

平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 26 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 25 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。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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.....	6
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	14
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	14
§4 管理人报告	15
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	15
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	16
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	18
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	19
4.9 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.....	19
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	20
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.....	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	20
§6 审计报告	21
6.1 审计报告基本信息.....	21
6.2 审计报告的基本内容.....	21
§7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表.....	24
7.2 利润表.....	26
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	27
7.4 报表附注.....	29
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况.....	59
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	59
8.3 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.....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	69
8.6 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.....	70

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	70
8.8 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	70
8.9 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	70
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	71
§9 基金份额持有人信息	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
9.3 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的情况	75
§10 开放式基金份额变动	76
§11 重大事件揭示	77
11.1 基金份额持有人大会决议	77
11.2 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	77
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
11.4 基金投资策略的改变	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息	85
12.1 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	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§13 备查文件目录	86
13.1 备查文件目录	86
13.2 存放地点	86
13.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金	
基金简称	平安沪深 300 指数量化增强	
场内简称	-	
基金主代码	005113	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2017 年 12 月 26 日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	34,701,169.87 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增 强 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	005113	005114
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	24,526,289.23 份	10,174,880.64 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数复制结合相对增强的投资策略，即通过指数复制的方法拟合、跟踪沪深 300 指数，并在严格控制跟踪偏离度和跟踪误差的前提下进行相对增强的组合管理。力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	本基金采用全样本复制的方式进行指数化投资，并结合相对增强投资策略，以

	达到或超越具有良好市场代表性、流动性与投资性的沪深 300 指数的收益率水平，为投资者提供一个有效分享中国经济持续增长过程中带来的系统性投资机会。	
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。	
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其风险收益水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。同时，本基金主要采用指数复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。	
	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	funds@pingan.com.cn	Lishuaishuai130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387
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	深圳市罗湖区深南东路 5047 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	深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		518048	518001
法定代表人		罗春风	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2018 年		2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)-2017 年 12 月 31 日		2016 年	
	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C	平安沪深 300 指数量化增强 A	平安沪深 300 指数量化增强 C
本期已实现收益	-17,203,388.96	-3,595,907.30	188,150.64	120,312.09	-	-
本期利润	-19,934,888.60	-2,270,985.69	188,150.64	120,312.09	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2559	-0.1148	0.0015	0.0014	-	-
本期加权平均净值利润率	-28.56%	-12.40%	0.15%	0.14%	-	-
本期基金份额净值增长率	-26.82%	-27.42%	0.15%	0.14%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末可供	-6,551,097.78	-2,779,999.86	188,150.64	120,312.09	-	-

分配利润						
期末可供分配基金份额利润	-0.2671	-0.2732	0.0015	0.0014	-	-
期末基金资产净值	17,975,191.45	7,394,880.78	126,377,266.80	84,701,384.48	-	-
期末基金份额净值	0.7329	0.7268	1.0015	1.0014	-	-
3.1.3 累计期末指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
基金份额累计净值增长率	-26.71%	-27.32%	0.15%	0.14%	-	-

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安沪深 300 指数量化增强 A

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
过去三个月	-11.36%	1.45%	-11.83%	1.56%	0.47%	-0.11%
过去六个月	-13.21%	1.35%	-13.52%	1.42%	0.31%	-0.07%
过去一年	-26.82%	1.21%	-24.12%	1.27%	-2.70%	-0.06%

自基金合同 生效起至今	-26.71%	1.20%	-24.31%	1.26%	-2.40%	-0.06%
----------------	---------	-------	---------	-------	--------	--------

平安沪深 300 指数量化增强 C

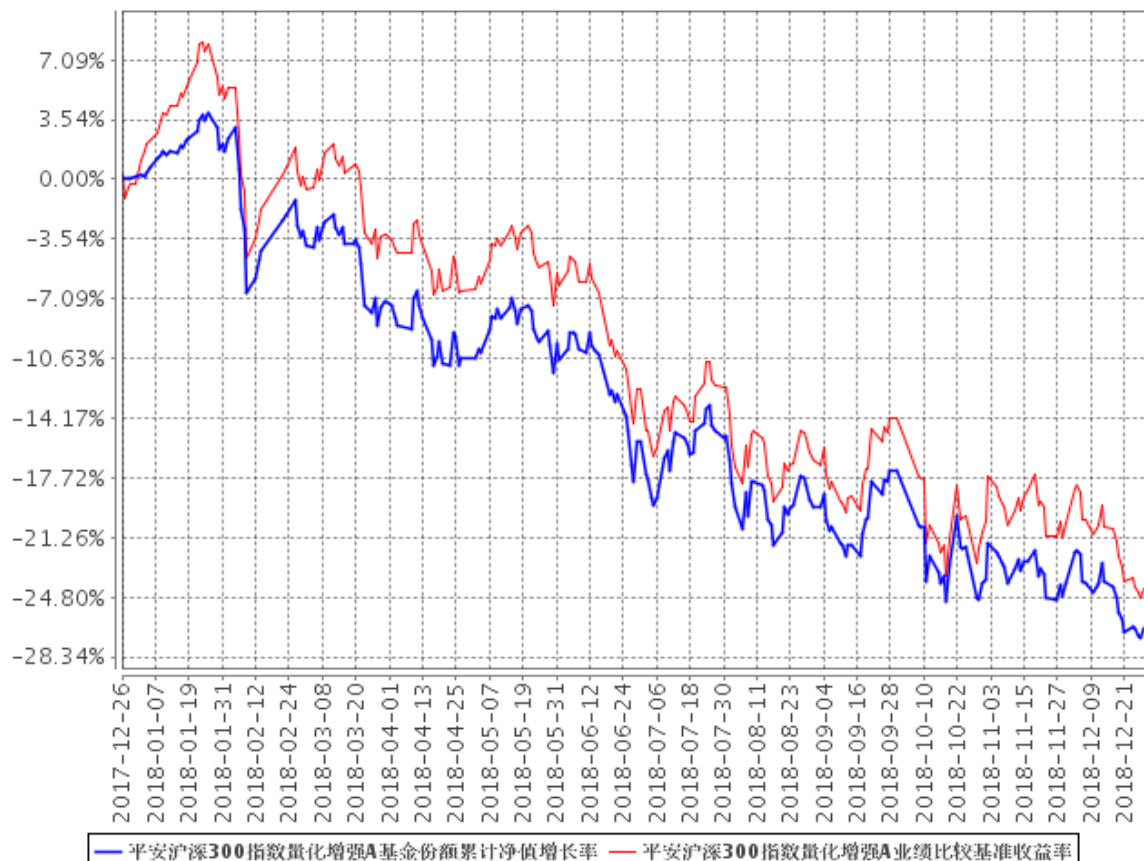
阶段	份额净值增 长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-11.69%	1.46%	-11.83%	1.56%	0.14%	-0.10%
过去六个月	-13.65%	1.35%	-13.52%	1.42%	-0.13%	-0.07%
过去一年	-27.42%	1.21%	-24.12%	1.27%	-3.30%	-0.06%
自基金合同 生效起至今	-27.32%	1.20%	-24.31%	1.26%	-3.01%	-0.06%

注：1、沪深 300 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）*5%。其中，沪深 300 指数的成分股样本选自沪、深两个证券市场，覆盖了沪深市场 60%左右的市值，是中国 A 股市场中代表性强、流动性高、可投资性大的股票组合，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

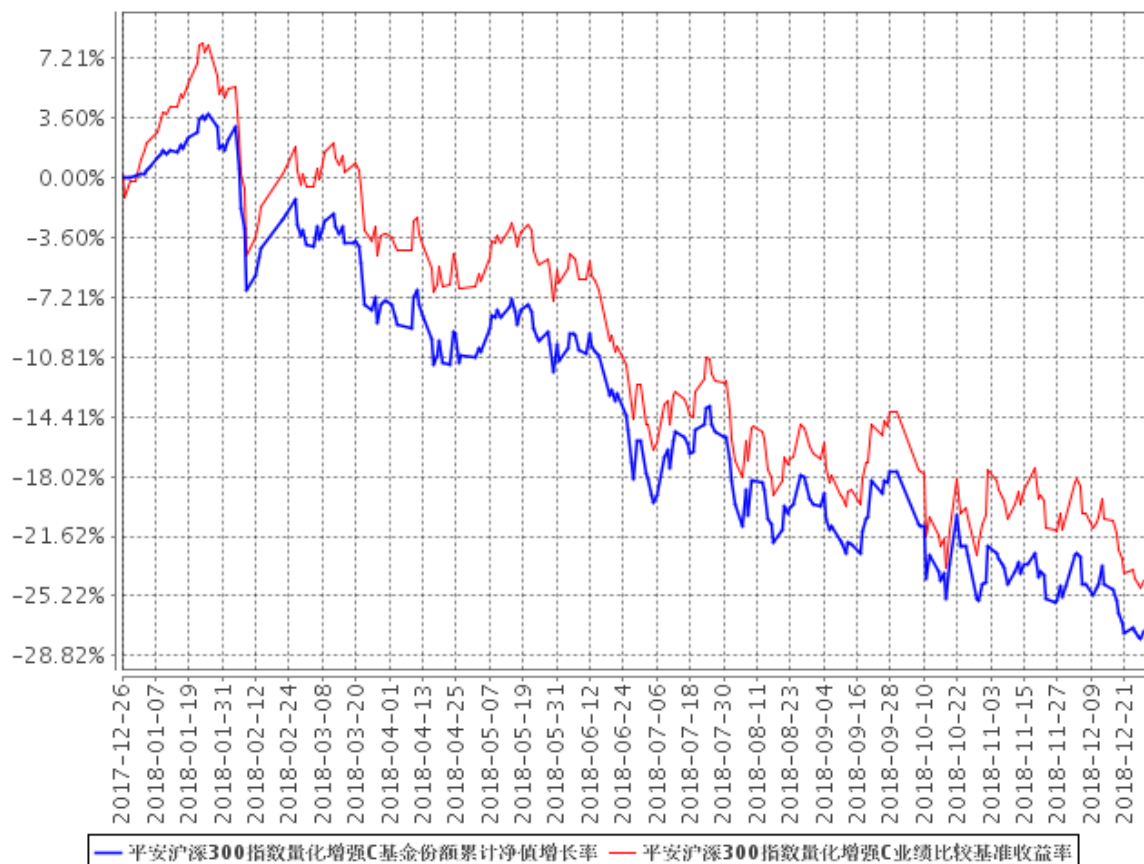
2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法

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

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



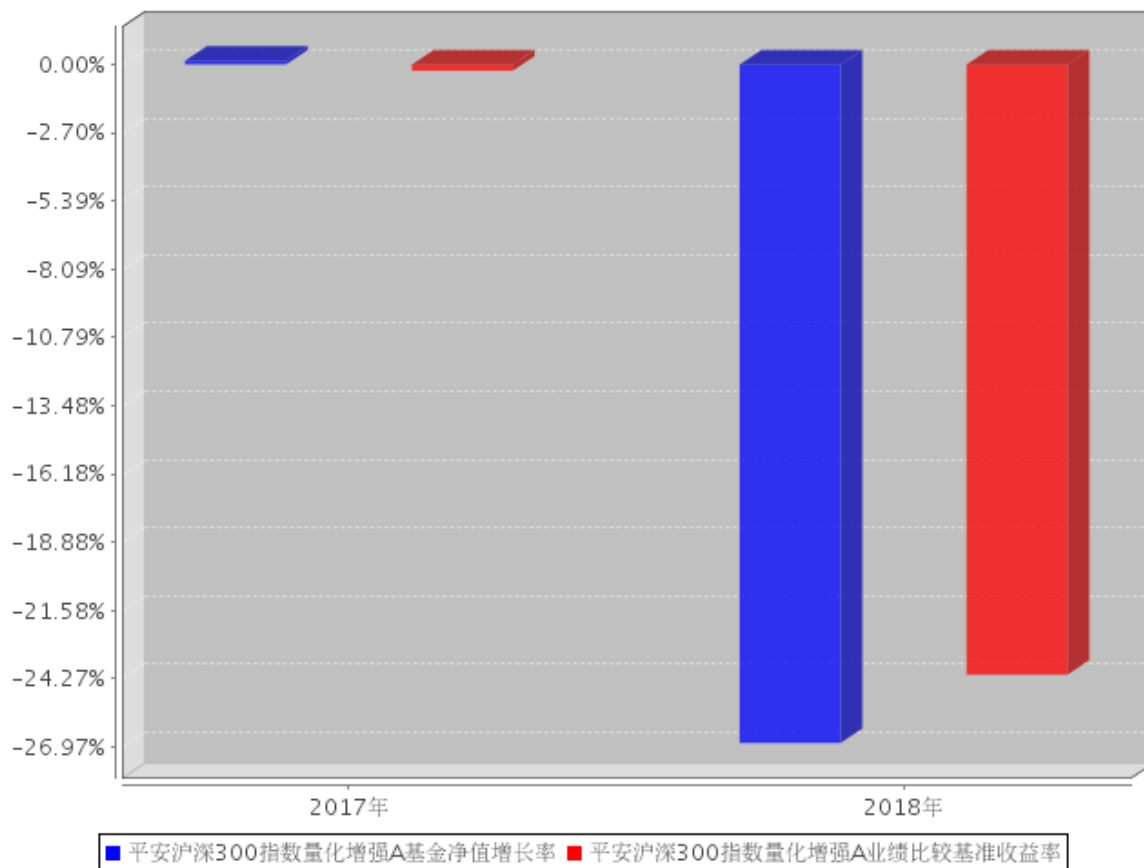
平安沪深300指数量化增强C基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



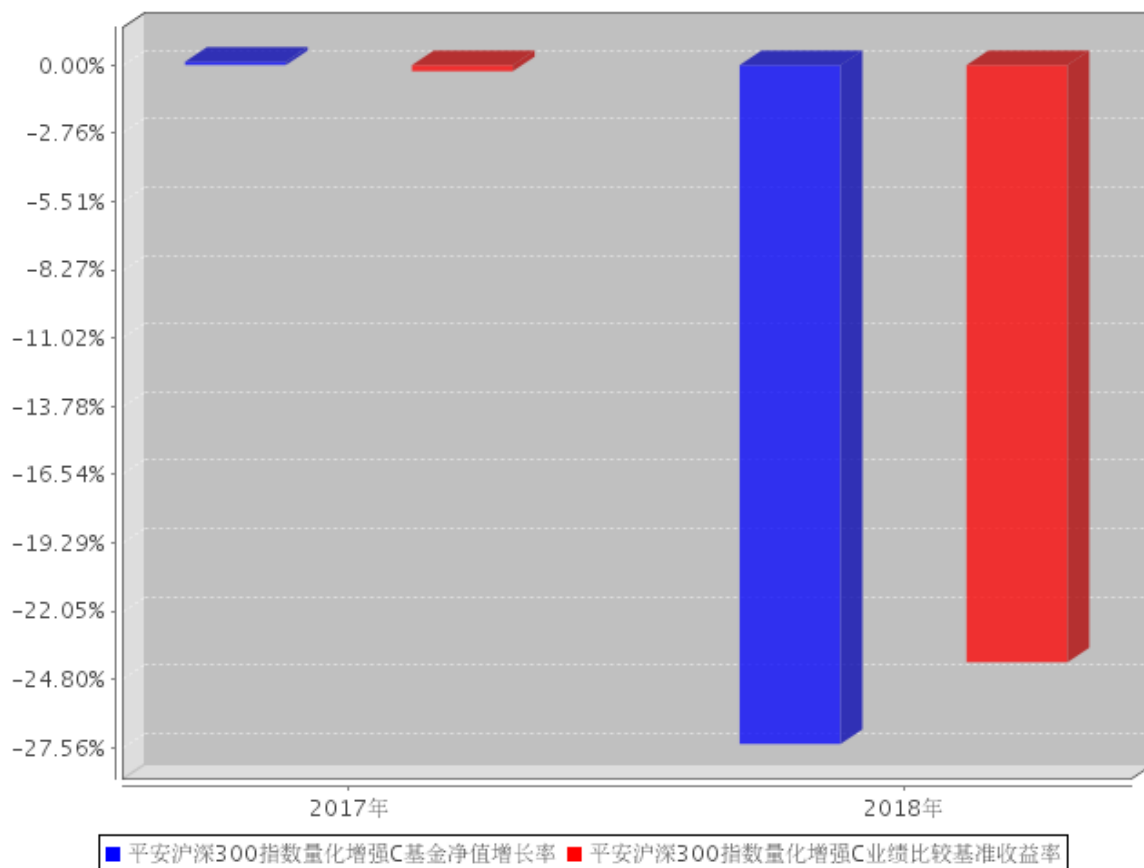
- 1、本基金基金合同于 2017 年 12 月 26 日正式生效，截至报告期末已满一年；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

平安沪深300指数量化增强A自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



平安沪深300指数量化增强C自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2017 年 12 月 26 日正式生效，截止报告期末已满一年。
2. 2017 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于 2017 年 12 月 26 日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股权 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2018 年 12 月 31 日，平安基金共管理 66 只公募基金，资产管理总规模 2879 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		
DANIEL DONGNING SUN	衍生品投资中心投资执行总经理、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金经理	2017 年 12 月 26 日	-	14	DANIEL DONGNING SUN 先生，美国籍，北京大学硕士，美国哥伦比亚大学博士，约翰霍普金斯大学博士后。先后担任瑞士再保险自营交易部量化分析师、花旗集团投资银行高级副总裁、瑞士银行投资银行交易量化总监、德意志银行战略科技部量化服务负责人。2014 年 10 月加入平安基金管理有限公司，任衍

					<p>生品投资中心投资执行总经理。现任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金</p> <p>基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易管理制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证

各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

4.3.2 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。

4.3.3 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

回顾 2018 年，市场是动荡的一年，随着中美贸易关系的不确定性及企业盈利增速的下行，A 股市场 2018 年经历了大幅下跌，估值和风险偏好均出现回落。2018 年下半年，国内政策方面出现了不少积极的变化，政策底已经在四季度基本见到，市场的估值底和业绩底也在逐渐接近。本基金全年的操作主要以沪深 300 量化增强为策略框架，利用多因子精选低估值业绩稳定的个股作为

主要配置策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末平安沪深 300 指数量化 A 基金份额净值为 0.7329 元,本报告期基金份额净值增长率为-26.82%;截至本报告期末平安沪深 300 指数量化 C 基金份额净值为 0.7268 元,本报告期基金份额净值增长率为-27.42%;同期业绩比较基准收益率为-24.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年,市场估值已经接近历史最低水平,A 股里优质的上市公司的业绩也将通过自生努力逐渐修复,在全球通胀下行、加息压力减弱的背景下,2019 可能率先迎来估值修复,A 股将进入转机的一年,有价值的投资机会将值得挖掘。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发,严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则,在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时,确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序,通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法,对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核,发现问题及时提出改进建议,并督促相关部门进行整改,同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训,开展了多次培训活动,加强对员工行为的管理,增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内,本基金管理人所管理的基金运作合法合规,基金合同得到严格履行,有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心,提高监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组,由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订,负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性,保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从

业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.9 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

本基金本报告期内出现连续 20 个工作日基金资产净值低于 5000 万元的情形。截止本报告期内末，以上情形未消除。

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量不满 200 人的情况。

§ 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，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

该基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 23327 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了平安沪深 300 指数量化增强基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度和 2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于平安沪深 300 指数量化增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	平安沪深 300 指数量化增强基金的基金管理人平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安沪深 300 指数量化增强基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适

	<p>用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安沪深 300 指数量化增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安沪深 300 指数量化增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对平安沪深 300 指数量化增强基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安沪深 300 指数量化增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价</p>

	财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	曹翠丽	陈怡
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2019 年 3 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	3,004,287.15	774,115.95
结算备付金		93,724.81	-
存出保证金		68,961.39	-
交易性金融资产	7.4.7.2	22,808,166.97	-
其中：股票投资		21,576,643.57	-
基金投资		-	-
债券投资		1,231,523.40	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	200,000,000.00
应收证券清算款		9,198.84	10,018,630.14
应收利息	7.4.7.5	49,423.79	323,938.88
应收股利		-	-
应收申购款		18,039.88	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		26,051,802.83	211,116,684.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日

负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		322,466.74	-
应付赎回款		12,593.16	-
应付管理人报酬		21,907.22	28,886.83
应付托管费		2,190.73	2,888.69
应付销售服务费		3,186.28	5,795.98
应付交易费用	7.4.7.7	77,339.01	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	242,047.46	462.19
负债合计		681,730.60	38,033.69
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	34,701,169.87	210,770,188.55
未分配利润	7.4.7.10	-9,331,097.64	308,462.73
所有者权益合计		25,370,072.23	211,078,651.28
负债和所有者权益总计		26,051,802.83	211,116,684.97

注：

1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 34,701,169.87 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.7329 元，A 类基金份额 24,526,289.23 份；下属 C 类基金份额净值 0.7268 元，C 类基金份额 10,174,880.64 份。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年度和 2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间。

7.2 利润表

会计主体：平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 26 日(基 金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-19,560,373.51	346,896.42
1.利息收入		615,990.13	346,896.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	70,417.68	25,338.76
债券利息收入		104,379.66	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		441,192.79	321,557.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-18,908,372.03	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-20,234,433.48	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-25,434.95	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	1,351,496.40	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-1,406,578.03	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	138,586.42	-

减：二、费用		2,645,500.78	38,433.69
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	889,629.45	28,886.83
2. 托管费	7.4.10.2.2	88,963.00	2,888.69
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	91,773.18	5,795.98
4. 交易费用	7.4.7.19	1,183,135.15	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	392,000.00	862.19
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-22,205,874.29	308,462.73
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-22,205,874.29	308,462.73

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	210,770,188.55	308,462.73	211,078,651.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-22,205,874.29	-22,205,874.29
三、本期基金份额交易产	-176,069,018.68	12,566,313.92	-163,502,704.76

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	18,655,180.81	-2,217,496.40	16,437,684.41
2. 基金赎回款	-194,724,199.49	14,783,810.32	-179,940,389.17
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	34,701,169.87	-9,331,097.64	25,370,072.23
项目	上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	210,770,188.55	-	210,770,188.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	308,462.73	308,462.73
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
其中: 1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以	-	-	-

“-”号填列)			
五、期末所有者权益(基金净值)	210,770,188.55	308,462.73	211,078,651.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>胡明</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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金(原名为平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金,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]1226 号《关于准予平安大华沪深 300 指数量化增强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 指数量化增强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 210,731,200.33 元,业经普华永道会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 1087 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 指数量化增强证券投资基金基金合同》于 2017 年 12 月 26 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 210,770,188.55 份基金份额,其中认购资金利息折合 38,988.22 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,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

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 指数量化增强证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、中小板以及其他经中国证监会允许基金投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中小企业私募债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券(含可分离交易可转换债)、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、权证、股指期货、国债期货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)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%,投资于沪深 300 指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后,保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 95%+同期银行活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 年度和 2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的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 2018 年 12 月 31 日和 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度和 2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2018 年度和 2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1)基金收益分配采用现金方式或红利再投资方式，基金份额持有人可自行选择收益分配方式，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；基金份额持有人事先未做出选择的，默认的分红方式为现金红利；选择红利再投资的，分红资金将按除息日基金份额净值转成相应类别的基金份额；(2)本基金各类基金份额在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；(3)基金当期收益先弥补前期亏损后，方可进行当期收益分配；(4)基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；(5)投资者的现金红利和红利再投资形成的基金份额均按照四舍五入方法，保留小数点后两位，由此误差产生的损失由基金财产承担，产生的收益归基金财产所有；(6)法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1)该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2)本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、

经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税

[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
活期存款	3,004,287.15	774,115.95
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	3,004,287.15	774,115.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2018 年 12 月 31 日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	22,974,270.05	21,576,643.57	-1,397,626.48	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	1,240,474.95	1,231,523.40	-8,951.55
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,240,474.95	1,231,523.40	-8,951.55
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	24,214,745.00	22,808,166.97	-1,406,578.03	
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日			

		成本	公允价值	公允价值变动
股票		-	-	-
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		-	-	-

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	200,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	200,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	496.64	25,338.76
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	42.10	-
应收债券利息	48,853.95	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	298,600.12
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	31.10	-
合计	49,423.79	323,938.88

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	77,339.01	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	77,339.01	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	47.46	-
预提费用	242,000.00	462.19
合计	242,047.46	462.19

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安沪深 300 指数量化增强 A		
项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	126,189,116.16	126,189,116.16
本期申购	15,725,208.44	15,725,208.44
本期赎回（以“-”号填列）	-117,388,035.37	-117,388,035.37
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	24,526,289.23	24,526,289.23

金额单位：人民币元

平安沪深 300 指数量化增强 C		
项目	本期	
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	84,581,072.39	84,581,072.39

本期申购	2,929,972.37	2,929,972.37
本期赎回（以“-”号填列）	-77,336,164.12	-77,336,164.12
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,174,880.64	10,174,880.64

注：

1. 本基金自 2017 年 11 月 20 日至 2017 年 12 月 20 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 210,731,200.33 元，折合为 210,731,200.33 份基金份额（其中 A 类基金份额 126,164,828.59 份，C 类基金份额 84,566,371.74 份）。根据《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 38,988.22 元在本基金成立后，折合为 38,988.22 份基金份额（其中 A 类基金份额 24,287.57 份，C 类基金份额 14,700.65 份），划入基金份额持有人账户。
2. 根据《平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金招募说明书》及《关于平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告》的相关规定，本基金于 2017 年 12 月 26 日（基金合同生效日）至 2018 年 1 月 21 日止期间暂不向投资人开放，相关业务自 2018 年 1 月 22 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安沪深 300 指数量化增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	188,150.64	-	188,150.64
本期利润	-17,203,388.96	-2,731,499.64	-19,934,888.60
本期基金份额交易产生的变动数	10,596,272.31	2,599,367.87	13,195,640.18
其中：基金申购款	-1,119,890.58	-576,036.22	-1,695,926.80
基金赎回款	11,716,162.89	3,175,404.09	14,891,566.98
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-6,418,966.01	-132,131.77	-6,551,097.78
-----	---------------	-------------	---------------

单位：人民币元

平安沪深 300 指数量化增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	120,312.09	-	120,312.09
本期利润	-3,595,907.30	1,324,921.61	-2,270,985.69
本期基金份额交易产生的变动数	752,338.69	-1,381,664.95	-629,326.26
其中：基金申购款	-441,357.56	-80,212.04	-521,569.60
基金赎回款	1,193,696.25	-1,301,452.91	-107,756.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,723,256.52	-56,743.34	-2,779,999.86

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	47,983.66	25,338.76
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	18,396.07	-
其他	4,037.95	-
合计	70,417.68	25,338.76

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 26 日 (基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	441,662,271.44	-
减: 卖出股票成本总额	461,896,704.92	-
买卖股票差价收入	-20,234,433.48	-

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	-25,434.95	-
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	-25,434.95	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	4,265,804.49	-
减: 卖出债券(、债转股及债券到	4,154,236.55	-

期兑付) 成本总额		
减: 应收利息总额	137,002.89	-
买卖债券差价收入	-25,434.95	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	1,351,496.40	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,351,496.40	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-1,406,578.03	-
——股票投资	-1,397,626.48	-
——债券投资	-8,951.55	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-1,406,578.03	-

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 26 日(基金合同生 效日)至 2017 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	138,360.19	-
基金转换费收入	226.23	-
合计	138,586.42	-

注：

1. 本基金 A 类和 C 类基金份额的赎回费率按持有期间递减，对于持续持有期少于 7 日的投资者收取不少于 1.5% 的赎回费并全额计入基金财产；对持续持有期大于 7 日(含)的投资者，赎回费总额的 25% 计入基金财产。
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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 12 月 26 日(基金合同生 效日)至 2017 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,183,135.15	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	1,183,135.15	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018	上年度可比期间 2017 年 12 月 26 日(基金合同
----	----------------------------	----------------------------------

	年 12 月 31 日	生效日)至 2017 年 12 月 31 日
审计费用	52,000.00	-
信息披露费	140,000.00	-
指数使用费	200,000.00	462.19
其他	-	400.00
合计	392,000.00	862.19

7.4.7.21 分部报告

截至本期末，本基金仅在中国大陆境内从事证券投资单一业务，因此，无需作披露的分部报告。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2019 年 1 月 21 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案。

7.4.9 关联方关系

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
平安银行	基金托管人、基金销售机构
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构

中国平安保险(集团)股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
中国平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效日)至 2017年12月31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	6,607,200.00	0.71%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年12月26日(基金合同生效日)至 2017年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
平安证券	300,000.00	0.02%	-	-

7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内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。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2018年1月1日至2018年12月31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	4,699.36	0.71%	4,699.36	6.08%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年12月31日	2017年12月26日(基金合同生效日)至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	889,629.45	28,886.83
其中：支付销售机构的客户维护费	73,684.48	1,825.24

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 1.00%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 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	88,963.00	2,888.69

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

日托管费=前一日基金资产净值 × 0.10%/ 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安沪深 300 指数 量化增强 A	平安沪深 300 指数 量化增强 C	合计
平安银行	-	2,119.42	2,119.42
平安证券	-	1,750.46	1,750.46
平安基金	-	30,770.14	30,770.14
合计	-	34,640.02	34,640.02
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日)至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安沪深 300 指数 量化增强 A	平安沪深 300 指数 量化增强 C	合计
平安银行	-	5.31	5.31

平安证券	-	4.84	4.84
平安基金	-	1,440.15	1,440.15
合计	-	1,450.30	1,450.30

支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

前一日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.5% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 12 月 26 日(基金合同生效日) 至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行—活期存款	3,004,287.15	47,983.66	774,115.95	25,338.76

注：本基金的银行存款由基金托管行平安银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金于本期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 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
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	13,200	258,865.16	211,332.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行平安银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	1,231,523.40	-
合计	1,231,523.40	-

注：以上按长期信用评级的债券未评级的债券投资为政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

以上按长期信用评级的债券未评级的债券投资为政策性金融债。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股不得超过该上

上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有流动性受限的资产估值占基金资产净值的比例为 0.83%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2018 年 12 月 31 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 25,628,360.84 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金，存出保证金及应收申购款、债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	3,004,287.15	-	-	-	-	-	3,004,287.15
结算备付金	93,724.81	-	-	-	-	-	93,724.81
存出保证金	68,961.39	-	-	-	-	-	68,961.39
交易性金融资产	482,241.00	-749,282.40	-	-	-21,576,643.57	22,808,166.97	
应收证券清算款	-	-	-	-	-	9,198.84	9,198.84
应收利息	-	-	-	-	-	49,423.79	49,423.79
应收申购款	-	-	-	-	-	18,039.88	18,039.88
资产总计	3,649,214.35	-749,282.40	-	-	-21,653,306.08	26,051,802.83	
负债							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	322,466.74	322,466.74
应付赎回款	-	-	-	-	-	12,593.16	12,593.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	21,907.22	21,907.22
应付托管费	-	-	-	-	-	2,190.73	2,190.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,186.28	3,186.28
应付交易费用	-	-	-	-	-	77,339.01	77,339.01
其他负债	-	-	-	-	-	242,047.46	242,047.46
负债总计	-	-	-	-	-	681,730.60	681,730.60
利率敏感度缺口	3,649,214.35	-749,282.40	-	-	-20,971,575.48	25,370,072.23	
上年度末 2017 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	774,115.95	-	-	-	-	-	774,115.95
买入返售金融资产	200,000,000.00	-	-	-	-	-	-200,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-10,018,630.14	10,018,630.14
应收利息	-	-	-	-	-	323,938.88	323,938.88
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	200,774,115.95	-	-	-	-	-10,342,569.02	211,116,684.97

负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	28,886.83	28,886.83
应付托管费	-	-	-	-	-	2,888.69	2,888.69
应付销售服务费	-	-	-	-	-	5,795.98	5,795.98
其他负债	-	-	-	-	-	462.19	462.19
负债总计	-	-	-	-	-	38,033.69	38,033.69
利率敏感度缺口	200,774,115.95	-	-	-	-	-10,304,535.33	211,078,651.28

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有交易性债券仅占基金资产净值的 4.85%(2017 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用全样本复制的方式进行指数化投资，并结合相对增强投资策略，以达到或超越具有良好市场代表性、流动性与投资性的沪深 300 指数的收益率水平，为投资者提供一个有效分享中国经济持续增长过程中带来的系统性投资机会。

本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，投资于沪深 300 指数成分股及其备选成分股的资产不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	21,576,643.57	85.05	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	21,576,643.57	85.05	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	1,167,346.87	-
	业绩比较基准减少 5%	-1,167,346.87	-

本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 21,365,311.57 元，属于第二层次的余额为 1,442,855.40 元，无属于第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：本基金未持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 其他

除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	21,576,643.57	82.82
	其中：股票	21,576,643.57	82.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,231,523.40	4.73
	其中：债券	1,231,523.40	4.73
	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	3,098,011.96	11.89
8	其他各项资产	145,623.90	0.56
9	合计	26,051,802.83	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	849,022.00	3.35
C	制造业	7,133,610.10	28.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	607,239.00	2.39

E	建筑业	547,506.00	2.16
F	批发和零售业	30,228.67	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	768,201.00	3.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	901,325.00	3.55
J	金融业	5,711,159.80	22.51
K	房地产业	1,560,295.00	6.15
L	租赁和商务服务业	331,100.00	1.31
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	18,439,686.57	72.68

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	141,372.00	0.56
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,563,173.00	10.10
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	86,460.00	0.34

G	交通运输、仓储和邮政业	121,752.00	0.48
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	108,514.00	0.43
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	57,596.00	0.23
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	28,482.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	29,608.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	3,136,957.00	12.36

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

8.3 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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	601166	兴业银行	73,700	1,101,078.00	4.34
2	601288	农业银行	188,600	678,960.00	2.68
3	600519	贵州茅台	1,000	590,010.00	2.33
4	600887	伊利股份	25,403	581,220.64	2.29

5	600000	浦发银行	52,500	514,500.00	2.03
6	601766	中国中车	53,100	478,962.00	1.89
7	601328	交通银行	80,500	466,095.00	1.84
8	000333	美的集团	12,516	461,339.76	1.82
9	000002	万科 A	18,500	440,670.00	1.74
10	601818	光大银行	113,800	421,060.00	1.66
11	600036	招商银行	16,000	403,200.00	1.59
12	601398	工商银行	73,800	390,402.00	1.54
13	600048	保利地产	33,100	390,249.00	1.54
14	601668	中国建筑	63,360	361,152.00	1.42
15	000651	格力电器	10,100	360,469.00	1.42
16	601888	中国国旅	5,500	331,100.00	1.31
17	600016	民生银行	51,840	297,043.20	1.17
18	601601	中国太保	10,300	292,829.00	1.15
19	600011	华能国际	37,800	278,964.00	1.10
20	001979	招商蛇口	15,800	274,130.00	1.08
21	601211	国泰君安	17,300	265,036.00	1.05
22	300059	东方财富	21,420	259,182.00	1.02
23	600276	恒瑞医药	4,886	257,736.50	1.02
24	000568	泸州老窖	6,100	248,026.00	0.98
25	002415	海康威视	9,200	236,992.00	0.93
26	601229	上海银行	21,140	236,556.60	0.93
27	600029	南方航空	33,400	221,776.00	0.87
28	600406	国电南瑞	11,700	216,801.00	0.86
29	600585	海螺水泥	7,400	216,672.00	0.85
30	601225	陕西煤业	28,700	213,528.00	0.84
31	600030	中信证券	13,200	211,332.00	0.83
32	601006	大秦铁路	25,100	206,573.00	0.81

33	000063	中兴通讯	10,400	203,736.00	0.80
34	600028	中国石化	38,600	194,930.00	0.77
35	600050	中国联通	35,800	185,086.00	0.73
36	603288	海天味业	2,600	178,880.00	0.71
37	600690	青岛海尔	12,700	175,895.00	0.69
38	601939	建设银行	27,400	174,538.00	0.69
39	600570	恒生电子	3,200	166,336.00	0.66
40	601336	新华保险	3,900	164,736.00	0.65
41	002304	洋河股份	1,700	161,024.00	0.64
42	601111	中国国航	19,200	146,688.00	0.58
43	600009	上海机场	2,800	142,128.00	0.56
44	600027	华电国际	29,000	137,750.00	0.54
45	601155	新城控股	5,800	137,402.00	0.54
46	600900	长江电力	8,500	134,980.00	0.53
47	600498	烽火通信	4,700	133,809.00	0.53
48	601857	中国石油	18,000	129,780.00	0.51
49	002311	海大集团	5,300	122,801.00	0.48
50	000895	双汇发展	5,100	120,309.00	0.47
51	601088	中国神华	6,600	118,536.00	0.47
52	600104	上汽集团	4,300	114,681.00	0.45
53	600522	中天科技	13,900	113,285.00	0.45
54	601899	紫金矿业	32,200	107,548.00	0.42
55	600867	通化东宝	7,600	105,640.00	0.42
56	600309	万华化学	3,700	103,563.00	0.41
57	600352	浙江龙盛	10,500	101,325.00	0.40
58	600438	通威股份	12,100	100,188.00	0.40
59	601012	隆基股份	5,600	97,664.00	0.39
60	600031	三一重工	11,600	96,744.00	0.38

61	600606	绿地控股	15,500	94,705.00	0.37
62	601628	中国人寿	4,600	93,794.00	0.37
63	300136	信维通信	4,200	90,762.00	0.36
64	601186	中国铁建	8,100	88,047.00	0.35
65	600547	山东黄金	2,800	84,700.00	0.33
66	002475	立讯精密	6,020	84,641.20	0.33
67	600660	福耀玻璃	3,600	82,008.00	0.32
68	002594	比亚迪	1,600	81,600.00	0.32
69	002271	东方雨虹	6,000	77,700.00	0.31
70	002230	科大讯飞	3,000	73,920.00	0.29
71	002466	天齐锂业	2,500	73,300.00	0.29
72	000786	北新建材	5,200	71,552.00	0.28
73	600038	中直股份	1,900	70,984.00	0.28
74	600332	白云山	1,900	67,944.00	0.27
75	300122	智飞生物	1,600	62,016.00	0.24
76	002925	盈趣科技	1,400	61,432.00	0.24
77	000338	潍柴动力	7,800	60,060.00	0.24
78	600741	华域汽车	3,200	58,880.00	0.23
79	600383	金地集团	6,000	57,720.00	0.23
80	002146	荣盛发展	7,200	57,240.00	0.23
81	600886	国投电力	6,900	55,545.00	0.22
82	002773	康弘药业	1,600	54,512.00	0.22
83	002081	金螳螂	6,700	54,270.00	0.21
84	603156	养元饮品	1,300	54,054.00	0.21
85	000157	中联重科	14,400	51,264.00	0.20
86	000858	五粮液	1,000	50,880.00	0.20
87	600271	航天信息	2,100	48,069.00	0.19
88	600372	中航电子	3,700	48,026.00	0.19

89	603160	汇顶科技	600	47,220.00	0.19
90	000876	新希望	6,400	46,592.00	0.18
91	600346	恒力股份	3,500	46,375.00	0.18
92	000671	阳光城	8,800	45,672.00	0.18
93	601390	中国中铁	6,300	44,037.00	0.17
94	600176	中国巨石	4,100	39,647.00	0.16
95	002007	华兰生物	1,100	36,080.00	0.14
96	000661	长春高新	200	35,000.00	0.14
97	600196	复星医药	1,500	34,905.00	0.14
98	600177	雅戈尔	4,800	34,512.00	0.14
99	601933	永辉超市	3,841	30,228.67	0.12
100	600688	上海石化	6,000	29,940.00	0.12
101	601877	正泰电器	1,200	29,088.00	0.12
102	600340	华夏幸福	1,100	27,995.00	0.11
103	002625	光启技术	2,800	27,720.00	0.11
104	600118	中国卫星	1,600	27,712.00	0.11
105	000703	恒逸石化	2,400	27,648.00	0.11
106	600535	天士力	1,400	26,880.00	0.11
107	600004	白云机场	2,600	26,130.00	0.10
108	603833	欧派家居	300	23,916.00	0.09
109	002294	信立泰	1,100	22,979.00	0.09
110	002008	大族激光	700	21,252.00	0.08
111	601018	宁波港	4,200	14,028.00	0.06
112	600018	上港集团	2,100	10,878.00	0.04

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002916	深南电路	3,400	272,578.00	1.07
2	600298	安琪酵母	10,200	257,346.00	1.01
3	603826	坤彩科技	18,400	256,680.00	1.01
4	603228	景旺电子	4,800	239,952.00	0.95
5	002821	凯莱英	2,400	162,840.00	0.64
6	002376	新北洋	10,600	162,604.00	0.64
7	603338	浙江鼎力	2,800	157,696.00	0.62
8	300498	温氏股份	5,400	141,372.00	0.56
9	002841	视源股份	2,300	130,870.00	0.52
10	600350	山东高速	26,700	121,752.00	0.48
11	300596	利安隆	3,000	93,000.00	0.37
12	603368	柳药股份	3,300	86,460.00	0.34
13	300454	深信服	900	80,640.00	0.32
14	300630	普利制药	1,800	79,308.00	0.31
15	300389	艾比森	4,200	65,646.00	0.26
16	002511	中顺洁柔	7,000	59,640.00	0.24
17	300001	特锐德	3,400	59,602.00	0.23
18	002242	九阳股份	3,700	59,237.00	0.23
19	002281	光迅科技	2,200	59,092.00	0.23
20	002372	伟星新材	3,800	58,938.00	0.23
21	002597	金禾实业	3,600	57,204.00	0.23
22	002019	亿帆医药	4,500	48,150.00	0.19
23	002216	三全食品	4,300	31,304.00	0.12
24	002557	洽洽食品	1,600	30,464.00	0.12

25	300413	芒果超媒	800	29,608.00	0.12
26	600528	中铁工业	2,800	29,400.00	0.12
27	002463	沪电股份	4,100	29,397.00	0.12
28	300284	苏交科	2,800	29,036.00	0.11
29	603127	昭衍新药	600	28,560.00	0.11
30	600763	通策医疗	600	28,482.00	0.11
31	000401	冀东水泥	2,300	28,474.00	0.11
32	300383	光环新网	2,200	27,874.00	0.11
33	002792	通宇通讯	900	27,558.00	0.11
34	002396	星网锐捷	1,600	27,552.00	0.11
35	600997	开滦股份	4,800	27,216.00	0.11
36	300394	天孚通信	1,100	26,587.00	0.10
37	002384	东山精密	2,200	24,838.00	0.10

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	601288	农业银行	7,118,458.00	3.37
2	600887	伊利股份	6,955,271.92	3.30
3	601166	兴业银行	6,880,167.00	3.26
4	600036	招商银行	6,827,549.00	3.23
5	600016	民生银行	6,054,430.00	2.87
6	601328	交通银行	5,368,534.00	2.54
7	601006	大秦铁路	5,355,105.00	2.54
8	600519	贵州茅台	5,292,409.00	2.51
9	601398	工商银行	5,234,322.00	2.48

10	600000	浦发银行	5,213,499.00	2.47
11	000002	万科A	5,206,788.00	2.47
12	600690	青岛海尔	4,966,453.00	2.35
13	000333	美的集团	4,861,496.40	2.30
14	600837	海通证券	4,463,221.23	2.11
15	601169	北京银行	4,354,015.48	2.06
16	600030	中信证券	4,323,012.96	2.05
17	601939	建设银行	4,233,496.00	2.01
18	601668	中国建筑	4,181,899.00	1.98
19	600048	保利地产	4,149,427.00	1.97
20	601155	新城控股	4,140,400.46	1.96

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。

8.4.2 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	600036	招商银行	6,345,572.00	3.01
2	601288	农业银行	6,218,347.81	2.95
3	600887	伊利股份	5,759,734.00	2.73
4	600016	民生银行	5,623,321.00	2.66
5	601166	兴业银行	5,537,130.00	2.62
6	601006	大秦铁路	4,801,673.00	2.27
7	601328	交通银行	4,691,446.00	2.22
8	000002	万科A	4,665,273.00	2.21
9	600000	浦发银行	4,544,791.80	2.15
10	601398	工商银行	4,528,099.00	2.15
11	600690	青岛海尔	4,428,824.25	2.10
12	601169	北京银行	4,293,446.00	2.03

13	600837	海通证券	4,113,051.31	1.95
14	601939	建设银行	3,956,711.00	1.87
15	600519	贵州茅台	3,900,456.00	1.85
16	601155	新城控股	3,887,947.15	1.84
17	600900	长江电力	3,845,517.00	1.82
18	000333	美的集团	3,786,584.65	1.79
19	600030	中信证券	3,729,723.00	1.77
20	601668	中国建筑	3,533,802.00	1.67

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。

8.4.3 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	484,870,974.97
卖出股票收入（成交）总额	441,662,271.44

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,231,523.40	4.85
	其中：政策性金融债	1,231,523.40	4.85
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	1,231,523.40	4.85
----	----	--------------	------

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	018005	国开 1701	7,460	749,282.40	2.95
2	018002	国开 1302	4,820	482,241.00	1.90

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 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

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

银保监会于 2018 年 4 月 19 日做出银保监银罚决字（2018）1 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；（二）非真实转让信贷资产；（三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；（四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；（五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；（六）债券卖出回购业务违规出表；（七）个人理财资金违规投资；（八）提供日期倒签的材料；（九）部分非现场监管统计数据与事实不符；（十）个别董事未经任职资格核准即履职；（十一）变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。根据相关规定对公司罚款 5870 万元。

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

银监会于 2018 年 2 月 12 日做出银监罚决字（2018）4 号处罚决定，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）内控管理严重违反审慎经营规则；（二）通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；（三）通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；（四）理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；（五）提供不实说明材料、不配合调查取证；（六）以贷转存，虚增存贷款；（七）票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；（八）国内信用证业务贸易背景审查不严；（九）贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；（十）违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；（十一）票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；（十二）对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；（十三）以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；（十四）投资多款同业理财产品未尽尽职审查，涉及金额较大；（十五）修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；（十六）为非保本理财产品出具保本承诺函；（十七）向关系人发放信用贷款；（十八）向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；（十九）收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。根据相关规定对公司罚款 5845 万

元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。2018 年 1 月 18 日，银监会四川监管局对公司成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效、授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。上海浦东发展银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018 年）3 号）。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为以上事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字（2018）12 号处罚决定，由于交通银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）不良信贷资产未洁净转让、理财资金投资本行不良信贷资产收益权；（二）未尽尽职调查并使用自有资金垫付承接风险资产；（三）档案管理不到位、内控管理存在严重漏洞；（四）理财资金借助保险资管渠道虚增本行存款规模；（五）违规向土地储备机构提供融资；（六）信贷资金违规承接本行表外理财资产；（七）理财资金违规投资项目资本金；（八）部分理财产品信息披露不合规；（九）现场检查配合不力。根据相关规定对公司罚款 690 万元。银保监会于 2018 年 11 月 9 日做出银保监银罚决字（2018）13 号处罚决定，由于公司：并购贷款占并购交易价款比例不合规；并购贷款尽职调查和风险评估不到位。根据相关规定对公司罚款 50 万元。交通银行股份有限公司于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务等，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字（2018 年）1 号）。

本基金管理人对该公司进行了深入的了解和分析，认为以上事项有利于公司规范开展业务，对公司的偿债能力暂不会造成重大不利影响。我们对该证券的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

报告期内，本基金投资的前十名证券的其余七名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	68,961.39
2	应收证券清算款	9,198.84
3	应收股利	-
4	应收利息	49,423.79
5	应收申购款	18,039.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	145,623.90

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限的情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	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
平 安 沪 深 300 指 数 量 化 增 强 A	1,008	24,331.64	0.00	0.00%	24,526,289.23	100.00%
平 安 沪 深 300 指 数 量 化 增 强 C	256	39,745.63	0.00	0.00%	10,174,880.64	100.00%
合计	1,255	27,650.33	0.00	0.00%	34,701,169.87	100.00%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安沪深	24,831.18	0.1012%

持有本基金	300 指数 量化增强 A		
	平安沪深 300 指数 量化增强 C	1,500.34	0.0147%
	合计	26,331.52	0.0759%

上述从业人员持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.3 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的情况

项目	份额级别	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	平安沪深 300 指数量 化增强 A	0
	平安沪深 300 指数量 化增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	平安沪深 300 指数量 化增强 A	0
	平安沪深 300 指数量 化增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安沪深 300 指 数量化增强 A	平安沪深 300 指 数量化增强 C
基金合同生效日（2017 年 12 月 26 日）基金 份额总额	126,189,116.16	84,581,072.39
本报告期期初基金份额总额	126,189,116.16	84,581,072.39
本报告期期间基金总申购份额	15,725,208.44	2,929,972.37
减:本报告期期间基金总赎回份额	117,388,035.37	77,336,164.12
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	0.00	0.00
本报告期期末基金份额总额	24,526,289.23	10,174,880.64

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

初次聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，报告期内应支付给该事务所的报酬为 52,000 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	

国信证券	2	415,163,301.98	44.83%	295,304.74	44.79%	-
天风证券	2	106,226,480.61	11.47%	75,559.38	11.46%	-
中信证券	3	90,068,684.08	9.73%	64,065.23	9.72%	新增
民生证券	1	55,806,089.85	6.03%	39,695.16	6.02%	-
安信证券	3	48,808,381.65	5.27%	34,717.40	5.27%	新增 1 个
光大证券	2	41,909,665.98	4.53%	29,809.97	4.52%	-
东兴证券	2	31,577,507.71	3.41%	22,461.11	3.41%	-
银河证券	2	28,425,175.50	3.07%	20,219.13	3.07%	-
东北证券	7	22,198,634.79	2.40%	15,789.73	2.39%	新增 2 个
中泰证券	1	15,376,176.24	1.66%	10,937.01	1.66%	-
方正证券	2	14,251,604.07	1.54%	10,137.00	1.54%	-
广州证券	2	11,297,253.65	1.22%	8,036.09	1.22%	-
华泰证券	2	10,168,015.18	1.10%	7,232.34	1.10%	-
海通证券	2	6,913,966.60	0.75%	4,917.91	0.75%	-
万联证券	2	6,698,359.00	0.72%	4,764.62	0.72%	-
平安证券	4	6,607,200.00	0.71%	4,699.36	0.71%	-
西南证券	1	4,045,379.96	0.44%	2,877.44	0.44%	-
兴业证券	1	3,897,068.59	0.42%	2,772.05	0.42%	-
广发证券	2	2,886,984.50	0.31%	2,630.95	0.40%	-
华创证券	2	2,481,375.68	0.27%	1,765.01	0.27%	-
渤海证券	1	1,284,186.20	0.14%	913.44	0.14%	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	新增
华福证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	4	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-

太平洋证券	2	-	-	-	-	新增
东方证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	新增
长江证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
联讯证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
财富证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-

1、基金交易单元的选择标准如下：

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

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

11.7.2 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
国信证券	-	-	1,471,000,000.00	83.95%	-	-
天风证券	5,313,885.80	55.80%	18,100,000.00	1.03%	-	-
中信证券	698,456.50	7.33%	25,600,000.00	1.46%	-	-

民生证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	7,400,000.00	0.42%	-	-
光大证券	698,455.10	7.33%	22,500,000.00	1.28%	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	1,497,750.90	15.73%	6,400,000.00	0.37%	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	200,000,000.00	11.41%	-	-
广州证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	1,015,206.60	10.66%	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	300,000.00	0.02%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	299,758.20	3.15%	1,000,000.00	0.06%	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-

长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
联讯证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
财富证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-

11.8 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	关于平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 1 月 20 日
2	关于旗下部分基金新增华瑞保险销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 2 月 6 日
3	关于旗下部分基金新增海银基金为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 4 月 16 日
4	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 4 月 19 日
5	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2018 年 1 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 4 月 20 日
6	关于旗下部分基金新增上海	公司网站、证券时	2018 年 5 月 18 日

	大智慧基金销售有限公司为销售机构公告	报、上海证券报	
7	关于旗下部分基金新增万和证券股份有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 5 月 29 日
8	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 6 月 12 日
9	关于旗下部分基金新增济安财富(北京)基金销售有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 6 月 13 日
10	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 6 月 20 日
11	关于旗下基金所持中兴通讯(股票代码: 000063) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 6 月 21 日
12	关于旗下基金所持东方园林(代码 002310)、上海电气(代码 601727) 估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 6 月 26 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中国平安人寿保险股份有限公司申购费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 7 月 16 日
14	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2018 年第 2 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 7 月 18 日
15	关于旗下部分基金新增中证金牛(北京)投资咨询有限公	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 7 月 20 日

	司为销售机构的公告		
16	关于旗下部分基金新增华安证券、世纪证券为销售机构及开通定投、转换业务并参与其费率优惠活动的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 7 月 30 日
17	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金招募说明书更新（2018 年第 1 期）以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 8 月 8 日
18	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2018 年半年度报告以及摘要	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 8 月 24 日
19	关于旗下部分基金新增民商基金销售（上海）有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 9 月 5 日
20	关于旗下部分基金新增中民财富基金销售（上海）有限公司为销售机构公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 9 月 26 日
21	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国平安人寿保险股份有限公司开通基金定投业务的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 10 月 16 日
22	关于旗下基金所持美的集团（股票代码：000333）估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 10 月 16 日
23	平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 10 月 25 日
24	关于旗下部分基金新增弘业	公司网站、证券时报	2018 年 10 月 31 日

	期货股份有限公司为销售机构的公告	报、上海证券报	
25	关于旗下基金所持康得新(股票代码 002450)估值调整的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 10 月 31 日
26	关于平安大华基金管理有限责任公司注册资本、股权及法定名称变更事宜的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 11 月 2 日
27	关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 11 月 28 日
28	关于子公司深圳平安汇通财富管理有限公司增加注册资本的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 11 月 29 日
29	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增上海天天基金销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 12 月 21 日
30	关于旗下部分基金新增北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 12 月 24 日
31	关于旗下部分基金新增蚂蚁(杭州)基金销售有限公司为销售机构的公告	公司网站、证券时报、上海证券报	2018 年 12 月 25 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20180101-20181028	50,007,333.33	0.00	50,007,333.33	0.00	0.00%
	2	20180131-20180515	30,002,750.00	0.00	30,002,750.00	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本报告期内，本基金出现单一份额持有人持有基金份额占比超过 20%的情况。当该基金份额持有人选择大比例赎回时，可能引发巨额赎回。若发生巨额赎回而本基金没有足够现金时，存在一定的流动性风险；为应对巨额赎回而进行投资标的变现时，可能存在仓位调整困难，甚至对基金份额净值造成不利影响。基金经理会对可能出现的巨额赎回情况进行充分准备并做好流动性管理，但当基金出现巨额赎回并被全部确认时，申请赎回的基金份额持有人有可能面临赎回款项被延缓支付的风险，未赎回的基金份额持有人有可能承担短期内基金资产变现冲击成本对基金份额净值产生的不利影响。</p> <p>在极端情况下，当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金资产规模连续六十个工作日低于 5000 万元，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

上述持有份额占比的计算中，分母采用本基金下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、自 2018 年 10 月 25 日起，本基金管理人法定名称由“平安大华基金管理有限公司”变更为“平安基金管理有限公司”。沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金，本基金名称由“平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金”变更为“平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金”。

2、经本基金管理人 2017 年第六次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会《关于核准平安大华基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可【2018】1595 号），公司新增注册资本 10 亿元人民币。本次增资完成后，本公司注册资本由 3 亿元人民币增加至 13 亿元人民币。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华沪深 300 指数量化增强证券投资基金的文件；
- 2、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金基金合同；
- 3、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金托管协议；
- 4、平安沪深 300 指数量化增强证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

- 1、深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
- 2、基金托管人住所

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>

平安基金管理有限公司

2019 年 3 月 26 日