.10
256	600515	海南机场	149,400	528,876.00	0.10
257	600027	华电国际	96,100	525,667.00	0.09
258	600845	宝信软件	22,207	524,529.34	0.09
259	688599	天合光能	35,500	515,815.00	0.09
260	600061	国投资本	68,045	511,698.40	0.09
261	600332	白云山	19,017	501,288.12	0.09
262	605117	德业股份	9,348	492,265.68	0.09
263	000617	中油资本	66,300	483,990.00	0.09

264	000983	山西焦煤	75,200	481,280.00	0.09
265	600918	中泰证券	74,400	478,392.00	0.09
266	601799	星宇股份	3,800	475,000.00	0.09
267	300628	亿联网络	13,541	470,685.16	0.08
268	300316	晶盛机电	17,300	469,695.00	0.08
269	300999	金龙鱼	15,900	469,527.00	0.08
270	600025	华能水电	47,900	457,445.00	0.08
271	600803	新奥股份	23,800	449,820.00	0.08
272	601698	中国卫通	21,900	448,293.00	0.08
273	601238	广汽集团	59,340	444,456.60	0.08
274	300413	芒果超媒	20,336	443,731.52	0.08
275	603260	合盛硅业	9,300	440,820.00	0.08
276	601059	信达证券	25,300	432,630.00	0.08
277	600018	上港集团	74,400	424,824.00	0.08
278	601607	上海医药	21,700	387,996.00	0.07
279	600026	中远海能	36,000	371,880.00	0.07
280	603806	福斯特	28,049	363,515.04	0.07
281	688303	大全能源	16,800	358,176.00	0.06
282	688472	阿特斯	38,600	353,190.00	0.06
283	688009	中国通号	67,900	349,006.00	0.06
284	601699	潞安环能	32,500	342,875.00	0.06
285	603195	公牛集团	6,863	331,139.75	0.06
286	601865	福莱特	20,700	314,847.00	0.06
287	000708	中信特钢	26,630	313,168.80	0.06
288	601236	红塔证券	36,680	310,679.60	0.06
289	688187	时代电气	7,100	302,815.00	0.05
290	603833	欧派家居	5,174	292,072.30	0.05
291	601136	首创证券	14,500	288,260.00	0.05
292	688082	盛美上海	2,500	284,850.00	0.05
293	300979	华利集团	4,300	226,051.00	0.04
294	601808	中海油服	15,701	216,045.76	0.04
295	600377	宁沪高速	13,000	199,420.00	0.04
296	000800	一汽解放	26,700	183,162.00	0.03
297	001391	国货航	22,200	149,406.00	0.03
298	001289	龙源电力	4,200	67,956.00	0.01

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	301501	恒鑫生活	350	15,827.00	0.00
2	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
3	301479	弘景光电	182	14,172.34	0.00
4	301535	浙江华远	734	13,938.66	0.00

5	603049	中策橡胶	268	11,483.80	0.00
6	301590	优优绿能	73	10,182.04	0.00
7	301658	首航新能	437	10,042.26	0.00
8	301665	泰禾股份	393	8,799.27	0.00
9	603202	天有为	91	8,250.06	0.00
10	001382	新亚电缆	366	7,396.86	0.00
11	603014	威高血净	205	6,699.40	0.00
12	301636	泽润新能	128	6,074.88	0.00
13	301595	太力科技	196	5,703.60	0.00
14	301560	众捷汽车	190	5,215.50	0.00
15	603210	泰鸿万立	286	4,464.46	0.00
16	603124	江南新材	88	4,075.28	0.00
17	603409	汇通控股	100	3,332.00	0.00
18	001390	古麒绒材	178	3,225.36	0.00
19	001335	信凯科技	80	2,244.00	0.00
20	603120	肯特催化	65	2,172.95	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	601211	国泰海通	3,196,475.00	0.53
2	601825	沪农商行	1,557,456.00	0.26
3	601166	兴业银行	1,393,304.00	0.23
4	601077	渝农商行	1,217,422.00	0.20
5	301236	软通动力	832,338.00	0.14
6	601328	交通银行	701,698.00	0.12
7	302132	中航成飞	664,439.00	0.11
8	002230	科大讯飞	627,077.00	0.10
9	002600	领益智造	622,305.00	0.10
10	601006	大秦铁路	533,412.00	0.09
11	688047	龙芯中科	529,132.02	0.09
12	300750	宁德时代	463,184.00	0.08
13	600926	杭州银行	437,107.00	0.07
14	002371	北方华创	347,481.00	0.06
15	601838	成都银行	310,590.00	0.05
16	601998	中信银行	303,563.00	0.05
17	002594	比亚迪	299,262.00	0.05
18	688271	联影医疗	263,868.19	0.04
19	601988	中国银行	256,480.00	0.04
20	000858	五粮液	244,009.00	0.04

注：“买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,353,467.00	0.39
2	601988	中国银行	1,261,951.00	0.21
3	002594	比亚迪	1,247,364.00	0.21
4	000333	美的集团	1,174,404.00	0.20
5	300059	东方财富	994,918.00	0.17
6	300124	汇川技术	952,653.00	0.16
7	000858	五粮液	925,098.00	0.15
8	600745	闻泰科技	756,809.37	0.13
9	002371	北方华创	736,083.00	0.12
10	300450	先导智能	721,156.80	0.12
11	002555	三七互娱	691,001.00	0.11
12	000651	格力电器	674,824.00	0.11
13	002271	东方雨虹	628,500.40	0.10
14	600010	宝钢股份	613,645.00	0.10
15	002475	立讯精密	579,466.00	0.10
16	002007	华兰生物	542,026.70	0.09
17	000725	京东方 A	538,468.00	0.09
18	603659	璞泰来	490,658.06	0.08
19	002812	恩捷股份	483,533.00	0.08
20	300760	迈瑞医疗	468,722.00	0.08

注：“卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,461,304.16
卖出股票收入（成交）总额	39,505,971.18

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金以跟踪误差最小化为目标，选用流动性较好的股指期货合约作为投资标的。报告期内，较好的实现了投资目标。

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	707,103.83
2	应收清算款	103,648.62
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	886,368.69

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	301501	恒鑫生活	15,827.00	0.00	新股锁定
2	001388	信通电子	13,842.06	0.00	新股未上市
2	001388	信通电子	1,543.48	0.00	新股锁定
3	301479	弘景光电	14,172.34	0.00	新股锁定
4	301535	浙江华远	13,938.66	0.00	新股锁定
5	603049	中策橡胶	11,483.80	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 (%)
1,385	92,743.68	117,785,822.00	91.70	10,664,170.00	8.30

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	114,329,351.00	89.01

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	梁碧娟	717,909.00	0.56
2	浙商证券股份有限公司	657,480.00	0.51
3	国泰海通证券股份有限公司	647,390.00	0.50

4	广发证券股份有限公司	566,860.00	0.44
5	中信建投证券股份有限公司	418,193.00	0.33
6	洗润章	299,608.00	0.23
7	巴根纳	299,200.00	0.23
8	任建敏	298,400.00	0.23
9	银华乾利 2 号股票型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	266,000.00	0.21
10	韩仕杰	250,800.00	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	114,329,351.00	89.01

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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2017年12月25日)基金份额总额	5,723,055,617.00
本报告期期初基金份额总额	141,049,992.00
本报告期基金总申购份额	2,700,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	15,300,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	128,449,992.00

§ 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

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

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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：本报告期内，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：本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 (%)	
平安证券	2	47,823,707.83	79.56	8,890.02	79.56	
中信建投证券	2	12,287,908.21	20.44	2,284.58	20.44	
诚通证券	2	-	-	-	-	
东方证券	2	-	-	-	-	
广发证券	2	-	-	-	-	
国盛证券	1	-	-	-	-	
国泰海通证券	2	-	-	-	-	

太平洋证券	2	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-
中泰证券	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：减少广发证券交易单元 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 (%)
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	98,471.09	100.00	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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基金新增国盛证券有限责任公司为申	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 01 月 08 日

	购赎回代办机构的公告		
2	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增大同证券有限责任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	2025 年 01 月 08 日
3	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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
4	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增华鑫证券有限责任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	2025 年 01 月 24 日
5	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
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 02 月 28 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增江海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	2025 年 03 月 05 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增山西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	2025 年 03 月 05 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增东莞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	2025 年 03 月 05 日
10	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
11	平安沪深 300 交易型开放式指数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
12	平安沪深 300 交易型开放式指数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
13	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
14	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	2025 年 03 月 25 日
15	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	2025 年 03 月 25 日
16	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2025 年 03 月 29 日
17	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
18	平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 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
19	平安沪深 300 交易型开放式指数证	中国证监会规定报刊及	2025 年 05 月 30 日

	券投资基金基金产品资料概要更新	网站	
20	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	2025 年 05 月 30 日
21	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国海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	2025 年 06 月 27 日
22	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

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	2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日	122,399,651.00	900,000.00	8,970,300.00	114,329,351.00	89.01

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

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 日起，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

2025 年 08 月 30 日