

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  
2024 年中期报告

2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2024 年 8 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	7
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>8</b>
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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
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	14
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>40</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45

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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
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 .....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	45
7.12 投资组合报告附注 .....	46
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>47</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>48</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
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 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.8 其他重大事件 .....	50
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
12.1 备查文件目录 .....	51
12.2 存放地点 .....	51
12.3 查阅方式 .....	52

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	平安中证医疗创新 ETF
场内简称	医疗创新 ETF
基金主代码	516820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 9 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	交通银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,777,415,249.00 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	2021 年 7 月 1 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	中证医药及医疗器械创新指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证医药及医疗器械创新指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	方圆
	联系电话	0755-22626828	95559
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		400-800-4800	95559
传真		0755-23997878	021-62701216
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路	中国（上海）自由贸易试验区银

	5033 号平安金融中心 34 层	城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	518048	200336
法定代表人	罗春风	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-114,165,710.23
本期利润	-326,551,098.32
加权平均基金份额本期利润	-0.1010
本期加权平均净值利润率	-28.28%
本期基金份额净值增长率	-24.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,605,729,447.47
期末可供分配基金份额利润	-0.6898
期末基金资产净值	1,171,685,801.53
期末基金份额净值	0.3102
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-68.98%

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	-8.55%	0.94%	-9.41%	0.95%	0.86%	-0.01%
过去三个月	-12.17%	1.15%	-13.29%	1.18%	1.12%	-0.03%
过去六个月	-24.32%	1.42%	-25.51%	1.46%	1.19%	-0.04%
过去一年	-24.56%	1.36%	-25.41%	1.39%	0.85%	-0.03%
过去三年	-69.50%	1.69%	-71.09%	1.72%	1.59%	-0.03%
自基金合同生效起至今	-68.98%	1.68%	-70.15%	1.72%	1.17%	-0.04%

#### 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

平安中证医疗创新ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、本基金基金合同于 2021 年 06 月 09 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、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 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		
王仁增	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基金经理助理	2021 年 7 月 8 日	-	10 年	王仁增先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任财通基金管理有限公司产品经理、华安基金管理有限公司高级产品经理。2021 年 6 月加入平安基金管理有限公司，任 ETF 指数投资中心高级研究员、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、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、平安中证汽车零部件主题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基金经理。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI



					<p>中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金基金经理助理。</p>
翁欣	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基金经理	2023 年 12 月 27 日	-	4 年	<p>翁欣女士，哥伦比亚大学金融数学专业硕士，曾担任华泰柏瑞基金管理有限公司指数投资部研究员。2023 年 5 月加入平安基金管理有限公司，任 ETF 指数投资中心高级研究员，现任平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证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、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安上证红利低波动指数型证券投资基金基金经理。</p>

李严	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基金经理助理	2024 年 1 月 11 日	-	3 年	<p>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、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</p>
----	-----------------------------------	-----------------	---	-----	--

					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。
钱晶	ETF 指数中心投资副总监，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基金经理	2021 年 6 月 9 日	2024 年 3 月 20 日	13 年	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数中心投资副总监，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、平安国证 2000 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、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 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联接基金、平安上证红利低波动指数型证券投资基金、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

注：无。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

作为一只投资于中证医药及医疗器械创新主题指数的被动型产品，基金在投资管理上，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，较好地完成了基金的投资目标。

#### 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 0.3102 元，本报告期基金份额净值增长率为-24.32%，业绩比较基准收益率为-25.51%。

### 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 2024 年下半年，中国经济将继续在“稳中求进”的总基调下运行，经济增速有望保持在合理区间。从外部宏观上看，全球流动性有望宽松，一部分主要经济体央行已进入降息周期，全球经济或将持续复苏，分母端的压力减退有望提振权益资产的投资价值。从国内宏观来看，房地产产业的支持性政策刺激下，商品房销售面积数据出现了较为明显的改善，叠加地产开工增速放缓，地产下行最快的时候已经过去。出口端强劲，外贸持续保持顺差，我国的出口市场更加多元化，展现了更强的跨越周期波动的能力。投资端，在三中全会的定调下，对于财政端发力预期会更加清晰。

对于下半年股票投资上看，可以适当更积极乐观一些。对于市场掣肘的因素正在逐步消退，外部流动性随着降息的落地会有回流的诉求，国内基本面的维稳改善提振了投资预期，资产间性价比中股票市场的价值正在逐步突出，政策端对于股票市场机制的不断完善保障了长期的投资价值。

指数化投资在经历市场的震荡中进一步凸显了该投资范式的普遍性，作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金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，基金托管人在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的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，平安基金管理有限公司在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投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由平安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关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的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	35,032,110.10	29,289,519.94
结算备付金		30,557,586.40	521,251.05
存出保证金		158,438.54	345,726.11
交易性金融资产	6.4.7.2	1,107,601,416.89	1,198,671,862.00
其中：股票投资		1,107,601,416.89	1,198,671,862.00
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		565,209.35	412,631.96
应收股利		314,174.02	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	6.4.7.8	1,392,566.78	37,753.68
资产总计		1,175,621,502.08	1,229,278,744.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>
		<b>2024年6月30日</b>	<b>2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		476,788.52	515,436.72
应付托管费		95,357.70	103,087.34
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		6,349.87	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	3,357,204.46	3,001,880.31
负债合计		3,935,700.55	3,620,404.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	3,777,415,249.00	2,990,415,249.00
未分配利润	6.4.7.12	-2,605,729,447.47	-1,764,756,908.63
净资产合计		1,171,685,801.53	1,225,658,340.37
负债和净资产总计		1,175,621,502.08	1,229,278,744.74

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.3102 元，基金份额总额 3,777,415,249.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至2024年 6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
<b>一、营业总收入</b>		-322,927,964.49	-277,786,651.33
1. 利息收入		166,933.13	786,892.69
其中：存款利息收入	6.4.7.13	166,933.13	53,194.93
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		-	733,697.76
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-112,176,022.86	-165,922,215.83
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-125,902,755.06	-181,277,683.78
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	12,658,037.21	15,355,467.95
其他投资收益		1,068,694.99	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.20	-212,385,388.09	-114,607,801.81
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	1,466,513.33	1,956,473.62
<b>减: 二、营业总支出</b>		<b>3,623,133.83</b>	<b>3,199,730.01</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,865,387.67	2,519,327.92
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	573,077.50	503,865.55
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		680.35	-
8. 其他费用	6.4.7.23	183,988.31	176,536.54
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-326,551,098.32</b>	<b>-280,986,381.34</b>
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-326,551,098.32</b>	<b>-280,986,381.34</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-326,551,098.32</b>	<b>-280,986,381.34</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体: 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

本报告期: 2024年1月1日至2024年6月30日



单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,990,415,249.00	-	-1,764,756,908.63	1,225,658,340.37
二、本期期初净资产	2,990,415,249.00	-	-1,764,756,908.63	1,225,658,340.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	787,000,000.00	-	-840,972,538.84	-53,972,538.84
(一)、综合收益总额	-	-	-326,551,098.32	-326,551,098.32
(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)	787,000,000.00	-	-514,421,440.52	272,578,559.48
其中：1. 基金申购款	1,797,000,000.00	-	-1,162,639,412.06	634,360,587.94
2. 基金赎回款	-1,010,000,000.00	-	648,217,971.54	-361,782,028.46
(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	3,777,415,249.00	-	-2,605,729,447.47	1,171,685,801.53
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,575,415,249.00	-	-740,212,737.96	835,202,511.04
二、本期期初净资产	1,575,415,249.00	-	-740,212,737.96	835,202,511.04

	00		6	
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,345,000,000.00	-	-979,405,431.59	365,594,568.41
(一)、综合收益总额	-	-	-280,986,381.34	-280,986,381.34
(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)	1,345,000,000.00	-	-698,419,050.25	646,580,949.75
其中：1. 基金申购款	2,013,000,000.00	-	-1,030,380,487.31	982,619,512.69
2. 基金赎回款	-668,000,000.00	-	331,961,437.06	-336,038,562.94
(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	2,920,415,249.00	-	-1,719,618,169.55	1,200,797,079.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安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(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[2021]1086号《关于准予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注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《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 1,134,404,000.00 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(2021)第 0589 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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基金合同》于 2021 年 6 月 9 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,134,415,249.00 份，其中认购资金利息折合 11,249.00 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，基金托管人为交通银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]271 号审核同意，本基金 1,134,415,249.00 份基金份额于 2021 年 7 月 1 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《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表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；本基金主要投资于中证医药及医疗器械创新指数的成份股及其备选成份股。为更好地实现投资目标，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允许投资的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、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)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、信用衍生品、银行存款(协议存款、通知存款以及定期存款)、同业存单、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)。在条件许可的情况下，根据相关法律法规，本基金可参与融资和转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。本基金投资于中证医药及医疗器械创新指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证医药及医疗器械创新指数收益率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 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

产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	35,032,110.10
等于：本金	35,026,319.49
加：应计利息	5,790.61
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	35,032,110.10

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,414,179,679.71	-	1,107,601,416.89	-306,578,262.82
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	1,414,179,679.71	-	1,107,601,416.89	-306,578,262.82

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

## 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

## 6.4.7.4 买入返售金融资产

## 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	16,442.93
待摊费用	75,410.07
现金差额	1,300,713.78
合计	1,392,566.78

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	681,649.50
其中：交易所市场	681,649.50
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,398.38
应退退补款	2,565,279.84
可退替代款	876.74
合计	3,357,204.46

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,990,415,249.00	2,990,415,249.00
本期申购	1,797,000,000.00	1,797,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,010,000,000.00	-1,010,000,000.00
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	3,777,415,249.00	3,777,415,249.00

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	-1,182,665,155.69	-582,091,752.94	-1,764,756,908.63
本期期初	-1,182,665,155.69	-582,091,752.94	-1,764,756,908.63
本期利润	-114,165,710.23	-212,385,388.09	-326,551,098.32
本期基金份额交易产生的变动数	-327,876,164.80	-186,545,275.72	-514,421,440.52
其中：基金申购款	-739,884,111.98	-422,755,300.08	-1,162,639,412.06
基金赎回款	412,007,947.18	236,210,024.36	648,217,971.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,624,707,030.72	-981,022,416.75	-2,605,729,447.47

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	活期存款利息收入	59,611.90
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	105,321.28	
其他	1,999.95	
合计	166,933.13	



#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-103,292,620.89
股票投资收益——赎回差价收入	-22,610,134.17
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	-125,902,755.06

##### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	552,195,881.03
减：卖出股票成本总额	654,196,240.92
减：交易费用	1,292,261.00
买卖股票差价收入	-103,292,620.89

##### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
赎回基金份额对价总额	361,782,028.46
减：现金支付赎回款总额	238,328,415.46
减：赎回股票成本总额	146,063,747.17
减：交易费用	-
赎回差价收入	-22,610,134.17

##### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

##### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益**

**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益**

**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.18 衍生工具收益**

**6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------------------------

股票投资产生的股利收益	12,658,037.21
其中：证券出借权益补偿收入	784,148.54
基金投资产生的股利收益	-
合计	12,658,037.21

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-212,385,388.09
股票投资	-212,385,388.09
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	-
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	-212,385,388.09

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,466,513.33
合计	1,466,513.33

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	84,534.41
合计	183,988.31

## 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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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

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

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股票交易。

#### 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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

#### 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,865,387.67	2,519,327.92
其中：应支付销售机构的客户维护 费	259,509.20	92,466.05
应支付基金管理人的净管理费	2,605,878.47	2,426,861.87

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	573,077.50	503,865.55

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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

单位：人民币元

本期
----

2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日						
关联方名称	交易金额	费率区间 (%)	加权平均费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	303,610.00	3.10	3.10	732.04	-	-
平安证券	305,500.00	3.10	3.10	736.59	-	-
平安证券	314,510.00	3.10	3.10	433.32	-	-
平安证券	315,000.00	1.90	1.90	232.75	-	-
平安证券	199,500.00	3.00	3.00	232.75	-	-
平安证券	307,460.00	2.00	2.00	239.14	-	-
平安证券	299,040.00	2.70	2.70	313.99	-	-

#### 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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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 (%)
方正证券	10,284,917.00	0.2723	9,474,509.00	0.3168

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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
交通银行-活期	35,032,110.10	59,611.90	13,388,182.54	39,601.24

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业存款利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2024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
001359	平安电工	2024年3月19日	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
001387	雪祺电气	2024年1月4日	6个月	新股锁定	11.82	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股锁定	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股锁定	39.82	91.24	150	5,972.74	13,686.00	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股锁定	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-

		日									
301587	中瑞股份	2024年 3月27日	6个月	新股锁定	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
301588	美新科技	2024年 3月6日	6个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-	
301591	肯特股份	2024年 2月20日	6个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
603082	北自科技	2024年 1月23日	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-	
603285	键邦股份	2024年 6月28日	1个月 内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-	
603312	西典新能	2024年 1月4日	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-	
603325	博隆技术	2024年 1月3日	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-	
603344	星德胜	2024年 3月13日	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-	
603350	安乃达	2024年 6月26日	1个月 内(含)	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-	
603350	安乃达	2024年 6月26日	6个月	新股锁定	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-	
603375	盛景微	2024年 1月17日	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-	
603381	永臻股份	2024年 6月19日	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-	
688530	欧莱新材	2024年 4月29日	6个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-	
688584	上海合晶	2024年 2月1日	6个月	新股锁定	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-	
688691	灿芯股份	2024年 4月2日	6个月	新股锁定	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-	
688692	达梦数据	2024年 6月4日	6个月	新股锁定	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-	



688695	中创股份	2024年3月6日	6个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024年1月31日	6个月	新股锁定	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-

注：1、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。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后6个月内不得转让。

#### 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000661	长春高新	2024年7月9日	91.77	6,800	624,036.00
2	000999	华润三九	2024年7月3日-2024年7月3日	42.58	1,560	66,424.80
3	002821	凯莱英	2024年7月3日-2024年7月5日	65.80	12,800	842,240.00
4	300015	爱尔眼科	2024年7月9日	10.32	63,000	650,160.00
5	300633	开立医疗	2024年7月9日-2024年7月9日	39.58	8,800	348,304.00

6	300759	康龙化成	2024年7月9日-2024年7月10日	18.58	275,900	5,126,222.00
7	300832	新产业	2024年7月9日-2024年7月9日	67.44	67,300	4,538,712.00
8	300896	爱美客	2024年7月5日-2024年7月11日	172.10	27,200	4,681,120.00
9	301267	华夏眼科	2024年7月9日-2024年7月9日	20.72	33,200	687,904.00
10	600566	济川药业	2024年7月9日	31.71	1,000	31,710.00
11	603259	药明康德	2024年7月9日	39.19	238,400	9,342,896.00
12	603456	九洲药业	2024年7月9日	13.72	1,600	21,952.00
13	688016	心脉医疗	2024年7月9日	98.05	5,400	529,470.00
14	688271	联影医疗	2024年7月2日-2024年7月9日	109.70	103,400	11,342,980.00
15	688278	特宝生物	2024年7月5日-2024年7月10日	53.55	27,000	1,445,850.00
16	688520	神州细胞	2024年7月9日	39.35	1,100	43,285.00
17	688575	亚辉龙	2024年7月5日-2024年7月9日	23.32	87,700	2,045,164.00
18	688617	惠泰医疗	2024年7月9日	456.10	12,900	5,883,690.00
合计	-	-	-	-	975,060	48,252,119.80

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，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 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
货币资金	35,032,110.10	-	-	-	35,032,110.10
结算备付金	30,557,586.40	-	-	-	30,557,586.40
存出保证金	158,438.54	-	-	-	158,438.54
交易性金融资产	-	-	-	1,107,601,416.89	1,107,601,416.89
应收股利	-	-	-	314,174.02	314,174.02
应收清算款	-	-	-	565,209.35	565,209.35
其他资产	-	-	-	1,392,566.78	1,392,566.78
资产总计	65,748,135.04	-	-	1,109,873,367.04	1,175,621,502.08
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	476,788.52	476,788.52
应付托管费	-	-	-	95,357.70	95,357.70
应交税费	-	-	-	6,349.87	6,349.87
其他负债	-	-	-	3,357,204.46	3,357,204.46
负债总计	-	-	-	3,935,700.55	3,935,700.55
利率敏感度缺口	65,748,135.04	-	-	1,105,937,666.49	1,171,685,801.53
<b>上年度末 2023年12月31日</b>					
<b>资产</b>					
货币资金	29,289,519.94	-	-	-	29,289,519.94
结算备付金	521,251.05	-	-	-	521,251.05
存出保证金	345,726.11	-	-	-	345,726.11
交易性金融资产	-	-	-	1,198,671,862.00	1,198,671,862.00
应收清算款	-	-	-	412,631.96	412,631.96
其他资产	-	-	-	37,753.68	37,753.68
资产总计	30,156,497.10	-	-	1,199,122,247.64	1,229,278,744.74
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	515,436.72	515,436.72

应付托管费	-	-	-	103,087.34	103,087.34
其他负债	-	-	-	3,001,880.31	3,001,880.31
负债总计	-	-	-	3,620,404.37	3,620,404.37
利率敏感度缺口	30,156,497.10	-	-	1,195,501,843.27	1,225,658,340.37

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	1,107,601,416.89	94.53	1,198,671,862.00	97.80
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	1,107,601,416.89	94.53	1,198,671,862.00	97.80

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）	
分析	沪深 300 指数上升 5%	69,729,120.51	55,688,055.40
	沪深 300 指数下降 5%	-69,729,120.51	-55,688,055.40

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,107,364,751.53	1,198,463,416.25

第二层次	45,611.11	-
第三层次	191,054.25	208,445.75
合计	1,107,601,416.89	1,198,671,862.00

#### 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

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,107,601,416.89	94.21
	其中：股票	1,107,601,416.89	94.21
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	65,589,696.50	5.58
8	其他各项资产	2,430,388.69	0.21
9	合计	1,175,621,502.08	100.00



注：本基金本报告期末融出证券市值为 48,252,119.80 元，占净值比例 4.12%。

## 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	859,246,530.82	73.33
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	-	-
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	142,569,073.51	12.17
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	105,549,147.20	9.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,107,364,751.53	94.51

### 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	189,684.34	0.02
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	-	-

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	46,981.02	0.00
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	236,665.36	0.02

### 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	300760	迈瑞医疗	400,700	116,567,637.00	9.95
2	603259	药明康德	2,841,429	111,355,602.51	9.50
3	300015	爱尔眼科	8,781,435	90,624,409.20	7.73
4	688271	联影医疗	622,688	68,308,873.60	5.83
5	002422	科伦药业	2,111,900	64,053,927.00	5.47
6	300122	智飞生物	2,251,232	63,102,032.96	5.39
7	000661	长春高新	611,625	56,128,826.25	4.79
8	300896	爱美客	286,340	49,279,114.00	4.21
9	002223	鱼跃医疗	1,131,300	42,536,880.00	3.63
10	000999	华润三九	970,170	41,309,838.60	3.53
11	300832	新产业	594,630	40,101,847.20	3.42
12	688617	惠泰医疗	86,091	39,266,105.10	3.35
13	300759	康龙化成	1,679,950	31,213,471.00	2.66
14	002821	凯莱英	448,420	29,506,036.00	2.52
15	688578	艾力斯	429,600	27,382,704.00	2.34

16	002262	恩华药业	1,136,800	26,987,632.00	2.30
17	600566	济川药业	693,800	22,000,398.00	1.88
18	600129	太极集团	733,500	21,212,820.00	1.81
19	603658	安图生物	439,500	20,247,765.00	1.73
20	300009	安科生物	2,207,700	18,853,758.00	1.61
21	688050	爱博医疗	243,700	17,868,084.00	1.52
22	300633	开立医疗	406,221	16,078,227.18	1.37
23	688278	特宝生物	299,255	16,025,105.25	1.37
24	688301	奕瑞科技	131,287	15,128,201.01	1.29
25	603456	九洲药业	1,016,700	13,949,124.00	1.19
26	688575	亚辉龙	539,091	12,571,602.12	1.07
27	688016	心脉医疗	113,312	11,110,241.60	0.95
28	301267	华夏眼科	471,700	9,773,624.00	0.83
29	688520	神州细胞	245,737	9,669,750.95	0.83
30	301239	普瑞眼科	145,800	5,151,114.00	0.44

### 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	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
2	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
3	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
4	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
5	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
6	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
7	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
8	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
9	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
10	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
11	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
12	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
13	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
14	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
15	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
16	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
17	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
18	603381	永臻股份	178	4,473.14	0.00
19	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
20	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
21	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
22	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
23	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
24	001387	雪祺电气	173	2,638.25	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	002422	科伦药业	69,531,173.26	5.67
2	300015	爱尔眼科	58,049,573.30	4.74
3	300760	迈瑞医疗	54,271,398.78	4.43
4	300896	爱美客	47,645,873.08	3.89
5	300122	智飞生物	46,954,835.00	3.83
6	002223	鱼跃医疗	45,659,837.39	3.73
7	000661	长春高新	42,356,201.05	3.46
8	603259	药明康德	40,209,339.28	3.28
9	002262	恩华药业	27,692,659.17	2.26
10	300832	新产业	26,756,013.95	2.18
11	600129	太极集团	24,615,550.81	2.01
12	688578	艾力斯	24,463,920.74	2.00
13	000999	华润三九	23,006,356.20	1.88
14	300347	泰格医药	20,334,687.00	1.66
15	300009	安科生物	20,256,201.38	1.65
16	603658	安图生物	19,993,939.00	1.63
17	688050	爱博医疗	18,191,531.49	1.48
18	300759	康龙化成	18,019,421.90	1.47
19	002821	凯莱英	17,533,693.80	1.43
20	002603	以岭药业	11,301,479.00	0.92

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	600436	片仔癀	107,344,352.15	8.76
2	300347	泰格医药	59,219,763.97	4.83
3	300760	迈瑞医疗	57,218,293.02	4.67
4	603392	万泰生物	41,540,571.17	3.39
5	300896	爱美客	34,160,553.20	2.79
6	300015	爱尔眼科	31,040,364.02	2.53
7	002603	以岭药业	31,037,056.60	2.53
8	300122	智飞生物	27,592,499.98	2.25
9	000661	长春高新	25,655,204.34	2.09
10	600521	华海药业	24,925,042.00	2.03
11	688114	华大智造	20,308,354.97	1.66
12	300832	新产业	16,438,816.95	1.34

13	688271	联影医疗	14,435,622.03	1.18
14	000999	华润三九	12,129,395.30	0.99
15	300363	博腾股份	10,726,731.00	0.88
16	002821	凯莱英	8,979,111.04	0.73
17	300759	康龙化成	8,699,116.90	0.71
18	300633	开立医疗	3,951,539.00	0.32
19	688202	美迪西	2,769,623.28	0.23
20	301267	华夏眼科	2,743,674.26	0.22

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	719,393,436.20
卖出股票收入（成交）总额	552,195,881.03

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投资。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	158,438.54
2	应收清算款	565,209.35
3	应收股利	314,174.02
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	16,442.93
7	待摊费用	75,410.07
8	其他	1,300,713.78
9	合计	2,430,388.69

### 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

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	688271	联影医疗	11,342,980.00	0.97	转融通流通受限
2	603259	药明康德	9,342,896.00	0.80	转融通流通受限
3	300896	爱美客	4,681,120.00	0.40	转融通流通受限
4	300015	爱尔眼科	650,160.00	0.06	转融通流通受限
5	000661	长春高新	624,036.00	0.05	转融通流通受限
6	000999	华润三九	66,424.80	0.01	转融通流通受限

#### 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	688692	达梦数据	30,612.75	0.00	新股锁定
2	603285	键邦股份	24,002.55	0.00	新股未上市
3	603350	安乃达	19,429.20	0.00	新股未上市
3	603350	安乃达	2,179.36	0.00	新股锁定
4	688709	成都华微	19,635.55	0.00	新股锁定
5	301536	星辰科技	15,521.87	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

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 (%)
29,852	126,538.10	315,103,904.00	8.34	3,462,311,345.00	91.66

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中国人寿保险 (集团) 公司	130,000,000.00	3.44
2	青岛云锦新能源科技 有限公司	33,955,500.00	0.90
3	林生铃	32,958,600.00	0.87
4	招商证券股份有限公 司	31,713,170.00	0.84
5	王文峰	23,182,300.00	0.61
6	李俞玮	21,999,600.00	0.58
7	王玉清	21,827,700.00	0.58
8	孔春华	17,033,500.00	0.45
9	杨登峰	15,529,000.00	0.41
10	祝慧敏	14,525,700.00	0.38

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	744,000.00	0.0197

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门 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（2021 年 6 月 9 日）基金份额总额	1,134,415,249.00
本报告期期初基金份额总额	2,990,415,249.00
本报告期基金总申购份额	1,797,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,010,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	3,777,415,249.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期内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，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期内无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 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

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。



## 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 (%)	
广发证券	1	598,798,322.39	47.14	440,658.20	47.14	-
国盛证券	1	267,620,369.83	21.07	196,947.23	21.07	-
天风证券	1	266,668,367.21	20.99	196,243.76	20.99	-
信达证券	1	77,740,804.94	6.12	57,206.88	6.12	-
中信证券	1	29,205,703.24	2.30	21,492.21	2.30	-
华泰证券	2	27,297,468.80	2.15	20,088.36	2.15	-
中国中金财富证券	2	1,677,175.40	0.13	1,234.26	0.13	-
中信建投证券	2	1,191,450.33	0.09	876.87	0.09	-
川财证券有限责任公司	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-

注：1 基金交易单元的选择标准如下：

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

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
广发证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
中国中 金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
川财证 券有限 责任公 司	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 15 日
2	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 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 19 日
3	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增长江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	2024 年 02 月 08 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增西南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	2024 年 02 月 26 日
5	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基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 21 日
6	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基金产品资	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 21 日

	料概要更新		
7	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招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 21 日
8	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 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 29 日
9	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 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 19 日
10	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方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	2024 年 05 月 22 日
11	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基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 05 月 31 日
12	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招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 05 月 31 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予平安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募集注册的文件

(2) 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基金合同

(3) 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

2024 年 8 月 30 日