

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 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 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 2021 年 01 月 01 日起至 2021 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49

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	49
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	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§ 8 基金份额持有人信息	51
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
8.2 期末上市基金前十名持有人	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	52
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	52
§ 9 开放式基金份额变动	52
§ 10 重大事件揭示	52
10.1 基金份额持有人大会决议	52
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	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	53
10.4 基金投资策略的改变	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
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	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
10.8 其他重大事件	54
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	55
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	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	56
§ 12 备查文件目录	56
12.1 备查文件目录	56
12.2 存放地点	57
12.3 查阅方式	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	粤港澳大湾区 ETF
场内简称	湾区 ETF (扩位证券简称:大湾区 ETF)
基金主代码	512970
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 9 月 23 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	289,987,638.00 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	2019 年 11 月 11 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证粤港澳大湾区发展主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798

注册地址	深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	罗春风	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	18,561,577.37
本期利润	3,679,790.99
加权平均基金份额本期利润	0.0126
本期加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	0.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	146,815,515.16
期末可供分配基金份额利润	0.5063
期末基金资产净值	436,803,153.16
期末基金份额净值	1.5063
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	50.63%

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。

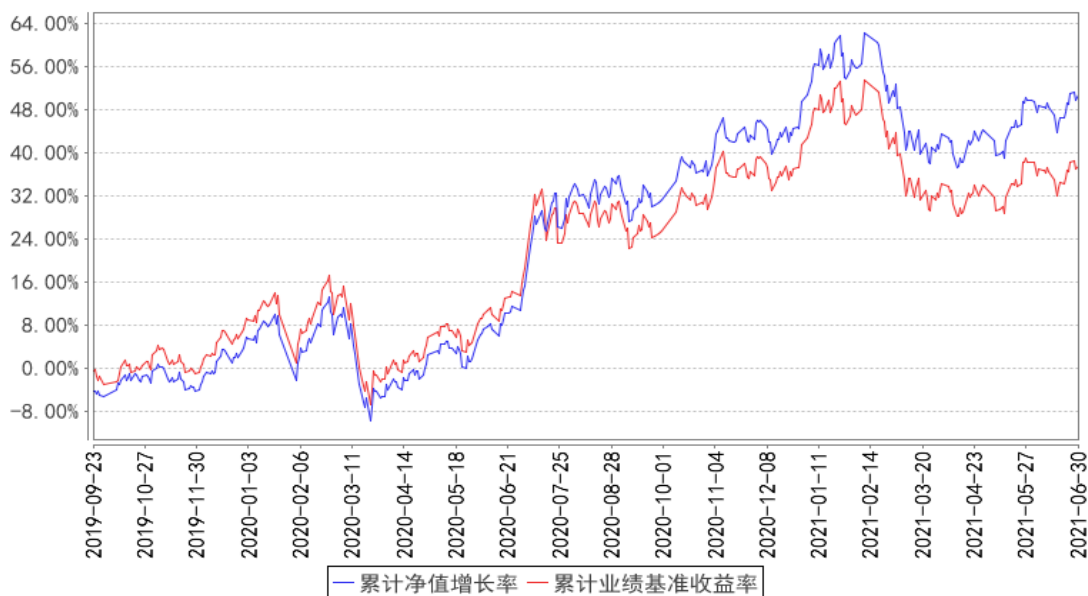
3.2 基金净值表现

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

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	0.66%	0.87%	-0.52%	0.89%	1.18%	-0.02%
过去三个月	7.07%	1.02%	4.53%	1.06%	2.54%	-0.04%
过去六个月	0.83%	1.28%	-2.77%	1.31%	3.60%	-0.03%
过去一年	33.60%	1.29%	18.93%	1.36%	14.67%	-0.07%
自基金合同生效起至今	50.63%	1.39%	37.58%	1.43%	13.05%	-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

粤港澳大湾区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 2019 年 09 月 23 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

符合合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 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（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。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。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2021年6月30日，平安基金共管理138只公募基金，公募资产管理总规模约为3,831亿元人民币。

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		
成钧	ETF 指数投资中心投资执行总经理，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基金经理	2019年9月23日	-	10年	成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017年2月加入平安基金管理有限公司，现任ETF指数投资中心投资执行总经理。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、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、平安中债-中高等级公司债利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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。
刘 洁 倩	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基金经理	2019 年 10 月 11 日	-	7 年	刘洁倩女士，浙江大学博士，曾担任国泰基金管理有限公司产品研究主管。2018 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心指数研究员、基金经理助理。现任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、平安中证光伏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基金经理。
董 俊 玲	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基金经理助理	2019 年 10 月 16 日	-	3 年	董俊玲女士，同济大学金融学硕士。曾担任鹏华基金管理有限公司 FOF 研究员。2019 年 7 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心指数研究员。现担任平安中债-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、平安创业板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、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金

					基金经理助理。
王宁	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基金经理助理	2020 年 11 月 18 日	-	4 年	王宁宁女士，法国雷恩高等商学院硕士，曾任平安道远投资管理（上海）有限公司量化投资部助理产品经理，2018 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心指数研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 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、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、平安中债-0-5 年广东省地方政府债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基金经理助理。

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

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

作为一只投资于粤港澳大湾区主题公司的被动型产品，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，本基金的日均偏离度为 0.05%，年化跟踪误差 0.86%，较好的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 1.5063 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.83%，业绩比较基准收益率为-2.77%。

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 2021 年下半年，宏观经济动能见顶回落，企业盈利修复进入中后期阶段，但基本面韧性

仍在，并存在结构性亮点，如高端制造业，硬核科技等。从股债收益比来看，A 股市场估值整体不贵，且政策改革的加快推进，有利于市场整体风险偏好的提升，因此市场整体向下风险不大。综上所述考虑，我们对权益资产的前景仍保持谨慎乐观。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，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人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委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、资本市场风险监控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。

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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数低于 200 人、基金资产净值低于 5,000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对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的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的管理人——平安基金管理有限公司在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的投资

运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的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 2021 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安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

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	5,401,751.38	2,642,031.11
结算备付金		892,289.00	755,557.33
存出保证金		11,451.36	260,351.45
交易性金融资产	6.4.7.2	423,420,269.19	428,210,807.48
其中：股票投资		423,420,269.19	428,210,807.48
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	4,000,000.00	-
应收证券清算款		3,486,079.46	6,385,755.55
应收利息	6.4.7.5	1,933.74	-701.69
应收股利		375.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,616.24	-
资产总计		437,289,765.37	438,253,801.23
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,046.23	53,442.87
应付托管费		17,682.09	17,814.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	61,787.95	74,033.76
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	354,095.94	426,870.78
负债合计		486,612.21	572,161.69
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	289,987,638.00	292,987,638.00
未分配利润	6.4.7.10	146,815,515.16	144,694,001.54
所有者权益合计		436,803,153.16	437,681,639.54
负债和所有者权益总计		437,289,765.37	438,253,801.23

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.5063 元，基金份额总额 289,987,638.00 份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		4,529,680.90	290,832,161.01
1. 利息收入		83,831.64	421,924.66
其中：存款利息收入	6.4.7.11	18,979.88	108,301.16
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		57,016.06	76,679.12
证券出借利息收入		7,835.70	236,944.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		19,321,774.74	420,180,554.83
其中：股票投资收益	6.4.7.12	16,915,214.43	405,043,323.10
基金投资收益	-	-	-

债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,406,560.31	15,137,231.73
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	-14,881,786.38	-137,516,803.58
4. 汇兑收益（损失以 “-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以 “-”号填列）	6.4.7.18	5,860.90	7,746,485.10
减：二、费用		849,889.91	8,870,014.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	321,339.96	1,937,806.30
2. 托管费	6.4.10.2.2	107,113.36	645,935.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	167,711.89	5,664,278.14
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	253,724.70	621,994.56
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		3,679,790.99	281,962,146.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以 “-”号填列）		3,679,790.99	281,962,146.51

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2021年1月1日至2021年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30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）	292,987,638.00	144,694,001.54	437,681,639.54
二、本期经营活 动产生的基金 净值变动数（本 期利润）	-	3,679,790.99	3,679,790.99
三、本期基金份	-3,000,000.00	-1,558,277.37	-4,558,277.37

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	2,000,000.00	1,105,512.92	3,105,512.92
2. 基金赎回款	-5,000,000.00	-2,663,790.29	-7,663,790.29
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)	289,987,638.00	146,815,515.16	436,803,153.16
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30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)	4,941,987,638.00	178,437,743.38	5,120,425,381.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	281,962,146.51	281,962,146.51
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)	-3,724,000,000.00	-305,087,849.63	-4,029,087,849.63
其中: 1. 基金申购款	21,000,000.00	1,288,512.04	22,288,512.04
2. 基金赎回款	-3,745,000,000.00	-306,376,361.67	-4,051,376,361.67
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）	1,217,987,638.00	155,312,040.26	1,373,299,678.26
-------------------------	------------------	----------------	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安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(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[2018]2117号《关于准予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《平安中证粤港澳大湾区发展主题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6,009,960,641.00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(2019)第0497号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于2019年9月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为6,009,987,638.00份基金份额,其中认购资金利息折合26,997.00份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[20199]229号审核同意,本基金6,009,987,638.00份基金份额于2019年11月11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《平安中证粤港澳大湾区发展主题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中证粤港澳大湾区发展主题指数,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粤港澳大湾区发展主题指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标,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核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、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,基金管理人可在不改变本基金既有投资目

标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。本基金的投资组合比例为：本基金投资于中证粤港澳大湾区发展主题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的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证粤港澳大湾区发展主题指数收益率。

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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安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基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
活期存款	5,401,751.38

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	5,401,751.38

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	359,721,118.83	423,420,269.19	63,699,150.36
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	359,721,118.83	423,420,269.19	63,699,150.36

注：于 2021 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	4,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	810.68
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	361.35
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	757.12
其他	4.59
合计	1,933.74

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
现金差额	-
合计	75,616.24

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	61,787.95
银行间市场应付交易费用	-
合计	61,787.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	249,095.94
应付指数使用费	105,000.00
合计	354,095.94

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	292,987,638.00	292,987,638.00
本期申购	2,000,000.00	2,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-5,000,000.00	-5,000,000.00
- 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	289,987,638.00	289,987,638.00

6.4.7.10 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	178,439,352.48	-33,745,350.94	144,694,001.54
本期利润	18,561,577.37	-14,881,786.38	3,679,790.99
本期基金份额交易产生的变动数	-1,881,880.11	323,602.74	-1,558,277.37
其中：基金申购款	1,235,121.74	-129,608.82	1,105,512.92
基金赎回款	-3,117,001.85	453,211.56	-2,663,790.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	195,119,049.74	-48,303,534.58	146,815,515.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	13,681.16
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	4,874.54	
其他	424.18	
合计	18,979.88	

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	16,649,103.10

股票投资收益——赎回差价收入	266,111.33
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	16,915,214.43

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	59,286,956.92
减：卖出股票成本总额	42,637,853.82
买卖股票差价收入	16,649,103.10

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	7,663,790.29
减：现金支付赎回款总额	5,334,797.29
减：赎回股票成本总额	2,062,881.67
赎回差价收入	266,111.33

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于股票投资产生的证券申购差价收入。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益产生的证券出借差价收入。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券买卖差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 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。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	2,406,560.31
其中：证券出借权益补偿收入	12,730.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,406,560.31

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-14,881,786.38
股票投资	-14,881,786.38
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	-14,881,786.38

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为零。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	5,860.90
合计	5,860.90

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出成本)与申购(赎回)确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	167,711.89
银行间市场交易费用	-
合计	167,711.89

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	245.00
指数使用费	70,000.00
其他	84,300.75
合计	253,724.70

6.4.7.21 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，无须作披露的分部报告。

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

截至本财务报表批准报出日，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
工商银行	基金托管人
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
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	基金管理人的子公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安人寿保险股份有限公司(“平安人寿”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
平安证券	30,504,114.40	28.98	835,007,866.71	25.28

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内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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
平安证券	428,000,000.00	68.15	10,000,000.00	1.13

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	21,697.24	28.98	21,525.35	34.84
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日			

	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	593,942.19	25.28	-	-

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。

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 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	321,339.96	1,937,806.30
其中：支付销售机构的客户维护 费	-	-

注：支付基金管理人平安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020 年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	107,113.36	645,935.50

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%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 × 0.05% / 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：本基金本报告期内及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交

易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
平安人寿	100,012,730.00	34.4886	100,012,730.00	34.1355

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 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期	5,401,751.38	13,681.16	4,217,044.92	63,036.89

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年6月30日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

				数量（单位： 张）	总金额
平安证券股份有 限公司	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
平安证券股份有 限公司	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额
-	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为了更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人最终控股母公司中国平安保险(集团)股份有限公司发行的股票中国平安和于与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司平安银行发行的股票平安银行。

(1) 于2021年6月30日，本基金持有554,713股中国平安的A股普通股，成本总额为人民币45,111,938.77元，估值总额为人民币35,656,951.64元，占基金资产净值的比例为8.16%（于2020年6月30日，本基金持有1,686,913股中国平安的A股普通股，成本总额为人民币145,375,843.73元，估值总额为人民币120,445,588.20元，占基金资产净值的比例为8.77%）。

(2) 于2021年6月30日，本基金持有505,539股平安银行的A股普通股，成本总额为人民币8,024,252.42元，估值总额为人民币11,435,292.18元，占基金资产净值的比例为2.62%（于2020年6月30日，本基金持有2,594,839股平安银行的A股普通股，成本总额为人民币42,936,559.02元，估值总额为人民币33,213,939.20元，占基金资产净值的比例为2.42%）。

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(2021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	可流通 日	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

300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股锁定	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月12日	新股锁定	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股锁定	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股锁定	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股锁定	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股锁定	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股锁定	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股锁定	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股锁定	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股锁定	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股锁定	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股锁定	47.33	251.96	314	14,861.62	79,115.44	-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股锁定	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股锁定	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-

300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股锁定	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股锁定	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股锁定	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股锁定	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股锁定	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股锁定	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股锁定	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股锁定	33.22	87.50	541	17,972.02	47,337.50	-
300981	中红医疗	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	48.59	90.39	348	16,909.32	31,455.72	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股锁定	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-

300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股锁定	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股锁定	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300993	玉马遮阳	2021年5月17日	2021年11月24日	新股锁定	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股锁定	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股锁定	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股锁定	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股锁定	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股锁定	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301009	可靠股份	2021年6月8日	2021年12月17日	新股锁定	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股锁定	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股锁定	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-

301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股锁定	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股锁定	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股锁定	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股锁定	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	8.29	8.29	7,029	58,270.41	58,270.41	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定	8.29	8.29	782	6,482.78	6,482.78	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股锁定	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科	2021年	2021	新股锁	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-

	科技	3月12日	2021年9月22日	定							
688226	威腾电气	2021年6月28日	2021年7月7日	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688239	航宇科技	2021年6月25日	2021年7月5日	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48		-
688317	之江生物	2021年1月8日	2021年7月19日	新股锁定	43.22	63.82	3,731	161,253.82	238,112.42		-
688345	博力威	2021年6月3日	2021年12月13日	新股锁定	25.91	55.53	2,332	60,422.12	129,495.96		-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65		-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股锁定	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00		-
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	新股锁定	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91		-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	新股锁定	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60		-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	新股锁定	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00		-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股锁定	24.60	163.00	503	12,373.80	81,989.00		-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置

不低于 6 个月的限售期。

3. 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或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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	000009	中国宝安	2021年7月6日	18.27	33,000	602,910.00
2	000027	深圳能源	2021年7月6日	9.17	18,000	165,060.00
3	002340	格林美	2021年7月5日	9.35	25,000	233,750.00
4	300207	欣旺达	2021年7月13日	32.56	28,000	911,680.00
5	600446	金证股份	2021年7月1日	14.44	14,000	202,160.00
合计	-	-	-	-	118,000	2,115,560.00

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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本期末，本基金未持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产（上年末：无）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建

立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,401,751.38	-	-	-	5,401,751.38
结算备付金	892,289.00	-	-	-	892,289.00
存出保证金	11,451.36	-	-	-	11,451.36
交易性金融资产	-	-	-	423,420,269.19	423,420,269.19
买入返售金融资产	4,000,000.00	-	-	-	4,000,000.00
应收利息	-	-	-	1,933.74	1,933.74
应收股利	-	-	-	375.00	375.00
应收证券清算款	-	-	-	3,486,079.46	3,486,079.46
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	10,305,491.74	-	-	426,984,273.63	437,289,765.37
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,046.23	53,046.23
应付托管费	-	-	-	17,682.09	17,682.09
应付交易费用	-	-	-	61,787.95	61,787.95
其他负债	-	-	-	354,095.94	354,095.94
负债总计	-	-	-	486,612.21	486,612.21
利率敏感度缺口	10,305,491.74	-	-	426,497,661.42	436,803,153.16
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,642,031.11	-	-	-	2,642,031.11

结算备付金	755,557.33	-	-	-	755,557.33
存出保证金	260,351.45	-	-	-	260,351.45
交易性金融资产	-	-	-	-428,210,807.48	428,210,807.48
应收利息	-	-	-	-701.69	-701.69
应收证券清算款	-	-	-	6,385,755.55	6,385,755.55
资产总计	3,657,939.89	-	-	-434,595,861.34	438,253,801.23
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,442.87	53,442.87
应付托管费	-	-	-	17,814.28	17,814.28
应付交易费用	-	-	-	74,033.76	74,033.76
其他负债	-	-	-	426,870.78	426,870.78
负债总计	-	-	-	572,161.69	572,161.69
利率敏感度缺口	3,657,939.89	-	-	-434,023,699.65	437,681,639.54

注：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：于报告期末，本基金未持有交易性债券(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。

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 2021年6月30日		上年度末 2020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	423,420,269.19	96.94	428,210,807.48	97.84
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	423,420,269.19	96.94	428,210,807.48	97.84

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 (2021年6月30日)	上年度末 (2020年12月31日)	
分析	沪深300指数上升5%	20,386,887.57	22,009,469.12
	沪深300指数下降5%	-20,386,887.57	-22,009,469.12

6.4.14 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	423,420,269.19	96.83
	其中: 股票	423,420,269.19	96.83
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	4,000,000.00	0.91
	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	6,294,040.38	1.44
8	其他各项资产	3,575,455.80	0.82
9	合计	437,289,765.37	100.00

注：本基金本报告期末参与转融通证券出借业务融出证券公允价值为 2,115,560.00，占基金资产净值比例 0.48%。

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	1,330,183.00	0.30
C	制造业	273,462,280.43	62.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,533,006.80	0.58
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	937,101.04	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	8,919,921.48	2.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,438,550.92	1.70
J	金融业	92,157,249.08	21.10
K	房地产业	18,163,029.43	4.16
L	租赁和商务服务业	5,036,655.45	1.15
M	科学研究和技术服务业	5,708,539.00	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	338,004.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,300,688.00	0.53
R	文化、体育和娱乐	-	-

	乐业		
S	综合	2,453,569.65	0.56
	合计	420,778,778.28	96.33

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	5,850.78	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,449,183.80	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.01
F	批发和零售业	46,404.58	0.01
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	36,074.21	0.01
J	金融业	34,721.10	0.01
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	30,864.68	0.01
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	2,641,490.91	0.60

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	601318	中国平安	554,713	35,656,951.64	8.16
2	600036	招商银行	644,732	34,938,027.08	8.00
3	300760	迈瑞医疗	62,256	29,885,992.80	6.84
4	002594	比亚迪	94,373	23,687,623.00	5.42
5	002475	立讯精密	500,511	23,023,506.00	5.27
6	000333	美的集团	256,729	18,322,748.73	4.19
7	000651	格力电器	250,639	13,058,291.90	2.99
8	300014	亿纬锂能	118,044	12,268,312.92	2.81
9	300124	汇川技术	161,199	11,970,637.74	2.74
10	000001	平安银行	505,539	11,435,292.18	2.62
11	000100	TCL 科技	1,436,700	10,990,755.00	2.52
12	000063	中兴通讯	315,955	10,499,184.65	2.40
13	603288	海天味业	65,753	8,478,849.35	1.94
14	000002	万科A	354,600	8,443,026.00	1.93
15	002352	顺丰控股	95,025	6,433,192.50	1.47
16	300601	康泰生物	42,220	6,290,780.00	1.44
17	002709	天赐材料	57,000	6,075,060.00	1.39
18	300454	深信服	21,404	5,553,909.92	1.27
19	688036	传音控股	24,547	5,142,596.50	1.18
20	002027	分众传媒	535,245	5,036,655.45	1.15
21	002340	格林美	489,900	4,580,565.00	1.05
22	600048	保利地产	374,167	4,504,970.68	1.03
23	002841	视源股份	34,650	4,306,648.50	0.99
24	300207	欣旺达	114,552	3,729,813.12	0.85
25	600999	招商证券	193,270	3,675,995.40	0.84
26	300529	健帆生物	41,880	3,616,756.80	0.83
27	002008	大族激光	88,810	3,587,035.90	0.82
28	603160	汇顶科技	23,800	3,085,194.00	0.71
29	300136	信维通信	99,044	3,058,478.72	0.70
30	300037	新宙邦	29,400	2,942,940.00	0.67
31	601238	广汽集团	222,802	2,885,285.90	0.66
32	600183	生益科技	119,406	2,795,294.46	0.64
33	300012	华测检测	87,000	2,773,560.00	0.63
34	002625	光启技术	132,500	2,757,325.00	0.63
35	000066	中国长城	182,650	2,666,690.00	0.61
36	002138	顺络电子	67,000	2,597,590.00	0.59
37	002938	鹏鼎控股	72,084	2,586,373.92	0.59
38	300676	华大基因	21,495	2,549,307.00	0.58
39	300724	捷佳伟创	21,400	2,482,614.00	0.57
40	002920	德赛西威	22,500	2,476,800.00	0.57
41	000009	中国宝安	134,295	2,453,569.65	0.56

42	000776	广发证券	154,102	2,333,104.28	0.53
43	603882	金城医学	14,400	2,300,688.00	0.53
44	002916	深南电路	20,380	2,264,829.40	0.52
45	000636	风华高科	73,400	2,218,148.00	0.51
46	002180	纳思达	66,900	2,154,180.00	0.49
47	002030	达安基因	100,600	2,136,744.00	0.49
48	002456	欧菲光	220,800	1,960,704.00	0.45
49	000513	丽珠集团	38,661	1,933,823.22	0.44
50	601138	工业富联	152,700	1,895,007.00	0.43
51	002465	海格通信	191,716	1,813,633.36	0.42
52	001979	招商蛇口	164,965	1,806,366.75	0.41
53	300482	万孚生物	27,820	1,799,675.80	0.41
54	000050	深天马 A	125,858	1,784,666.44	0.41
55	600380	健康元	122,309	1,679,302.57	0.38
56	002152	广电运通	128,700	1,676,961.00	0.38
57	003816	中国广核	614,800	1,641,516.00	0.38
58	601615	明阳智能	99,893	1,617,267.67	0.37
59	002736	国信证券	150,006	1,612,564.50	0.37
60	688208	道通科技	18,400	1,600,616.00	0.37
61	000069	华侨城 A	213,500	1,588,440.00	0.36
62	300146	汤臣倍健	43,679	1,437,039.10	0.33
63	002294	信立泰	43,500	1,431,150.00	0.33
64	600029	南方航空	230,400	1,387,008.00	0.32
65	002683	宏大爆破	47,900	1,330,183.00	0.30
66	603833	欧派家居	9,361	1,328,887.56	0.30
67	002791	坚朗五金	6,700	1,300,135.00	0.30
68	002797	第一创业	172,100	1,228,794.00	0.28
69	600872	中炬高新	29,090	1,222,361.80	0.28
70	600332	白云山	36,100	1,221,985.00	0.28
71	600383	金地集团	117,600	1,204,224.00	0.28
72	688321	微芯生物	25,200	1,163,988.00	0.27
73	002511	中顺洁柔	34,160	941,108.00	0.22
74	000021	深科技	48,200	922,548.00	0.21
75	600685	中船防务	42,200	877,760.00	0.20
76	600446	金证股份	58,800	849,072.00	0.19
77	002572	索菲亚	33,183	803,028.60	0.18
78	000555	神州信息	50,700	733,629.00	0.17
79	603228	景旺电子	26,705	699,671.00	0.16
80	600004	白云机场	61,461	687,133.98	0.16
81	000027	深圳能源	74,040	678,946.80	0.16
82	603233	大参林	12,264	626,813.04	0.14
83	002399	海普瑞	38,900	619,677.00	0.14

84	002745	木林森	44,800	600,320.00	0.14
85	002429	兆驰股份	94,100	571,187.00	0.13
86	000999	华润三九	20,310	543,292.50	0.12
87	002939	长城证券	48,200	536,466.00	0.12
88	000987	越秀金控	42,300	535,518.00	0.12
89	300832	新产业	8,140	501,424.00	0.11
90	002867	周大生	22,650	447,790.50	0.10
91	002705	新宝股份	16,900	443,625.00	0.10
92	000089	深圳机场	53,100	412,587.00	0.09
93	003035	南网能源	38,800	385,672.00	0.09
94	001914	招商积余	21,900	376,242.00	0.09
95	000967	盈峰环境	49,200	338,004.00	0.08
96	000028	国药一致	8,200	310,288.00	0.07
97	300770	新媒股份	6,200	301,940.00	0.07
98	000031	大悦城	66,600	239,760.00	0.05
99	601139	深圳燃气	32,400	212,544.00	0.05
100	002945	华林证券	14,800	204,536.00	0.05

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	688063	派能科技	3,007	591,777.60	0.14
2	688317	之江生物	3,731	238,112.42	0.05
3	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.03
4	301016	雷尔伟	2,747	115,711.58	0.03
5	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.02
6	300920	润阳科技	2,503	84,301.04	0.02
7	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.02
8	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
9	300919	中伟股份	503	81,989.00	0.02
10	300957	贝泰妮	314	79,115.44	0.02
11	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.01
12	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.01
13	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
14	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
15	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.01
16	300979	华利集团	541	47,337.50	0.01
17	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
18	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
19	300973	立高食品	360	41,655.60	0.01
20	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.01
21	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01

22	300981	中红医疗	348	31,455.72	0.01
23	301009	可靠股份	1,007	29,277.97	0.01
24	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
25	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
26	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
27	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
28	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
29	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
30	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
31	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
32	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
33	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
34	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
35	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
36	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
37	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
38	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
39	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
40	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.00
41	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
42	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
43	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
44	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
45	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
46	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
47	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
48	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
49	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
50	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
51	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
52	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
53	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
54	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
55	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
56	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
57	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
58	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
59	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
60	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
61	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
62	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
63	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
64	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00

65	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
66	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
67	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
68	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
69	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	601318	中国平安	7,109,152.99	1.62
2	002709	天赐材料	5,585,487.00	1.28
3	000100	TCL 科技	4,904,651.00	1.12
4	300760	迈瑞医疗	3,521,567.00	0.80
5	300037	新宙邦	2,774,838.00	0.63
6	300724	捷佳伟创	2,356,947.00	0.54
7	002030	达安基因	2,242,752.00	0.51
8	002456	欧菲光	1,908,422.00	0.44
9	000636	风华高科	1,867,187.00	0.43
10	688208	道通科技	1,585,212.26	0.36
11	601238	广汽集团	1,348,266.00	0.31
12	002475	立讯精密	1,143,029.00	0.26
13	688036	传音控股	1,030,309.01	0.24
14	300601	康泰生物	584,428.00	0.13
15	002340	格林美	546,709.00	0.12
16	601138	工业富联	517,027.00	0.12
17	002920	德赛西威	433,174.00	0.10
18	003035	南网能源	418,956.40	0.10
19	000063	中兴通讯	380,667.00	0.09
20	000333	美的集团	373,752.00	0.09

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	600036	招商银行	3,631,563.00	0.83
2	002600	领益智造	2,565,869.00	0.59
3	002594	比亚迪	2,504,659.00	0.57
4	000333	美的集团	2,354,584.00	0.54
5	000651	格力电器	1,691,524.00	0.39
6	300014	亿纬锂能	1,510,259.00	0.35
7	000001	平安银行	1,450,428.00	0.33

8	300124	汇川技术	1,206,601.00	0.28
9	600728	佳都科技	1,115,675.00	0.25
10	000002	万科A	1,115,615.00	0.25
11	603288	海天味业	908,483.90	0.21
12	002352	顺丰控股	819,505.00	0.19
13	688106	金宏气体	804,872.10	0.18
14	300454	深信服	700,499.00	0.16
15	002027	分众传媒	644,183.00	0.15
16	688131	皓元医药	644,111.46	0.15
17	688696	极米科技	629,059.38	0.14
18	600325	华发股份	616,485.00	0.14
19	002745	木林森	591,414.00	0.14
20	002583	海能达	548,235.00	0.13

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	53,863,001.58
卖出股票收入（成交）总额	59,286,956.92

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：本报告期末本基金未持有债券投资。

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：本报告期末本基金未持有债券投资。

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

7.10.2 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。

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 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.3 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。

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

中国银行保险监督管理委员会于 2021 年 5 月 17 日作出银保监罚决字(2021)16 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司（以下简称“公司”）：为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产；违规协助无衍生产品交易业务资格的银行发行结构性衍生产品；理财产品之间风险隔离不到位等违规经营。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，对公司罚款 7170 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为有效跟踪标的指数，控制跟踪偏离和跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成份股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体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股票库之外的股票。

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	11,451.36
2	应收证券清算款	3,486,079.46
3	应收股利	375.00
4	应收利息	1,933.74
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24

8	其他	-
9	合计	3,575,455.80

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

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	688317	之江生物	238,112.42	0.05	新股锁定
2	688345	博力威	129,495.96	0.03	新股锁定
3	688656	浩欧博	99,534.60	0.02	新股锁定
4	301016	雷尔伟	9,069.50	0.00	新股锁定

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
849	341,563.77	273,161,805.00	94.20	16,825,833.00	5.80

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	安邦人寿保险股份有限公司-保守型投资组合	173,149,075.00	59.71
2	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	100,012,730.00	34.49
3	周旭	1,008,000.00	0.35

4	陶莉	1,000,000.00	0.34
5	邢晓东	848,700.00	0.29
6	钱中明	829,581.00	0.29
7	杨德凤	630,000.00	0.22
8	王静	463,317.00	0.16
9	王喜洁	400,000.00	0.14
10	霍健	349,700.00	0.12

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年9月23日） 基金份额总额	6,009,987,638.00
本报告期期初基金份额总额	292,987,638.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	5,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减 少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	289,987,638.00

§ 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

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

2021年3月2日，王金涛担任平安基金管理有限公司总经理助理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	57,897,857.66	55.01%	41,183.06	55.01%	-
平安证券	2	30,504,114.40	28.98%	21,697.24	28.98%	-
长江证券	1	6,875,296.78	6.53%	4,890.60	6.53%	-
招商证券	3	4,020,610.72	3.82%	2,859.94	3.82%	-
广发证券	2	3,460,566.80	3.29%	2,461.50	3.29%	-
国盛证券	1	2,483,289.82	2.36%	1,766.29	2.36%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	6	-	-	-	-	新增 2个
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-

中信建投 证券	2	-	-	-	-	-
------------	---	---	---	---	---	---

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。其中招商证券的一个席位作为申赎本基金的专用席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	4,000,000.00	0.64%	-	-
平安证券	-	-	428,000,000.00	68.15%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	97,000,000.00	15.45%	-	-
广发证券	-	-	99,000,000.00	15.76%	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
中信建投 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 2020 年 12 月 31 日基金净值公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 01 日
2	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 2020	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日

	年第 4 季度报告		
3	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增第一创业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	2021 年 03 月 26 日
4	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招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 30 日
5	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基金合同	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 30 日
6	平安基金管理有限公司关于公司旗下部分指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 30 日
7	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基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 30 日
8	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 2020 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 03 月 31 日
9	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 2021 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 21 日
10	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基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
11	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招募说明书更新	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 05 月 31 日
12	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金调整风险等级的通知	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 01 日
13	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 24 日
14	平安基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 06 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
--	----------------	------------

投资者类别	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	2021/01/01-- 2021/06/30	173,149,075.00	-	-	173,149,075.00	59.71
	2	2021/01/01-- 2021/06/30	100,012,730.00	-	-	100,012,730.00	34.49
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元，基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》和相关基金基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，平安基金管理有限公司（以下简称“本公司”）对本基金基金合同有关条款进行修订。修订自 2021 年 3 月 30 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 3 月 30 日发布的《平安基金管理有限公司关于公司旗下部分指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

(1) 中国证监会准予平安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募集注册的文件

(2) 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基金合同

(3) 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

2021 年 8 月 31 日