

B356信息披露disclosure

平安深证300指数增强型证券投资基金

2019年半年度报告摘要

基金管理人:平安基金管理有限公司
基金托管人:中国银行股份有限公司
送出日期: 2019年08月23日

1 重要提示

1.1 重要提示
基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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法律责任。本半年度报告已经二分之一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人中国银行股份有限公司根据基金合同规定,于2019年8月22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,也不保证基金份额持有人持有的基金份额在价值上不受损失,基金资产净值不出现波动。
基金的投资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更新。
本半年度报告披露摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期末资产净值,金额单位均为人民币元。
本报告自2019年1月1日起至6月30日止。

本基金特设特别定制计划,基金单位价值为人民币1元。		
本报告自2019年1月1日起至6月30日止。		
2.1 基金基本情况		
基金名称	平安深证300指数增强	
场内简称	-	
基金主代码	700002	
前缀代码	-	
基金代码	-	
基金合同生效日	2011年12月20日	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年12月20日	
基金管理人	平安基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,449,329.43份	
基金合同存续期	不定期	
基金合同上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
2.2 基金产品说明		
投资目标	采用指数复制结合相对增强的投资策略,即通过指数复制的方式力求跟踪深证300指数,并在此基础上利用跟踪误差和跟踪误差的进一步进行相对增强的投资管理,力争使基金资产净值增长率超过深证300指数的同期业绩比较基准的收益率(净值增长率超过深证300指数同期业绩比较基准的收益率不超过7.5%)。	
投资策略	本基金主要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式力求跟踪深证300指数,并在此基础上利用跟踪误差和跟踪误差的进一步进行相对增强的投资管理,以获取超越基金净值增长率超过深证300指数的同期业绩比较基准的收益率(净值增长率超过深证300指数同期业绩比较基准的收益率不超过7.5%)。	
业绩比较基准	深证300指数收益率×95%+商业银行活期存款利率(税后)×5%	
风险收益特征	本基金属于股票型基金,其预期收益及风险水平高于货币型基金,属于证券投资基金中的较高风险品种。同时,本基金主要采用指数复制结合相对增强的投资策略,具有与标的指数相似的风险收益特征。	
2.3 基金管理人、基金托管人		
项目	基金管理人	基金托管人
名称	平安基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
姓名	陈特正	王长林
联系电话	0755-29882828	010-65944886
电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	65944886@china.com.cn
客户服务热线	400-800-4800	95566
传真	0755-29887778	010-65949442
2.4 信息披露方式		
信息披露及报告资料的互联网交互网址	http://www.pinganfund.com	
基金半年度报告披露地点	基金管理人、基金托管人住所	
3.1 主要会计数据和财务指标表现		
项目	金额单位:人民币元	
3.1.1 本期数据和指标		
本期已实现收益	6,711,729.99	
加权平均基金份额本期利润	17,602,562.34	
本期基金份额净值增长率	30.61%	
3.1.2 本期数据和指标		
期末可供分配基金份额利润	0.5188	
期末基金份额净值	74.214,616.61	
期末基金份额净值	1.52	
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未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。 3、本报告所列示的基金业绩指标不包括持有及交易基金的各项费用,例如:基金的认购、申购、赎回费等等,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		

					5.1 报告期内本基金托管人遵守资信情况声明
					本报告期,中国银行股份有限公司(以下称“本托管人”)在平安深圳300指数增强型证券投资基金(以下称“本基金”)的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及相关法律法规、基金合同和托管协议的相关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。
					5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵守净价、净值计算,利润分配等规定的情况
					明
					本报告期,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及有基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。
					5.3 托管人对本半年度报告中基金净值等信息的复核、准确与完整发表意见
					本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及有基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。
					5.4 托管人对本半年度报告中的“基金管理人承诺”、“基金管理人

项目	附注3	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期2018年12月31日至2019年6月30日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	5,094,234.02	5,674,882.26
结算备付金	-	246,328.00	-
交易保证金	-	9,323.00	7,706.99
买入返售金融资产	6.4.7.2	68,989,304.06	50,216,327.20
其他资产	-	68,989,304.06	50,216,327.20
基金负债:			
应付证券款	-	-	-
应付赎回款	6.4.7.3	-	-
应付利息	6.4.7.4	-	-
应付债券	6.4.7.5	-	-
其他负债	6.4.7.6	-	-
资产总计	6.4.7.7	74,796,426.32	56,901,214.81
负债和所有者权益	6.4.7.8	74,796,426.32	56,901,214.81
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	48,449,329.43	47,386,954.02
未分配利润	6.4.7.10	26,347,096.89	9,514,260.79
所有者权益合计	6.4.7.11	74,796,426.32	56,901,214.81
负债和所有者权益合计	6.4.7.12	74,796,426.32	56,901,214.81
注:报告截止日2019年6月30日,基金份额净值1.52元,基金份额总额48,449,329.43份。			
6.2 利润表			
项目	附注3	本期2019年1月1日至2019年6月30日	上期2018年1月1日至2019年6月30日
一、收入		19,496,360.67	-9,430,094.36
利息收入	6.4.7.11	20,897.27	21,794.72
其中:存款利息收入	6.4.7.11.1	20,897.27	21,794.72
债券利息收入	-	-	-
买入返售金融资产收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
投资收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.12	7,521,876.79	-116,382.53
其中:股票投资收益	6.4.7.12.1	6,780,444.43	-531,986.69
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.12.2	-	-
债券投资收益	6.4.7.12.3	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.12.4	-	-
其他投资收益	6.4.7.12.5	-	-
公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.13	10,880,831.38	-9,347,967.28
汇兑收益(损失以“-”号填列)	-	-	-
其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.14	32,760.63	12,500.73
减:二、费用		883,386.73	1,286,670.06
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	261,223.65	282,623.03
2. 托管费	6.4.10.2.2	50,224.65	51,638.12
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费	6.4.7.19	362,497.29	747,068.94
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	6.4.7.20	159,829.86	205,560.97
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)	-	17,602,562.34	-10,726,972.42
四、净利润(净亏损以“-”号填列)	-	17,602,562.34	-10,726,972.42
五、净利润(净亏损以“-”号填列)	-	17,602,562.34	-10,726,972.42
六、每股收益			
1. 基本每股收益	-	-	-
2. 稀释每股收益	-	-	-
七、每股收益	-	-	-
八、每股收益	-	-	-
九、每股收益	-	-	-
十、每股收益	-	-	-
十一、每股收益	-	-	-
十二、每股收益	-	-	-
十三、每股收益	-	-	-
十四、每股收益	-	-	-
十五、每股收益	-	-	-
十六、每股收益	-	-	-
十七、每股收益	-	-	-
十八、每股收益	-	-	-
十九、每股收益	-	-	-
二十、每股收益	-	-	-
二十一、每股收益	-	-	-
二十二、每股收益	-	-	-
二十三、每股收益	-	-	-
二十四、每股收益	-	-	-
二十五、每股收益	-	-	-
二十六、每股收益	-	-	-
二十七、每股收益	-	-	-
二十八、每股收益	-	-	-
二十九、每股收益	-	-	-
三十、每股收益	-	-	-
三十一、每股收益	-	-	-
三十二、每股收益	-	-	-
三十三、每股收益	-	-	-
三十四、每股收益	-	-	-
三十五、每股收益	-	-	-
三十六、每股收益	-	-	-
三十七、每股收益	-	-	-
三十八、每股收益	-	-	-
三十九、每股收益	-	-	-
四十、每股收益	-	-	-
四十一、每股收益	-	-	-
四十二、每股收益	-	-	-
四十三、每股收益	-	-	-
四十四、每股收益	-	-	-
四十五、每股收益	-	-	-
四十六、每股收益	-	-	-
四十七、每股收益	-	-	-
四十八、每股收益	-	-	-
四十九、每股收益	-	-	-
五十、每股收益	-	-	-
五十一、每股收益	-	-	-
五十二、每股收益	-	-	-
五十三、每股收益	-	-	-
五十四、每股收益	-	-	-
五十五、每股收益	-	-	-
五十六、每股收益	-	-	-
五十七、每股收益	-	-	-
五十八、每股收益	-	-	-
五十九、每股收益	-	-	-
六十、每股收益	-	-	-
六十一、每股收益	-	-	-
六十二、每股收益	-	-	-
六十三、每股收益	-	-	-
六十四、每股收益	-	-	-
六十五、每股收益	-	-	-
六十六、每股收益	-	-	-
六十七、每股收益	-	-	-
六十八、每股收益	-	-	-
六十九、每股收益	-	-	-
七十、每股收益	-	-	-
七十一、每股收益	-	-	-
七十二、每股收益	-	-	-
七十三、每股收益	-	-	-
七十四、每股收益	-	-	-
七十五、每股收益	-	-	-
七十六、每股收益	-	-	-
七十七、每股收益	-	-	-
七十八、每股收益	-	-	-
七十九、每股收益	-	-	-
八十、每股收益	-	-	-
八十一、每股收益	-	-	-
八十二、每股收益	-	-	-
八十三、每股收益	-	-	-
八十四、每股收益	-	-	-
八十五、每股收益	-	-	-
八十六、每股收益	-	-	-
八十七、每股收益	-	-	-
八十八、每股收益	-	-	-
八十九、每股收益	-	-	-
九十、每股收益	-	-	-
九十一、每股收益	-	-	-
九十二、每股收益	-	-	-
九十三、每股收益	-	-	-
九十四、每股收益	-	-	-
九十五、每股收益	-	-	-
九十六、每股收益	-	-	-
九十七、每股收益	-	-	-
九十八、每股收益	-	-	-
九十九、每股收益	-	-	-
一百、每股收益	-	-	-
一百零一、每股收益	-	-	-
一百零二、每股收益	-	-	-
一百零三、每股收益	-	-	-
一百零四、每股收益	-	-	-
一百零五、每股收益	-	-	-
一百零六、每股收益	-	-	-
一百零七、每股收益	-	-	-
一百零八、每股收益	-	-	-
一百零九、每股收益	-	-	-
一百一十、每股收益	-	-	-
一百一十一、每股收益	-	-	-
一百一十二、每股收益	-	-	-
一百一十三、每股收益	-	-	-
一百一十四、每股收益	-	-	-
一百一十五、每股收益	-	-	-
一百一十六、每股收益	-	-	-
一百一十七、每股收益	-	-	-
一百一十八、每股收益	-	-	-
一百一十九、每股收益	-	-	-
一百二十、每股收益	-	-	-
一百二十一、每股收益	-	-	-
一百二十二、每股收益	-	-	-
一百二十三、每股收益	-	-	-
一百二十四、每股收益	-	-	-
一百二十五、每股收益	-	-	-
一百二十六、每股收益	-	-	-
一百二十七、每股收益	-	-	-
一百二十八、每股收益	-	-	-
一百二十九、每股收益	-	-	-
一百三十、每股收益	-	-	-
一百三十一、每股收益	-	-	-
一百三十二、每股收益	-	-	-
一百三十三、每股收益	-	-	-
一百三十四、每股收益	-	-	-
一百三十五、每股收益	-	-	-
一百三十六、每股收益	-	-	-
一百三十七、每股收益	-	-	-
一百三十八、每股收益	-	-	-
一百三十九、每股收益	-	-	-
一百四十、每股收益	-	-	-
一百四十一、每股收益	-	-	-
一百四十二、每股收益	-	-	-
一百四十三、每股收益	-	-	-
一百四十四、每股收益	-	-	-
一百四十五、每股收益	-	-	-
一百四十六、每股收益	-	-	-
一百四十七、每股收益	-	-	-
一百四十八、每股收益	-	-	-
一百四十九、每股收益	-	-	-
一百五十、每股收益	-	-	-
一百五十一、每股收益	-	-	-
一百五十二、每股收益	-	-	-
一百五十三、每股收益	-	-	-
一百五十四、每股收益	-	-	-
一百五十五、每股收益	-	-	-
一百五十六、每股收益	-	-	-
一百五十七、每股收益	-	-	-
一百五十八、每股收益	-	-	-
一百五十九、每股收益	-	-	-
一百六十、每股收益	-	-	-
一百六十一、每股收益	-	-	-
一百六十二、每股收益	-	-	-
一百六十三、每股收益	-	-	-
一百六十四、每股收益	-	-	-
一百六十五、每股收益	-	-	-
一百六十六、每股收益	-	-	-
一百六十七、每股收益	-	-	-
一百六十八、每股收益	-	-	-
一百六十九、每股收益	-	-	-
一百七十、每股收益	-	-	-
一百七十一、每股收益	-	-	-
一百七十二、每股收益	-	-	-
一百七十三、每股收益	-	-	-
一百七十四、每股收益	-	-	-
一百七十五、每股收益	-	-	-
一百七十六、每股收益	-	-	-
一百七十七、每股收益	-	-	-
一百七十八、每股收益	-	-	-
一百七十九、每股收益	-	-	-
一百八十、每股收益	-	-	-
一百八十一、每股收益	-	-	-
一百八十二、每股收益	-	-	-
一百八十三、每股收益	-	-	-
一百八十四、每股收益	-	-	-
一百八十五、每股收益	-	-	-
一百八十六、每股收益	-	-	-
一百八十七、每股收益	-	-	-
一百八十八、每股收益	-	-	-
一百八十九、每股收益	-	-	-
一百九十、每股收益	-	-	-
一百九十一、每股收益	-	-	-
一百九十二、每股收益	-	-	-
一百九十三、每股收益	-	-	-
一百九十四、每股收益	-	-	-
一百九十五、每股收益	-	-	-
一百九十六、每股收益	-	-	-
一百九十七、每股收益	-	-	-
一百九十八、每股收益	-	-	-
一百九十九、每股收益	-	-	-
二百、每股收益	-	-	-
二百零一、每股收益	-	-	-
二百零二、每股收益	-	-	-
二百零三、每股收益	-	-	-
二百零四、每股收益	-	-	-
二百零五、每股收益	-	-	-
二百零六、每股收益	-	-	-
二百零七、每股收益	-	-	-
二百零八、每股收益	-	-	-
二百零九、每股收益	-	-	-
二百一十、每股收益	-	-	-
二百一十一、每股收益	-	-	-
二百一十二、每股收益	-	-	-
二百一十三、每股收益	-	-	-
二百一十四、每股收益	-	-	-
二百一十五、每股收益	-	-	-
二百一十六、每股收益	-	-	-
二百一十七、每股收益	-	-	-
二百一十八、每股收益	-	-	-
二百一十九、每股收益	-	-	-
二百二十、每股收益	-	-	-
二百二十一、每股收益	-	-	-
二百二十二、每股收益	-	-	-
二百二十三、每股收益	-	-	-
二百二十四、每股收益	-	-	-
二百二十五、每股收益	-	-	-
二百二十六、每股收益	-	-	-
二百二十七、每股收益	-	-	-
二百二十八、每股收益	-	-	-
二百二十九、每股收益	-	-	-
二百三十、每股收益	-	-	-
二百三十一、每股收益	-	-	-
二百三十二、每股收益	-	-	-
二百三十三、每股收益	-	-	-
二百三十四、每股收益	-	-	-
二百三十五、每股收益	-	-	-
二百三十六、每股收益	-	-	-
二百三十七、每股收益	-	-	-
二百三十八、每股收益	-	-	-
二百三十九、每股收益	-	-	-
二百四十、每股收益	-	-	-