

# 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 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 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 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.4 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	15
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	16
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 .....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	16
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	20
7.4 报表附注 .....	22
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>51</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	51

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	57
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	58
8.7 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 .....	59
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	59
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	59
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	59
8.12 投资组合报告附注 .....	59
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>61</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	61
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	61
9.4 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 .....	61
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	61
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>61</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	62
11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	63
11.8 其他重大事件 .....	64
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>65</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	66
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>66</b>
13.1 备查文件目录 .....	66
13.2 存放地点 .....	66
13.3 查阅方式 .....	66

## § 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	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	286,987,638.00 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
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路5033号平安金融中心34层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2021 年	2020 年	2019 年 9 月 23 日 (基金合同生效日)-2019 年 12 月 31 日
本期已实现收益	33,486,500.58	667,770,608.86	-125,995,494.73
本期利润	-10,117,812.27	456,254,709.99	164,101,340.88
加权平均基金份额本期利润	-0.0349	0.3415	0.0290
本期加权平均净值利润率	-2.39%	31.54%	2.94%
本期基金份额净值增长率	-2.36%	44.18%	3.61%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	131,622,924.34	144,694,001.54	-100,884,195.75

期末可供分配基金份额利润	0.4586	0.4939	-0.0204
期末基金资产净值	418,610,562.34	437,681,639.54	5,120,425,381.38
期末基金份额净值	1.4586	1.4939	1.0361
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	45.86%	49.39%	3.61%

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。

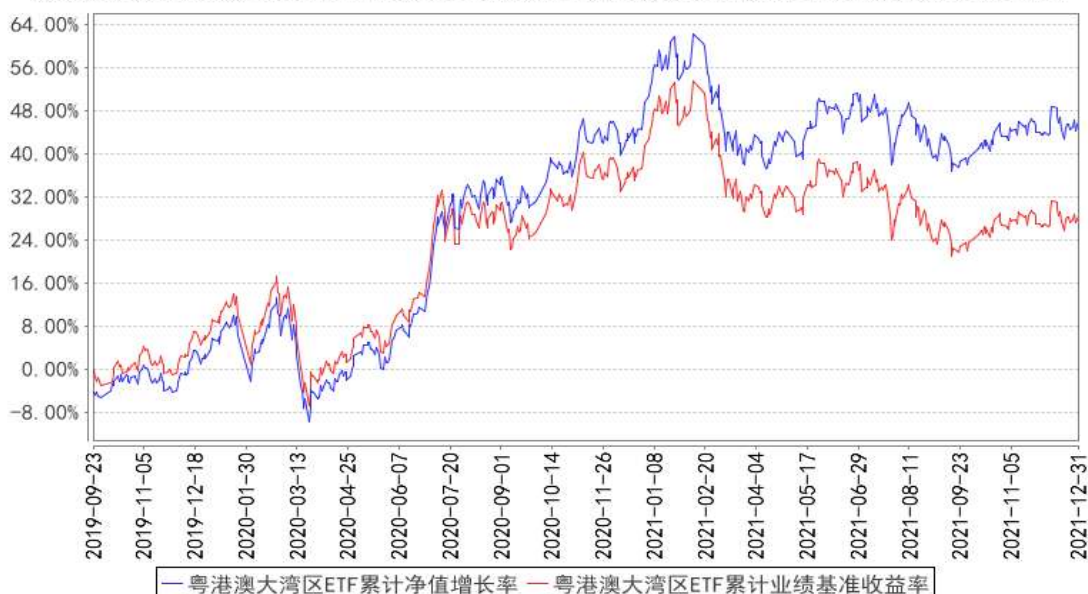
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	4.71%	0.83%	4.13%	0.86%	0.58%	-0.03%
过去六个月	-3.17%	1.08%	-6.64%	1.13%	3.47%	-0.05%
过去一年	-2.36%	1.18%	-9.22%	1.22%	6.86%	-0.04%
自基金合同生效起至今	45.86%	1.33%	28.45%	1.37%	17.41%	-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

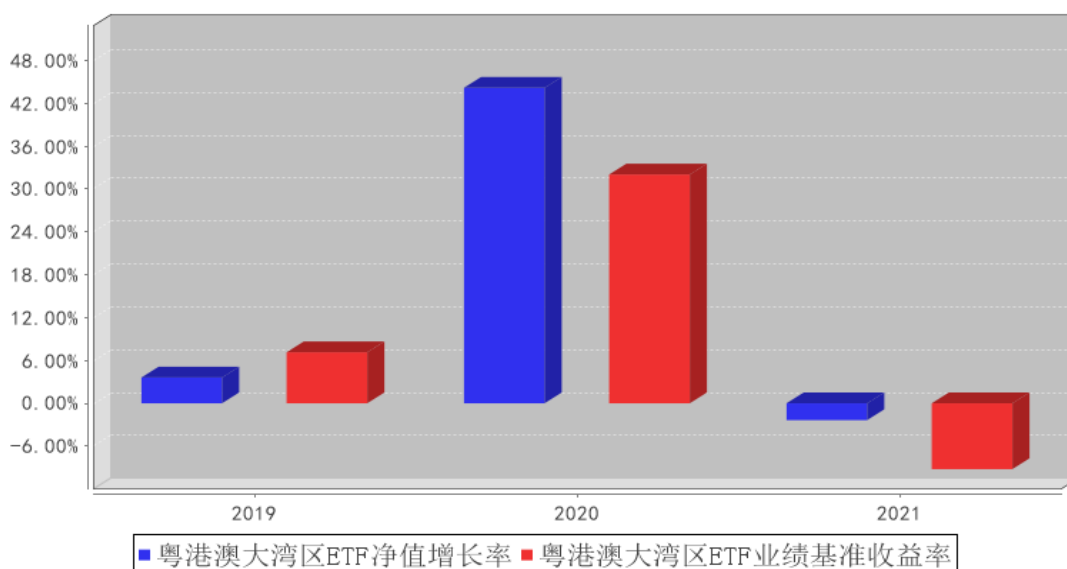


注：1、本基金基金合同于 2019 年 09 月 23 日正式生效；

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。

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

粤港澳大湾区ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：1. 本基金合同于 2019 年 09 月 23 日正式生效。

2. 2019 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金合同于2019年9月23日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于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2021年12月31日，平安基金共管理158只公募基金，公募资产管理总规模约为4,561.10亿元人民币。

#### 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	-	11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、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、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数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	-	8 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、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、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基金经理。
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

					<p>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、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基金经理助理。</p>
王仁增	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	2021年7月8日	-	7年	<p>王仁增先生，南开大学国际经济研究所世界经济硕士，曾任财通基金产品经理、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，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</p>

					<p>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基金经理助理。</p>
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	2021 年 12 月 3 日	4 年	<p>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。曾担任平安沪深 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</p>

					基金基金经理助理。曾担任平安中债-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。
--	--	--	--	--	---

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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控与报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由法律合规监察部、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资

信息的管理及保密制度,不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,完善相应制度及流程,通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行,公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

本基金管理人按日内、3日内、5日内三个不同的时间窗口,对本基金管理人管理的全部投资组合在本报告期内的交易情况进行了同向交易价差分析,各投资组合交易过程中不存在显著的交易价差,不存在不公平交易的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

报告期内,所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未超过该证券当日成交量的5%。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金投资于中证粤港澳大湾区发展主题指数。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0.93%,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1.4586元,本报告期基金份额净值增长率为-2.36%,业绩比较基准收益率为-9.22%。

### 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2022年,外部方面,中美关系虽然仍有一定不确定性,但是边际影响下降。海外资金配置A股的比例仍然还有提升空间,预计外资将继续流入。国内方面,经济增长或面临一定压力,但是在地产政策和融资环境出现边际改善后,经济有望企稳回暖。货币政策方面,预计短期偏向宽松,密切关注后续经济基本面的变化。财政政策方面,预计将维持积极,会更多在减税降费方面发力,降低实体企业经营成本,加大逆周期调节力度。基建方面,预计投资前置效应较为明显,基建增速或前高后低。消费方面,汽车、家电、家具下乡等政策或将逐步落实,大宗消费潜力预计持续复苏,服务消费随着疫情防控常态化和精细化,也有望逐步复苏。综上,我们对2022年权益资产的前景保持谨慎乐观。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续 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合规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 21073 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安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全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了粤港澳大湾区 ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于粤港澳大湾区 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。



强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>粤港澳大湾区 ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估粤港澳大湾区 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算粤港澳大湾区 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督粤港澳大湾区 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对粤港澳大湾区 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致粤港澳大湾区 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p>

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	郭素宏	李崇
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 25 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	4,389,077.06	2,642,031.11
结算备付金		825,633.80	755,557.33
存出保证金		10,661.91	260,351.45
交易性金融资产	7.4.7.2	406,622,332.30	428,210,807.48
其中：股票投资		406,622,332.30	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,116,267.08	6,385,755.55
应收利息	7.4.7.5	-1,095.64	-701.69
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		418,962,876.51	438,253,801.23
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 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	7.4.7.3	-	-
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		53,118.52	53,442.87
应付托管费		17,706.17	17,814.28
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	36,489.48	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	7.4.7.8	245,000.00	426,870.78
负债合计		352,314.17	572,161.69
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	286,987,638.00	292,987,638.00
未分配利润	7.4.7.10	131,622,924.34	144,694,001.54
所有者权益合计		418,610,562.34	437,681,639.54
负债和所有者权益总计		418,962,876.51	438,253,801.23

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4586 元，基金份额总额 286,987,638.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-8,485,736.48	468,155,733.82
1. 利息收入		220,354.57	610,274.14
其中：存款利息收入	7.4.7.11	39,936.06	160,463.53
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		137,140.74	133,425.15
证券出借利息收入		43,277.77	316,385.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		34,908,112.42	660,560,731.12
其中：股票投资收益	7.4.7.12	28,875,620.36	642,762,573.66
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-

收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	6,032,492.06	17,798,157.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-43,604,312.85	-211,515,898.87
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-9,890.62	18,500,627.43
减：二、费用		1,632,075.79	11,901,023.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	634,848.90	2,265,205.16
2. 托管费	7.4.10.2.2	211,616.31	755,068.45
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	305,119.58	8,017,313.67
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	480,491.00	863,436.55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,117,812.27	456,254,709.99
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,117,812.27	456,254,709.99

### 7.3 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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	-10,117,812.27	-10,117,812.27
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-6,000,000.00	-2,953,264.93	-8,953,264.93

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	9,000,000.00	4,068,848.93	13,068,848.93
2. 基金赎回款	-15,000,000.00	-7,022,113.86	-22,022,113.86
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）	286,987,638.00	131,622,924.34	418,610,562.34
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	-	456,254,709.99	456,254,709.99
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）	-4,649,000,000.00	-489,998,451.83	-5,138,998,451.83
其中：1. 基金申购款	145,000,000.00	34,165,021.81	179,165,021.81
2. 基金赎回款	-4,794,000,000.00	-524,163,473.64	-5,318,163,473.64
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）	292,987,638.00	144,694,001.54	437,681,639.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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。

## 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 7.4.4 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。

## 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年度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 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

#### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本

基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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



#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到 1% 以上时，基金管理人可进行收益分配；(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；(3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；(4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(5) 每一基金份额享有同等分配权；(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 14 号—收入》，本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021 年 12 月 31 日	2020 年 12 月 31 日
活期存款	4,389,077.06	2,642,031.11
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	4,389,077.06	2,642,031.11

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	371,645,708.41	406,622,332.30	34,976,623.89
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	371,645,708.41	406,622,332.30	34,976,623.89
项目	上年度末		
	2020 年 12 月 31 日		

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	349,629,870.74	428,210,807.48	78,580,936.74
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	349,629,870.74	428,210,807.48	78,580,936.74

注：于2021年12月31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(2020年12月31日：零)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	487.92	967.00
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	371.50	340.00
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	-2,315.75	-2,125.89
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	355.89	-
其他	4.80	117.20
合计	-1,095.64	-701.69

#### 7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	36,489.48	74,033.76
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	36,489.48	74,033.76

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	210,000.00	220,000.00
应付指数使用费	35,000.00	70,000.00
应退退补款	-	136,870.78
合计	245,000.00	426,870.78

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

## 7.4.7.9 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12月31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	9,000,000.00	9,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-15,000,000.00	-15,000,000.00
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	286,987,638.00	286,987,638.00

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。

## 7.4.7.10 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	33,486,500.58	-43,604,312.85	-10,117,812.27
本期基金份额交易产生的变动数	-3,978,636.79	1,025,371.86	-2,953,264.93

其中：基金申购款	6,222,699.88	-2,153,850.95	4,068,848.93
基金赎回款	-10,201,336.67	3,179,222.81	-7,022,113.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	207,947,216.27	-76,324,291.93	131,622,924.34

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	27,275.07	88,283.85
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	12,158.36	58,853.34
其他	502.63	13,326.34
合计	39,936.06	160,463.53

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	28,876,589.64	640,122,227.27
股票投资收益——赎回差价收入	-969.28	2,640,346.39
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	28,875,620.36	642,762,573.66

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	105,862,854.51	4,120,130,451.74
减：卖出股票成本总额	76,986,264.87	3,480,008,224.47
买卖股票差价收入	28,876,589.64	640,122,227.27

**7.4.7.12.3 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	22,022,113.86	5,318,163,473.64
减：现金支付赎回款总额	15,669,177.86	3,624,349,577.64
减：赎回股票成本总额	6,353,905.28	1,691,173,549.61
赎回差价收入	-969.28	2,640,346.39

**7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票申购差价收入。

**7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益产生的证券出借差价收入。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券买卖差价收入。

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

注：本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。



#### 7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

##### 7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

##### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,032,492.06	17,798,157.46
其中：证券出借权益补偿收入	15,450.46	803,657.74
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,032,492.06	17,798,157.46

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-43,604,312.85	-211,515,898.87
股票投资	-43,604,312.85	-211,515,898.87
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	-43,604,312.85	-211,515,898.87

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（上年度可比期间：零）。

## 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-9,890.62	18,500,627.43
合计	-9,890.62	18,500,627.43

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	305,119.58	8,017,313.67
银行间市场交易费用	-	-
合计	305,119.58	8,017,313.67

## 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	491.00	875.30
指数使用费	140,000.00	457,561.25
其他	170,000.00	205,000.00
合计	480,491.00	863,436.55

## 7.4.7.21 分部报告

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

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司(“平安证券”)	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
平安证券	75,800,870.98	39.80	835,950,197.59	17.58

##### 7.4.10.1.2 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。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31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	1,335,000,000.00	86.97	10,000,000.00	0.72
------	------------------	-------	---------------	------

#### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	53,917.61	39.80	17,555.19	48.11
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	594,612.45	17.58	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	634,848.90	2,265,205.16
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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	211,616.31	755,068.45

注：支付基金托管行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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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。

##### 7.4.10.5.2 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12月31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	34.8491	100,012,730.00	34.1355

#### 7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期	4,389,077.06	27,275.07	2,642,031.11	88,283.85

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

## 7.4.10.7 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12月31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	301039	中集车辆	公开发行	19,504	135,747.84
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12月31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
-	-	-	-	-	-

## 7.4.10.8 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平安集团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12月31日，本基金持有502,839股平安银行的A股普通股，成本总额为人民币8,056,330.48元，估值总额为人民币8,286,786.72元，占基金资产净值的比例为1.98%（2020年12月31日：数量：557,639股；成本：8,785,394.60元；市值10,784,738.26元，占比2.46%）。

(2) 于2021年12月31日，本基金持有561,413股中国平安的A股普通股，成本总额为人民币44,481,514.34元，估值总额为人民币28,300,829.33元，占基金资产净值的比例为6.76%（2020年12月31日：数量：459,313股；成本：38,503,376.99元；市值39,951,044.74元，占比9.13%）。

## 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末(2021年12月31日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	可流通	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注

代码	名称	认购日	日	限类型	价格	值单价	(单 位: 股)	成本总额	额	
300774	倍杰特	2021年 7月26 日	2022年 02月 16日	新股锁 定	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
300814	中富 电路	2021年 8月4 日	2022年 2月14 日	新股锁 定	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
300994	久祺 股份	2021年 8月2 日	2022年 2月14 日	新股锁 定	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301018	申菱 环境	2021年 6月28 日	2022年 1月7 日	新股锁 定	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301020	密封 科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301021	英诺 激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301026	浩通 科技	2021年 7月8 日	2022年 1月17 日	新股锁 定	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301027	华蓝 集团	2021年 7月8 日	2022年 01月 19日	新股锁 定	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-
301028	东亚 机械	2021年 7月12 日	2022年 1月20 日	新股锁 定	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301029	怡合 达	2021年 7月14 日	2022年 1月24 日	新股锁 定	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301033	迈普 医学	2021年 7月15 日	2022年 1月26 日	新股锁 定	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301035	润丰 股份	2021年 7月21 日	2022年 1月28 日	新股锁 定	22.04	56.28	542	11,945.68	30,503.76	-
301036	双乐 股份	2021年 7月21 日	2022年 02月 16日	新股锁 定	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301037	保立 佳	2021年 7月21 日	2022年 2月7 日	新股锁 定	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-

301038	深水规院	2021年 7月22 日	2022年 2月7 日	新股锁 定	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301039	中集车辆	2021年 7月1 日	2022年 1月10 日	新股锁 定	6.96	12.51	1,951	13,578.96	24,407.01	-
301040	中环海陆	2021年 7月26 日	2022年 2月7 日	新股锁 定	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301041	金百泽	2021年 8月2 日	2022年 2月11 日	新股锁 定	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301045	天禄科技	2021年 8月6 日	2022年 02月 17日	新股锁 定	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
301046	能辉科技	2021年 8月10 日	2022年 2月17 日	新股锁 定	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-
301048	金鹰重工	2021年 8月11 日	2022年 02月 28日	新股锁 定	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301053	远信工业	2021年 8月25 日	2022年 3月1 日	新股锁 定	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301056	森赫股份	2021年 8月27 日	2022年 3月7 日	新股锁 定	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301057	汇隆新材	2021年 8月31 日	2022年 3月9 日	新股锁 定	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301058	中粮工科	2021年 9月1 日	2022年 3月9 日	新股锁 定	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301059	金三江	2021年 9月3 日	2022年 3月14 日	新股锁 定	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301060	兰卫医学	2021年 9月6 日	2022年 3月14 日	新股锁 定	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301062	上海艾录	2021年 9月7 日	2022年 3月14 日	新股锁 定	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301063	海锅股份	2021年 9月9 日	2022年 3月24 日	新股锁 定	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-



		日	日							
301068	大地海洋	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁 定	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301069	凯盛新材	2021年 9月16 日	2022年 3月28 日	新股锁 定	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301072	中捷精工	2021年 9月22 日	2022年 3月29 日	新股锁 定	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
301073	君亭酒店	2021年 9月22 日	2022年 3月30 日	新股锁 定	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301078	孩子王	2021年 9月30 日	2022年 4月14 日	新股锁 定	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301079	邵阳液压	2021年 10月11 日	2022年 4月19 日	新股锁 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
301081	严牌股份	2021年 10月13 日	2022年 4月20 日	新股锁 定	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301082	久盛电气	2021年 10月14 日	2022年 4月27 日	新股锁 定	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
301083	百胜智能	2021年 10月13 日	2022年 4月21 日	新股锁 定	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
301087	可孚医疗	2021年 10月15 日	2022年 4月25 日	新股锁 定	93.09	75.34	229	21,317.61	17,252.86	-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301090	华润材料	2021年 10月19 日	2022年 4月26 日	新股锁 定	10.45	11.22	1,489	15,560.05	16,706.58	-
301092	争光股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定	36.31	35.52	274	9,948.94	9,732.48	-
301093	华兰股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定	58.08	49.85	221	12,835.68	11,016.85	-
301096	百诚	2021年	2022年	新股锁	79.60	78.53	133	10,586.80	10,444.49	-

	医药	12月13日	6月20日	定							
301100	风光股份	2021年12月10日	2022年6月17日	新股锁定	27.81	31.14	446	12,403.26	13,888.44		-
301101	明月镜片	2021年12月9日	2022年6月16日	新股锁定	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56		-
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72		-
301127	天源环保	2021年12月23日	2022年6月30日	新股锁定	12.03	17.12	1,526	18,357.78	26,125.12		-
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股锁定	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70		-
301136	招标股份	2021年12月31日	2022年01月11日	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44		-
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股锁定	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64		-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	86.06	94.50	156	13,425.36	14,742.00		-
301168	通灵股份	2021年12月2日	2022年6月10日	新股锁定	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77		-
301177	迪阿股份	2021年12月8日	2022年6月15日	新股锁定	116.88	116.08	212	24,778.56	24,608.96		-
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股锁定	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48		-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定	66.18	56.62	251	16,611.18	14,211.62		-
301190	善水科技	2021年12月17日	2022年6月24日	新股锁定	27.85	27.46	412	11,474.20	11,313.52		-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股锁定	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40		-

301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股锁定	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股锁定	69.89	88.72	220	15,375.80	19,518.40	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年01月07日	新股未上市	22.98	22.98	14,201	326,338.98	326,338.98	-
688501	青达环保	2021年7月9日	2022年1月17日	新股锁定	10.57	21.11	1,759	18,592.63	37,132.49	-
688737	中自科技	2021年10月14日	2022年4月22日	新股锁定	70.90	55.06	1,700	120,530.00	93,602.00	-
688766	普冉股份	2021年8月12日	2022年2月23日	新股锁定	148.90	342.73	686	102,145.40	235,112.78	-

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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021年12月20日	重大事项停牌	30.12	2022年1月4日	31.00	47,300	1,648,770.06	1,424,676.00	-

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### 7.4.12.4 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	000027	深圳能源	2022年1月5日	8.10	18,000	145,800.00
2	002429	兆驰股份	2022年1月14日	4.86	21,000	102,060.00
3	601238	广汽集团	2022年1月5日-2022年1月19日	15.19	30,000	455,700.00
4	601615	明阳智能	2022年1月24日	26.10	19,000	495,900.00
合计	-	-	-	-	88,000	1,199,460.00

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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（上年末：同）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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组合持仓集中度指标、流通受限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公司的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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	4,389,077.06	-	-	-	4,389,077.06
结算备付金	825,633.80	-	-	-	825,633.80
存出保证金	10,661.91	-	-	-	10,661.91
交易性金融资产	-	-	-	-406,622,332.30	406,622,332.30
应收利息	-	-	-	-1,095.64	-1,095.64
应收证券清算款	-	-	-	7,116,267.08	7,116,267.08
资产总计	5,225,372.77	-	-	-413,737,503.74	418,962,876.51
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,118.52	53,118.52
应付托管费	-	-	-	17,706.17	17,706.17
应付交易费用	-	-	-	36,489.48	36,489.48
其他负债	-	-	-	245,000.00	245,000.00
负债总计	-	-	-	352,314.17	352,314.17
利率敏感度缺口	5,225,372.77	-	-	-413,385,189.57	418,610,562.34
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，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

## 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金未持有债券资产(上年末：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(上年末：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	406,622,332.30	97.14	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	406,622,332.30	97.14	428,210,807.48	97.84

##### 7.4.13.4.3.2 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12月31日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	沪深300指数上升5%	19,983,128.17	22,009,469.12
	沪深300指数下降5%	-19,983,128.17	-22,009,469.12



#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 403,677,929.63 元，属于第二层次的余额为 1,826,464.42 元，属于第三层次的余额为 1,117,938.25 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 426,662,494.17 元，第二层次 1,548,313.31 元，无第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

交易性金融资产

——权益工具投资

2021 年 1 月 1 日 -

购买 1,217,405.94

兑付 -

出售 -

转入第三层级 -

转出第三层级 -571,509.10

当期利得或损失总额 472,041.41

计入损益的利得或损失 472,041.41

2021 年 12 月 31 日 1,117,938.25

2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益 472,041.41

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层级的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为 1,159,458.19 元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 基金申购款

于 2021 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 13,068,848.93 元(2020 年度：179,165,021.81 元)，其中包括以股票支付的申购款 3,704,755.00 元和以现金支付的申购款 9,364,093.93 元(2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 52,212,721.00 元和以现金支付的申购款 126,952,300.81 元)。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(4) 除公允价值、基金申购款和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	406,622,332.30	97.05
	其中：股票	406,622,332.30	97.05
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	5,214,710.86	1.24
8	其他各项资产	7,125,833.35	1.70
9	合计	418,962,876.51	100.00

注：1. 投资组合报表中股票投资市值与按行业分类股票投资组合报表中股票总市值之间的差异是由于可退替代款估值增值引起的。

2. 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 1,199,460.00 元，占基金资产净值比例 0.29%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	1,424,676.00	0.34
C	制造业	272,119,636.95	65.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,009,346.00	0.72
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	697,510.04	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	9,948,367.66	2.38
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,126,364.00	0.99
J	金融业	79,299,304.83	18.94
K	房地产业	18,444,972.31	4.41
L	租赁和商务服务业	4,314,041.55	1.03
M	科学研究和技术服务业	4,920,937.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	356,238.00	0.09
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,218,593.00	0.77
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	1,943,648.85	0.46
	合计	403,823,636.19	96.47

### 8.2.2 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	2,346,027.66	0.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	192,934.80	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	31,748.88	0.01
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	135,524.75	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	35,484.64	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	18,161.78	0.00

R	文化、体育和娱乐业	29,491.80	0.01
S	综合	-	-
	合计	2,798,696.11	0.67

### 8.2.3 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	641,432	31,244,152.72	7.46
2	601318	中国平安	561,413	28,300,829.33	6.76
3	002594	比亚迪	93,973	25,196,040.76	6.02
4	002475	立讯精密	511,411	25,161,421.20	6.01
5	300760	迈瑞医疗	50,356	19,175,564.80	4.58
6	000333	美的集团	253,329	18,698,213.49	4.47
7	300014	亿纬锂能	117,444	13,879,531.92	3.32
8	300124	汇川技术	190,499	13,068,231.40	3.12
9	000063	中兴通讯	329,555	11,040,092.50	2.64
10	000651	格力电器	245,139	9,077,497.17	2.17
11	000100	TCL 科技	1,454,000	8,971,180.00	2.14
12	000001	平安银行	502,839	8,286,786.72	1.98
13	002352	顺丰控股	102,025	7,031,563.00	1.68
14	000002	万科 A	352,800	6,971,328.00	1.67
15	603288	海天味业	65,453	6,879,764.83	1.64
16	002709	天赐材料	59,600	6,833,140.00	1.63
17	600048	保利发展	372,267	5,818,533.21	1.39
18	300207	欣旺达	125,152	5,276,408.32	1.26
19	002340	格林美	495,800	5,131,530.00	1.23
20	002008	大族激光	88,710	4,790,340.00	1.14
21	002027	分众传媒	526,745	4,314,041.55	1.03
22	601615	明阳智能	162,793	4,248,897.30	1.02
23	300601	康泰生物	42,920	4,229,336.80	1.01
24	300454	深信服	21,604	4,126,364.00	0.99
25	002920	德赛西威	28,600	4,047,186.00	0.97
26	688036	传音控股	25,047	3,929,874.30	0.94
27	000776	广发证券	153,302	3,769,696.18	0.90
28	601238	广汽集团	227,202	3,451,198.38	0.82
29	600499	科达制造	137,700	3,417,714.00	0.82
30	600999	招商证券	192,270	3,393,565.50	0.81

31	300037	新宙邦	29,800	3,367,400.00	0.80
32	002625	光启技术	134,900	3,238,949.00	0.77
33	603882	金域医学	28,900	3,218,593.00	0.77
34	002180	纳思达	65,400	3,123,504.00	0.75
35	002938	鹏鼎控股	72,184	3,062,767.12	0.73
36	600183	生益科技	119,606	2,816,721.30	0.67
37	002841	视源股份	34,550	2,812,370.00	0.67
38	300529	健帆生物	50,080	2,669,264.00	0.64
39	000066	中国长城	183,550	2,599,068.00	0.62
40	603160	汇顶科技	23,900	2,575,703.00	0.62
41	002138	顺络电子	67,400	2,573,332.00	0.61
42	300136	信维通信	101,044	2,558,434.08	0.61
43	002916	深南电路	20,380	2,482,691.60	0.59
44	300724	捷佳伟创	21,700	2,480,310.00	0.59
45	601138	工业富联	206,000	2,455,520.00	0.59
46	300012	华测检测	87,300	2,345,751.00	0.56
47	300676	华大基因	25,695	2,256,021.00	0.54
48	688208	道通科技	28,295	2,246,623.00	0.54
49	000636	风华高科	74,800	2,229,040.00	0.53
50	001979	招商蛇口	165,165	2,203,301.10	0.53
51	002465	海格通信	192,316	2,100,090.72	0.50
52	002030	达安基因	102,400	2,054,144.00	0.49
53	002456	欧菲光	204,300	1,981,710.00	0.47
54	000009	中国宝安	134,695	1,943,648.85	0.46
55	003816	中国广核	613,300	1,919,629.00	0.46
56	600029	南方航空	264,100	1,798,521.00	0.43
57	002736	国信证券	150,006	1,722,068.88	0.41
58	000050	深天马 A	127,858	1,664,711.16	0.40
59	000513	丽珠集团	38,661	1,554,558.81	0.37
60	002152	广电运通	128,900	1,533,910.00	0.37
61	600383	金地集团	117,000	1,517,490.00	0.36
62	000069	华侨城 A	212,600	1,496,704.00	0.36
63	300832	新产业	32,940	1,451,007.00	0.35
64	002683	广东宏大	47,300	1,424,676.00	0.34
65	603833	欧派家居	9,561	1,410,247.50	0.34
66	300482	万孚生物	32,620	1,284,575.60	0.31
67	002797	第一创业	174,500	1,277,340.00	0.31
68	600380	健康元	99,309	1,275,127.56	0.30
69	600332	白云山	37,200	1,272,240.00	0.30
70	002294	信立泰	46,200	1,262,184.00	0.30
71	002791	坚朗五金	6,700	1,216,653.00	0.29
72	300146	汤臣倍健	44,779	1,207,241.84	0.29

73	000039	中集集团	64,000	1,098,240.00	0.26
74	600872	中炬高新	28,790	1,093,156.30	0.26
75	600685	中船防务	43,200	1,007,856.00	0.24
76	603228	景旺电子	26,405	911,764.65	0.22
77	000027	深圳能源	99,540	806,274.00	0.19
78	000021	深科技	49,400	782,496.00	0.19
79	600004	白云机场	60,861	733,983.66	0.18
80	002572	索菲亚	32,883	730,002.60	0.17
81	002745	木林森	46,700	706,571.00	0.17
82	603233	大参林	16,564	697,510.04	0.17
83	002511	中顺洁柔	41,060	686,112.60	0.16
84	000999	华润三九	20,010	685,142.40	0.16
85	002399	海普瑞	38,600	660,060.00	0.16
86	002939	长城证券	47,600	616,420.00	0.15
87	000987	越秀金控	56,365	490,375.50	0.12
88	002429	兆驰股份	93,200	452,952.00	0.11
89	001914	招商积余	21,600	437,616.00	0.10
90	002705	新宝股份	16,600	410,020.00	0.10
91	002867	周大生	22,350	397,383.00	0.09
92	000089	深圳机场	52,500	384,300.00	0.09
93	300979	华利集团	4,300	382,915.00	0.09
94	300888	稳健医疗	4,400	362,780.00	0.09
95	000967	盈峰环境	48,600	356,238.00	0.09
96	301029	怡合达	3,762	345,515.94	0.08
97	300973	立高食品	2,600	343,408.00	0.08
98	003035	南网能源	38,500	319,165.00	0.08
99	601139	深圳燃气	32,100	283,443.00	0.07
100	002945	华林证券	14,500	198,070.00	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688063	派能科技	3,007	592,379.00	0.14
2	688176	亚虹医药	14,201	326,338.98	0.08
3	688766	普冉股份	686	235,112.78	0.06
4	688317	之江生物	3,731	192,668.84	0.05
5	301166	优宁维	1,558	159,148.00	0.04
6	688345	博力威	2,332	138,987.20	0.03
7	688737	中自科技	1,700	93,602.00	0.02
8	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.02
9	688607	康众医疗	1,890	71,801.10	0.02
10	688685	迈信林	2,612	71,307.60	0.02

11	688655	迅捷兴	3,083	56,357.24	0.01
12	688501	青达环保	1,759	37,132.49	0.01
13	301035	润丰股份	542	30,503.76	0.01
14	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.01
15	301127	天源环保	1,526	26,125.12	0.01
16	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.01
17	301177	迪阿股份	212	24,608.96	0.01
18	301039	中集车辆	1,951	24,407.01	0.01
19	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.01
20	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
21	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
22	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
23	301221	光庭信息	220	19,518.40	0.00
24	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
25	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
26	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
27	301087	可孚医疗	229	17,252.86	0.00
28	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
29	301090	华润材料	1,489	16,706.58	0.00
30	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
31	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
32	301189	奥尼电子	251	14,211.62	0.00
33	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
34	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
35	301100	风光股份	446	13,888.44	0.00
36	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
37	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
38	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
39	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
40	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
41	301190	善水科技	412	11,313.52	0.00
42	301093	华兰股份	221	11,016.85	0.00
43	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
44	301096	百诚医药	133	10,444.49	0.00
45	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
46	301092	争光股份	274	9,732.48	0.00
47	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
48	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
49	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
50	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
51	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
52	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00



53	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
54	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
55	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
56	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
57	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
58	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
59	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
60	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
61	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
62	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
63	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
64	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
65	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
66	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
67	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
68	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
69	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
70	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
71	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
72	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	8,416,850.99	1.92
2	002709	天赐材料	6,370,947.00	1.46
3	000100	TCL 科技	5,584,492.00	1.28
4	300760	迈瑞医疗	4,922,596.00	1.12
5	600499	科达制造	3,460,467.00	0.79
6	300037	新宙邦	2,992,946.00	0.68
7	300124	汇川技术	2,934,393.75	0.67
8	002475	立讯精密	2,688,445.81	0.61
9	300724	捷佳伟创	2,645,466.00	0.60
10	002030	达安基因	2,379,429.00	0.54
11	688208	道通科技	2,330,135.14	0.53
12	601615	明阳智能	2,076,137.00	0.47
13	000636	风华高科	2,019,160.00	0.46
14	002456	欧菲光	2,017,867.00	0.46
15	002594	比亚迪	1,732,357.00	0.40
16	603882	金域医学	1,636,718.00	0.37
17	601238	广汽集团	1,500,695.00	0.34

18	000063	中兴通讯	1,451,659.00	0.33
19	002920	德赛西威	1,384,158.00	0.32
20	000333	美的集团	1,321,691.00	0.30

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	6,517,845.50	1.49
2	600036	招商银行	4,400,442.00	1.01
3	002594	比亚迪	3,990,460.00	0.91
4	000333	美的集团	3,557,448.00	0.81
5	002600	领益智造	2,565,869.00	0.59
6	000651	格力电器	2,434,443.00	0.56
7	300014	亿纬锂能	2,284,072.00	0.52
8	000001	平安银行	1,999,313.00	0.46
9	300124	汇川技术	1,857,007.00	0.42
10	002475	立讯精密	1,641,997.00	0.38
11	000002	万科 A	1,520,090.00	0.35
12	600728	佳都科技	1,115,675.00	0.25
13	603288	海天味业	1,085,264.90	0.25
14	300454	深信服	1,025,575.00	0.23
15	600446	金证股份	945,453.00	0.22
16	688321	微芯生物	939,929.77	0.21
17	002027	分众传媒	913,265.00	0.21
18	002352	顺丰控股	911,296.00	0.21
19	000063	中兴通讯	832,388.78	0.19
20	688106	金宏气体	804,872.10	0.18

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	101,651,252.82
卖出股票收入（成交）总额	105,862,854.51

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。

#### 8.5 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。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

## 8.7 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。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持权证投资。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

因公司披露的公告中出现应注销的股票期权总数量、激励对象可行权的股票期权数量等数据不准确，导致在办理相关期权注销及登记业务时出现错误，违反《股票上市规则》，深圳证券交易所于 2021 年 12 月 28 日给予《关于对立讯精密工业股份有限公司的监管函》。

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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,661.91
2	应收证券清算款	7,116,267.08
3	应收股利	-
4	应收利息	-1,095.64
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,125,833.35

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注:基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688176	亚虹医药	326,338.98	0.08	新股未上市
2	688766	普冉股份	235,112.78	0.06	新股锁定
3	301166	优宁维	14,742.00	0.00	新股锁定

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因,分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
727	394,756.04	273,161,805.00	95.18	13,825,833.00	4.82

### 9.2 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	60.33
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	34.85
3	周旭	1,008,000.00	0.35
4	陶莉	1,000,000.00	0.35
5	邢晓东	853,000.00	0.30
6	杨德凤	630,000.00	0.22
7	钱中明	603,000.00	0.21
8	王静	455,217.00	0.16
9	王喜洁	400,000.00	0.14
10	霍健	349,700.00	0.12

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

### 9.4 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

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 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)	6,009,987,638.00
----------------------	------------------

基金份额总额	
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	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	15,000,000.00
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	286,987,638.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1. 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。
2. 公司监事巢傲文先生因工作调动，经公司2021年12月17日召开的2021年第四次股东会审议，不再出任公司第四届监事会监事，并由许黎女士接替巢傲文先生任职公司的监事。
3. 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务3年。报告期内应支付给该事务所的报酬为50,000.00元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中泰证券	2	97,791,910.94	51.35%	69,559.85	51.35%	-
平安证券	2	75,800,870.98	39.80%	53,917.61	39.80%	-
长江证券	1	6,875,296.78	3.61%	4,890.60	3.61%	-
招商证券	3	4,020,610.72	2.11%	2,859.94	2.11%	-
广发证券	2	3,460,566.80	1.82%	2,461.50	1.82%	-
国盛证券	1	2,483,289.82	1.30%	1,766.29	1.30%	-
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中泰证券	-	-	4,000,000.00	0.26%	-	-

平安证券	-	-	1,335,000,000.00	86.97%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	97,000,000.00	6.32%	-	-
广发证券	-	-	99,000,000.00	6.45%	-	-
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	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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 年 第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 01 月 22 日
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
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
6	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
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
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	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 04 月 21 日



	第 1 季度报告		
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
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
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
15	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 07 月 02 日
16	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 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 07 月 20 日
17	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	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 08 月 31 日
18	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富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 09 月 17 日
19	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 3 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 10 月 26 日
20	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增开源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 12 月 20 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	2021/01/01--2021/12/31	173,149,075.00	-	-	173,149,075.00	60.33

	2	2021/01/01-- 2021/12/31	100,012,730. 00	-	-	100,012,730.00	34.85
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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

## 12.2 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》。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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

### 13.3 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: 4008004800 (免长途话费)

平安基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日