

# 平安中证 500 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：平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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 .....	14
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>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	15
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 .....	21
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>66</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	66
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	67

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 .....	68
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	82
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	84
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 .....	84
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 .....	84
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 .....	84
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 .....	84
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	84
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	84
8.12 投资组合报告附注 .....	85
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>86</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	86
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	86
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	87
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 .....	87
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 .....	87
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>87</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>88</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	88
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 .....	88
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	88
11.4 基金投资策略的改变 .....	88
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	88
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 .....	88
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	88
11.8 其他重大事件 .....	91
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>93</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 .....	93
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	93
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>94</b>
13.1 备查文件目录 .....	94
13.2 存放地点 .....	94
13.3 查阅方式 .....	94



## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安中证 500ETF
场内简称	平安中证 500ETF
基金主代码	510590
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 3 月 23 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	175,586,121.00 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	2018 年 5 月 4 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 500 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	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	李帅帅
	联系电话	0755-22626828	0755-25878287
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	LISHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95511-3
传真		0755-23997878	0755-82080387

注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	广东省深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	518048	518001
法定代表人	罗春风	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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
本期已实现收益	295,897,255.40	440,568,133.27	-46,519,783.00
本期利润	229,486,834.33	554,940,768.00	464,478,371.25
加权平均基金份额本期利润	1.2586	1.5827	1.0961
本期加权平均净值利润率	17.28%	25.87%	21.50%
本期基金份额净值增长率	19.00%	26.14%	27.31%
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	245,983,494.81	194,198,922.28	-283,708,094.90

期末可供分配基金份额利润	1.4009	0.6810	-0.6255
期末基金资产净值	1,298,292,086.48	1,948,846,645.07	2,457,354,225.41
期末基金份额净值	7.3940	6.8336	5.4176
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	35.68%	14.02%	-9.60%

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。

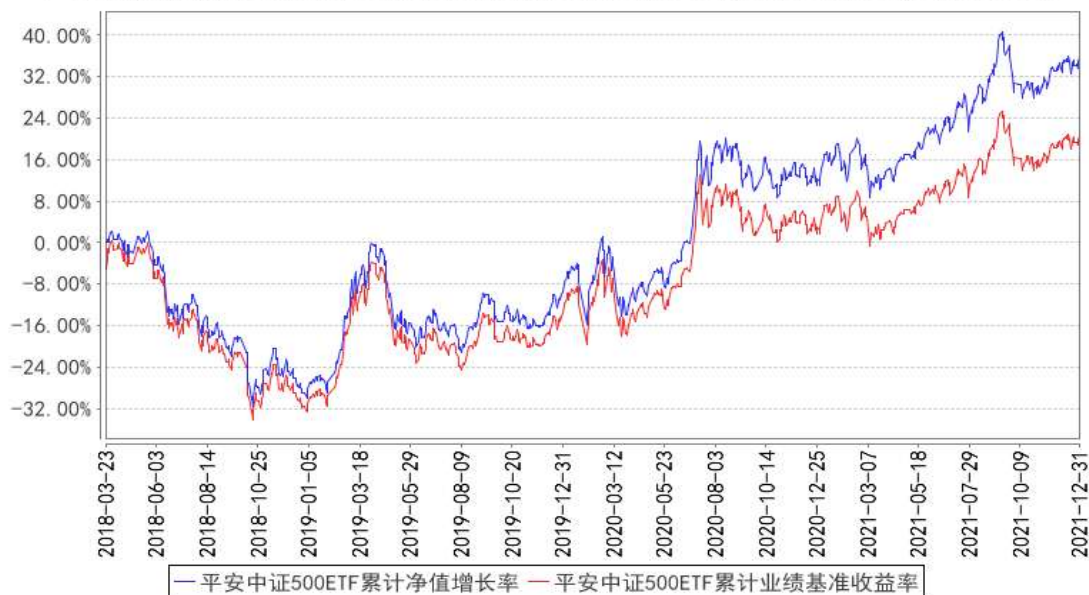
## 3.2 基金净值表现

### 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	3.82%	0.76%	3.60%	0.76%	0.22%	0.00%
过去六个月	9.44%	0.95%	8.10%	0.96%	1.34%	-0.01%
过去一年	19.00%	0.97%	15.58%	0.97%	3.42%	0.00%
过去三年	91.09%	1.37%	76.57%	1.38%	14.52%	-0.01%
自基金合同生效起至今	35.68%	1.40%	20.62%	1.42%	15.06%	-0.02%

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

平安中证500ETF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

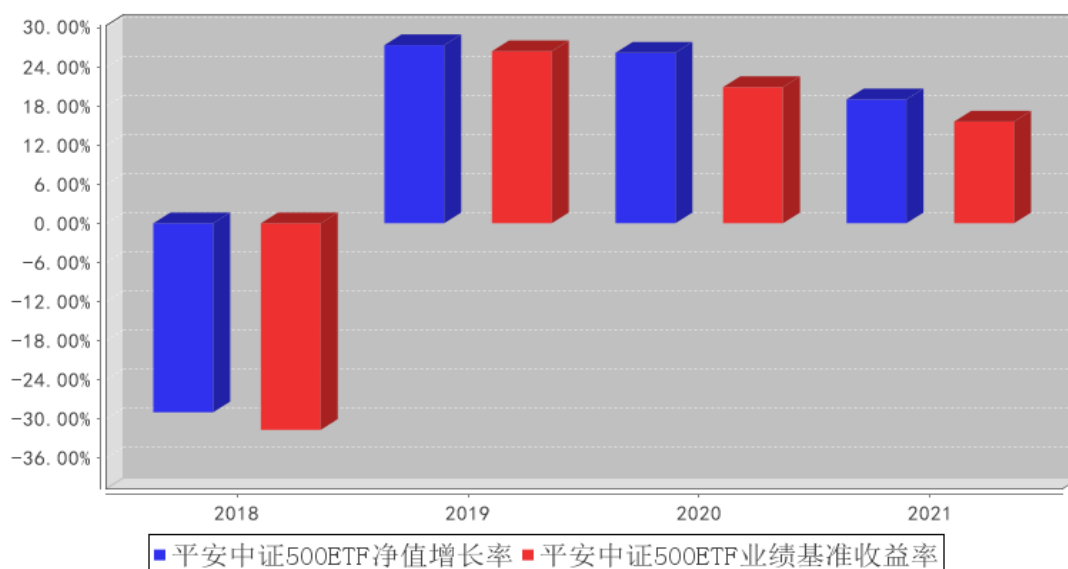


注：1、本基金基金合同于 2018 年 03 月 23 日正式生效；

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基金合同约定。

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

平安中证500ETF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 2018 年 03 月 23 日正式生效。

2. 2018 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

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	7.0000	118,990,284.70	-	118,990,284.70	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	-	-	-	-	-
合计	7.0000	118,990,284.70	-	118,990,284.70	-

## § 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（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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2018 年 3 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。
王宁	平安中证 500 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、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。
王仁增	平安中证 500 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	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。
董俊玲	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2019 年 7 月 22 日	2021 年 12 月 3 日	4 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。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 500 指数。在投资管理上，继续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 0.02%，年化跟踪误差 0.49%，较好地实现了本基金的投资目标。

##### 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 7.3940 元，本报告期基金份额净值增长率为 19.00%，业绩比较基准收益率为 15.58%。

#### 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

报告期内本基金进行了 1 次利润分配，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遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地

履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

# § 6 审计报告

## 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第 21062 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 500 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，公允反映了平安中证 500ETF 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，我们独立于平安中证 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	平安中证 500ETF 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

	<p>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平安中证 500ETF 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平安中证 500ETF 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平安中证 500ETF 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，就可能对平安中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安中证 500ETF 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> <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。</p>
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 500 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	7,721,423.23	9,004,813.91
结算备付金		4,146,811.76	5,357,455.28
存出保证金		6,245,026.74	9,359,405.11
交易性金融资产	7.4.7.2	1,261,603,631.98	1,895,019,341.51
其中：股票投资		1,261,603,631.98	1,895,019,341.51
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	15,000,000.00	25,000,000.00
应收证券清算款		5,119,023.26	6,998,429.17
应收利息	7.4.7.5	31,291.05	128,223.81
应收股利		3,400.00	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,299,870,608.02	1,950,867,668.79
<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		531,770.56	797,388.06
应付托管费		106,354.11	159,477.62
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	458,578.90	519,188.27
应交税费		57,542.34	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	424,275.63	544,969.77
负债合计		1,578,521.54	2,021,023.72
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,052,308,591.67	1,709,154,480.32
未分配利润	7.4.7.10	245,983,494.81	239,692,164.75
所有者权益合计		1,298,292,086.48	1,948,846,645.07
负债和所有者权益总计		1,299,870,608.02	1,950,867,668.79

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 7.3940 元，基金份额总额 175,586,121.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安中证 500 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		241,058,667.40	573,844,930.91
1. 利息收入		3,977,062.41	6,624,243.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	390,703.23	387,861.89
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		243,785.43	394,569.07
证券出借利息收入		3,342,573.75	5,841,812.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		302,978,959.72	449,675,062.73
其中：股票投资收益	7.4.7.12	276,156,704.14	410,817,186.80
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	9,756,815.52	13,742,195.39
股利收益	7.4.7.16	17,065,440.06	25,115,680.54
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-66,410,421.07	114,372,634.73
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	513,066.34	3,172,989.53
减: 二、费用		11,571,833.07	18,904,162.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	6,641,045.83	10,737,360.48
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,328,209.22	2,147,472.19
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,748,990.63	4,925,586.74
5. 利息支出		-	-
其中: 卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		35,124.53	49,501.87
7. 其他费用	7.4.7.20	818,462.86	1,044,241.63
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		229,486,834.33	554,940,768.00
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		229,486,834.33	554,940,768.00

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 平安中证 500 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)	1,709,154,480.32	239,692,164.75	1,948,846,645.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	229,486,834.33	229,486,834.33
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)	-656,845,888.65	-104,205,219.57	-761,051,108.22
其中: 1. 基金申购款	227,738,538.00	42,041,062.60	269,779,600.60
2. 基金赎回款	-884,584,426.65	-146,246,282.17	-1,030,830,708.82
四、本期向基金份额持有人分配	-	-118,990,284.70	-118,990,284.70



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）	1,052,308,591.67	245,983,494.81	1,298,292,086.48
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）	2,718,395,790.33	-261,041,564.92	2,457,354,225.41
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	554,940,768.00	554,940,768.00
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）	-1,009,241,310.01	-54,207,038.33	-1,063,448,348.34
其中：1. 基金申购款	1,138,692,690.04	31,173,565.75	1,169,866,255.79
2. 基金赎回款	-2,147,934,000.05	-85,380,604.08	-2,233,314,604.13
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）	1,709,154,480.32	239,692,164.75	1,948,846,645.07

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 500 交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华中证 500 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]112号《关于准予平安大华中证 500 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《平安大华中证 500 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 2,648,533,409.00 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(2018)第 0175 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案《平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 3 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 2,648,875,604.00 份,其中认购资金利息折合 342,195.00 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,基金托管人为平安银行股份有限公司(以下简称“平安银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]41 号审核同意,本基金 441,986,121.00 份基金份额于 2018 年 5 月 4 日在上交所挂牌交易。

根据《关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告》,平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;主要投资于中证 500 指数的成份股和备选成份股,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)。本基金可以在履行适程序后,参与融资和转融通证券出借业务。本基金的投资比例为:投资于中证 500 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%。本基金将在基金合同生效之日起 6 个月内达到这一投资比例。此后,如因标的指数成份股调整导致基金不符合这一投资比例的,基金管理人将在 10 个交易日内进行调整,但中国证监会认定的特殊情形除外。本基金的业绩比较基准为:中证 500 指数收益率。

本基金的基金管理人平安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“平安 500ETF 联接基金”)。平安 500ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

## 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 500 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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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；基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；(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

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 年 12 月 31 日	
	活期存款	7,721,423.23		9,004,813.91
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	7,721,423.23		9,004,813.91	

##### 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	1,132,334,871.83	1,261,603,631.98	129,268,760.15



贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,132,334,871.83	1,261,603,631.98	129,268,760.15
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	1,699,976,600.29	1,895,019,341.51	195,042,741.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,699,976,600.29	1,895,019,341.51	195,042,741.22

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可退替代款的估值增值为零元(于 2020 年 12 月 31 日：无)

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	34,589,440.00	-	-	
其中：股指期货投资	34,589,440.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	34,589,440.00	-	-	
项目	上年度末			

	2020 年 12 月 31 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生 工具	-	-	-	
货币衍生 工具	-	-	-	
权益衍生 工具	48,497,560.00	-	-	
其中：股指 期货投资	48,497,560.00	-	-	
其他衍生 工具	-	-	-	
合计	48,497,560.00	-	-	

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

本期末

2021 年 12 月 31 日

代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值 公允价值变动

IC2201 IC2201 7 10,328,920.00 185,080.00

IC2203 IC2203 17 24,839,720.00 394,120.00

减：可抵销期货暂收款 579,200.00

股指期货投资净额 -

上年度末

2020 年 12 月 31 日

代码 名称 持仓量(买/卖) 合约市值 公允价值变动

IC2103 IC2103 30 37,508,400.00 856,840.00

IC2106 IC2106 10 12,204,800.00 358,800.00

减：可抵销期货暂收款 1,215,640.00

股指期货投资净额 -

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

## 7.4.7.4 买入返售金融资产

## 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	15,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	15,000,000.00	-
项目	上年度末 2020年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	25,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	25,000,000.00	-

## 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	3,521.62	5,734.32
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	1,789.58	2,388.62
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	772.61	-9,892.12
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	25,087.34	129,584.39
其他	119.90	408.60
合计	31,291.05	128,223.81

## 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	458,578.90	519,188.27

银行间市场应付交易费用	-	-
合计	458,578.90	519,188.27

#### 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	416,444.43	544,969.77
可退替代款	7,831.20	-
合计	424,275.63	544,969.77

注：可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购或赎回本基金时，替代价格与该替代证券市价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	285,186,121.00	1,709,154,480.32
本期申购	38,000,000.00	227,738,538.00
本期赎回（以“-”号填列）	-147,600,000.00	-884,584,426.65
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	175,586,121.00	1,052,308,591.67

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	194,198,922.28	45,493,242.47	239,692,164.75
本期利润	295,897,255.40	-66,410,421.07	229,486,834.33
本期基金份额交易产生的变动数	-96,290,612.17	-7,914,607.40	-104,205,219.57
其中：基金申购款	48,094,245.14	-6,053,182.54	42,041,062.60
基金赎回款	-144,384,857.31	-1,861,424.86	-146,246,282.17
本期已分配利润	-118,990,284.70	-	-118,990,284.70
本期末	274,815,280.81	-28,831,786.00	245,983,494.81

## 7.4.7.11 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	216,077.92	104,266.69
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	166,875.11	273,505.20
其他	7,750.20	10,090.00
合计	390,703.23	387,861.89

## 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 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
股票投资收益——买卖股票差价收入	224,127,188.80	321,653,302.68
股票投资收益——赎回差价收入	52,029,515.34	89,163,884.12
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	276,156,704.14	410,817,186.80

## 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 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
卖出股票成交总额	1,186,006,669.65	2,012,115,600.44
减：卖出股票成本总额	961,879,480.85	1,690,462,297.76
买卖股票差价收入	224,127,188.80	321,653,302.68

## 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	1,030,830,708.82	2,233,314,604.13
减：现金支付赎回款总额	552,549,640.82	1,202,963,531.13
减：赎回股票成本总额	426,251,552.66	941,187,188.88
赎回差价收入	52,029,515.34	89,163,884.12

#### 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均无股票投资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——买卖权证差价收入。

## 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	9,756,815.52	13,742,195.39

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	17,065,440.06	25,115,680.54
其中：证券出借权益补偿收入	2,034,037.29	4,409,871.19
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	17,065,440.06	25,115,680.54

## 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-65,773,981.07	115,642,597.59
股票投资	-65,773,981.07	115,642,597.59
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	-636,440.00	-1,269,962.86
权证投资	-	-
期货投资	-636,440.00	-1,269,962.86
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	-66,410,421.07	114,372,634.73

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含可退替代款产生的公允价值变动收益为零元（上年度可比期间：-6,414.00 元）。

#### 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	513,066.34	3,172,989.53
合计	513,066.34	3,172,989.53

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	2,748,990.63	4,925,586.74
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,748,990.63	4,925,586.74

#### 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	100,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	398,462.86	644,241.63
其他	200,000.00	200,000.00
合计	818,462.86	1,044,241.63

#### 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
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	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
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
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 500ETF 联接基金”)	本基金管理人管理的其他基金

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	-	-	149,937,931.77	4.34

##### 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	-	-	28,000,000.00	0.67
------	---	---	---------------	------

#### 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 (%)
-	-	-	-	-
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	106,651.30	4.34	-	-

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	6,641,045.83	10,737,360.48
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 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

##### 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	1,328,209.22	2,147,472.19

注：支付基金托管行平安银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至

每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	35,200.00	4.41	-	-
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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	304,554,093.00	243,021.06	-	-

##### 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

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	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率（%）	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
平安证券	2021120600000763	红日药业	2021年12月6日	4,270.00	1,000	3	3.40	1.21	0.00	0.00
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日										
关联方	合约	证券	成交时	交易金额	交易	出借	费率	利息	期末证	期末应收

名称	编号	名称	间	数量(单 位:股)	期限 (单 位: 天)	(%)	收入	券出借 业务余 额	利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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自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500ETF联接基金	53,440,243.00	30.4353	72,404,312.00	25.3884
平安人寿	107,941,901.00	61.4752	190,111,401.00	66.6622

##### 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
平安银行-活期	7,721,423.23	216,077.92	9,004,813.91	104,266.69

注：本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，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

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	20,640	143,654.40
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

本基金本报告期内及上年度可比期间均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投 资形 式 发 放 总 额	本期利润分配合 计	备注
		场内	场外					
1	2021 年 11 月 05 日	2021 年 11 月 8 日	-	7.0000	118,990,284.70	-	118,990,284.70	-
合计	-	-	-	7.0000	118,990,284.70	-	118,990,284.70	-

#### 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 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
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	2021 年	2022 年	新股锁	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-

	激光	6月28日	1月6日	定						
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	644	14,193.76	36,244.32	-
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	2,064	14,365.44	25,820.64	-
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	-
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	2022年 4月19	新股锁 定	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

		日	日								
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	763	71,027.67	57,484.42		-
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	2,764	28,883.80	31,012.08		-
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	323	11,728.13	11,472.96		-
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	409	23,754.72	20,388.65		-
301096	百诚医药	2021年 12月13 日	2022年 6月20 日	新股锁 定	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16		-
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	599	16,658.19	18,652.86		-
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	1,685	20,270.55	28,847.20		-
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	2021年	2022年	新股未	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44		-



	股份	12月31日	1月11日	上市						
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	253	21,773.18	23,908.50	-
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	641	74,920.08	74,407.28	-
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	435	28,788.30	24,629.70	-
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	575	16,013.75	15,789.50	-
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	280	19,569.20	24,841.60	-
688176	亚虹医药	2021年12月29日	2022年7月7日	新股锁定	22.98	22.98	37,990	873,010.20	873,010.20	-
688296	和达科技	2021年7月19日	2022年1月27日	新股锁定	12.46	49.67	2,173	27,075.58	107,932.91	-
688707	振华新材	2021年9月6日	2022年3月14日	新股锁定	11.75	47.16	8,130	95,527.50	383,410.80	-
688767	博拓生物	2021年9月1日	2022年3月8日	新股锁定	34.55	66.38	2,220	76,701.00	147,363.60	-

688786	悦安新材	2021年8月18日	2022年2月28日	新股锁定	11.76	54.01	1,513	17,792.88	81,717.13	-
688787	海天瑞声	2021年8月5日	2022年2月14日	新股锁定	36.94	87.35	817	30,179.98	71,364.95	-

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。

#### 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	78,100	2,628,611.28	2,352,372.00	-

#### 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	000009	中国宝 安	2022 年 1 月 6 日	14.43	23,200	334,776.0 0
2	000012	南玻 A	2022 年 1 月 6 日	9.93	15,300	151,929.0 0
3	000021	深科技	2022 年 1 月 6 日	15.84	11,700	185,328.0 0
4	000027	深圳能 源	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 13 日	8.10	37,100	300,510.0 0
5	000031	大悦城	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	3.73	27,700	103,321.0 0
6	000039	中集集 团	2022 年 1 月 13 日	17.16	20,000	343,200.0 0
7	000046	泛海控 股	2022 年 1 月 6 日	1.88	11,700	21,996.00
8	000060	中金岭 南	2022 年 1 月 6 日	4.91	25,100	123,241.0 0
9	000089	深圳机 场	2022 年 1 月 6 日	7.32	11,400	83,448.00
10	000090	天健集 团	2022 年 1 月 6 日	5.87	14,200	83,354.00
11	000156	华数传 媒	2022 年 1 月 6 日	8.46	10,000	84,600.00
12	000158	常山北 明	2022 年 1 月 6 日	6.92	10,000	69,200.00
13	000400	许继电 气	2022 年 1 月 6 日	26.10	10,000	261,000.0 0
14	000415	渤海租 赁	2022 年 1 月 6 日	2.91	28,600	83,226.00
15	000488	晨鸣纸 业	2022 年 1 月 6 日	7.24	16,800	121,632.0 0
16	000519	中兵红 箭	2022 年 1 月 6 日	26.67	10,200	272,034.0 0
17	000528	柳工	2022 年 1 月 6 日	7.71	11,500	88,665.00
18	000537	广宇发 展	2022 年 1 月 6 日	24.10	10,000	241,000.0 0
19	000540	中天金 融	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 7 日	2.64	23,000	60,720.00
20	000559	万向钱 潮	2022 年 1 月 6 日	6.37	15,400	98,098.00
21	000563	陕国投 A	2022 年 1 月 6 日	3.23	20,200	65,246.00
22	000598	兴蓉环 境	2022 年 1 月 6 日	6.32	14,600	92,272.00
23	000623	吉林敖	2022 年 1 月 6 日	18.47	10,200	188,394.0

		东				0
24	000629	攀钢钒钛	2022 年 1 月 6 日	3.89	52,200	203,058.00
25	000630	铜陵有色	2022 年 1 月 6 日	3.48	62,700	218,196.00
26	000656	金科股份	2022 年 1 月 4 日	4.48	16,600	74,368.00
27	000671	阳光城	2022 年 1 月 7 日	3.02	11,200	33,824.00
28	000686	东北证券	2022 年 1 月 6 日	8.78	15,700	137,846.00
29	000690	宝新能源	2022 年 1 月 6 日	5.92	13,500	79,920.00
30	000709	河钢股份	2022 年 1 月 6 日	2.46	37,600	92,496.00
31	000717	韶钢松山	2022 年 1 月 6 日	4.75	17,600	83,600.00
32	000718	苏宁环球	2022 年 1 月 6 日	4.71	12,700	59,817.00
33	000723	美锦能源	2022 年 1 月 4 日	16.23	20,600	334,338.00
34	000728	国元证券	2022 年 1 月 5 日	7.70	15,800	121,660.00
35	000729	燕京啤酒	2022 年 1 月 6 日	8.47	16,000	135,520.00
36	000738	航发控制	2022 年 1 月 6 日	30.28	10,000	302,800.00
37	000750	国海证券	2022 年 1 月 6 日	4.11	30,000	123,300.00
38	000778	新兴铸管	2022 年 1 月 6 日	4.33	21,700	93,961.00
39	000807	云铝股份	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 13 日	11.17	32,800	366,376.00
40	000825	太钢不锈	2022 年 1 月 6 日	7.04	24,500	172,480.00
41	000830	鲁西化工	2022 年 1 月 6 日	15.26	10,400	158,704.00
42	000883	湖北能源	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 13 日	5.24	66,100	346,364.00
43	000887	中鼎股份	2022 年 1 月 6 日	21.81	10,800	235,548.00
44	000898	鞍钢股份	2022 年 1 月 6 日	3.75	27,100	101,625.00
45	000932	华菱钢	2022 年 1 月 4 日-2022 年	5.11	30,000	153,300.00

		铁	1月6日			0
46	000937	冀中能源	2022年1月6日	5.51	11,800	65,018.00
47	000959	首钢股份	2022年1月4日-2022年1月6日	5.73	51,900	297,387.00
48	000961	中南建设	2022年1月7日	4.14	10,300	42,642.00
49	000967	盈峰环境	2022年1月6日	7.33	10,600	77,698.00
50	000975	银泰黄金	2022年1月6日	8.78	12,600	110,628.00
51	000983	山西焦煤	2022年1月12日	8.27	18,000	148,860.00
52	000997	新大陆	2022年1月6日	18.12	10,800	195,696.00
53	000998	隆平高科	2022年1月6日	23.26	10,200	237,252.00
54	000999	华润三九	2022年1月4日	34.24	10,000	342,400.00
55	002002	鸿达兴业	2022年1月6日	6.06	20,500	124,230.00
56	002004	华邦健康	2022年1月6日	7.24	11,700	84,708.00
57	002010	传化智联	2022年1月6日	8.70	14,800	128,760.00
58	002013	中航机电	2022年1月6日	18.18	16,900	307,242.00
59	002019	亿帆医药	2022年1月6日	17.62	17,700	311,874.00
60	002030	达安基因	2022年1月4日	20.06	12,700	254,762.00
61	002038	双鹭药业	2022年1月6日	10.81	14,500	156,745.00
62	002048	宁波华翔	2022年1月6日	21.63	12,000	259,560.00
63	002065	东华软件	2022年1月14日	7.80	10,300	80,340.00
64	002075	沙钢股份	2022年1月28日	5.83	15,200	88,616.00
65	002078	太阳纸业	2022年1月6日	11.49	13,800	158,562.00
66	002081	金螳螂	2022年1月6日	6.08	18,000	109,440.00
67	002092	中泰化	2022年1月6日-2022年	9.54	33,900	323,406.00

		学	1月12日			0
68	002110	三钢闽光	2022年1月4日-2022年1月6日	6.80	26,100	177,480.00
69	002124	天邦股份	2022年1月6日	6.44	10,400	66,976.00
70	002127	南极电商	2022年1月7日	6.90	10,700	73,830.00
71	002128	电投能源	2022年1月6日	14.85	10,900	161,865.00
72	002131	利欧股份	2022年1月6日	2.46	76,000	186,960.00
73	002138	顺络电子	2022年1月6日	38.18	10,000	381,800.00
74	002146	荣盛发展	2022年1月7日	4.35	11,800	51,330.00
75	002152	广电运通	2022年1月6日	11.90	11,100	132,090.00
76	002156	通富微电	2022年1月6日	19.43	16,500	320,595.00
77	002174	游族网络	2022年1月6日	15.24	10,400	158,496.00
78	002183	怡亚通	2022年1月6日	6.62	16,500	109,230.00
79	002185	华天科技	2022年1月6日	12.71	24,800	315,208.00
80	002191	劲嘉股份	2022年1月28日	15.13	11,200	169,456.00
81	002195	二三四五	2022年1月6日	2.34	53,000	124,020.00
82	002203	海亮股份	2022年1月6日	12.43	10,000	124,300.00
83	002212	天融信	2022年1月6日	19.17	12,800	245,376.00
84	002221	东华能源	2022年1月6日	12.59	10,800	135,972.00
85	002223	鱼跃医疗	2022年1月6日	37.80	10,000	378,000.00
86	002244	滨江集团	2022年1月6日	4.66	13,800	64,308.00
87	002249	大洋电机	2022年1月6日	8.79	16,200	142,398.00
88	002266	浙富控股	2022年1月6日	7.12	14,500	103,240.00
89	002268	卫士	2022年1月4日	55.94	14,700	822,318.00

		通				0
90	002273	水晶光电	2022 年 1 月 6 日	17.39	17,800	309,542.00
91	002281	光迅科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 4 日	23.29	15,900	370,311.00
92	002299	圣农发展	2022 年 1 月 6 日	24.17	10,000	241,700.00
93	002302	西部建设	2022 年 1 月 6 日	8.03	10,000	80,300.00
94	002340	格林美	2022 年 1 月 6 日	10.35	43,000	445,050.00
95	002353	杰瑞股份	2022 年 1 月 6 日	40.00	10,000	400,000.00
96	002372	伟星新材	2022 年 1 月 6 日	24.32	14,800	359,936.00
97	002373	千方科技	2022 年 1 月 6 日	14.95	11,600	173,420.00
98	002385	大北农	2022 年 1 月 6 日	10.49	35,000	367,150.00
99	002390	信邦制药	2022 年 1 月 6 日	7.42	14,600	108,332.00
100	002396	星网锐捷	2022 年 1 月 6 日	23.57	10,000	235,700.00
101	002408	齐翔腾达	2022 年 1 月 28 日	10.50	10,400	109,200.00
102	002416	爱施德	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	11.38	26,500	301,570.00
103	002424	贵州百灵	2022 年 1 月 6 日	7.60	17,100	129,960.00
104	002429	兆驰股份	2022 年 1 月 6 日	4.86	13,000	63,180.00
105	002434	万里扬	2022 年 1 月 6 日	14.74	10,000	147,400.00
106	002440	闰土股份	2022 年 1 月 6 日	9.59	10,100	96,859.00
107	002458	益生股份	2022 年 1 月 6 日	11.31	10,000	113,100.00
108	002465	海格通信	2022 年 1 月 6 日	10.92	20,800	227,136.00
109	002468	申通快递	2022 年 1 月 6 日	9.09	10,000	90,900.00
110	002500	山西证券	2022 年 1 月 6 日	6.60	19,800	130,680.00
111	002505	鹏都农	2022 年 1 月 6 日	3.82	28,600	109,252.00

		牧				0
112	002506	协鑫集成	2022 年 1 月 6 日	3.80	26,100	99,180.00
113	002511	中顺洁柔	2022 年 1 月 4 日	16.71	16,700	279,057.00
114	002563	森马服饰	2022 年 1 月 6 日	7.73	11,100	85,803.00
115	002603	以岭药业	2022 年 1 月 4 日	19.60	15,500	303,800.00
116	002670	国盛金控	2022 年 1 月 6 日	9.60	13,600	130,560.00
117	002673	西部证券	2022 年 1 月 5 日	8.07	13,900	112,173.00
118	002690	美亚光电	2022 年 1 月 6 日	37.46	11,900	445,774.00
119	002701	奥瑞金	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	7.00	42,300	296,100.00
120	002797	第一创业	2022 年 1 月 6 日	7.32	33,100	242,292.00
121	002926	华西证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	9.85	37,400	368,390.00
122	002958	青农商行	2022 年 1 月 7 日	3.86	15,100	58,286.00
123	300009	安科生物	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	13.09	24,600	322,014.00
124	300017	网宿科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	6.69	62,300	416,787.00
125	300024	机器人	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	11.17	39,900	445,683.00
126	300026	红日药业	2022 年 1 月 6 日	7.83	19,000	148,770.00
127	300058	蓝色光标	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 13 日	10.73	86,600	929,218.00
128	300070	碧水源	2022 年 1 月 6 日	7.19	25,100	180,469.00
129	300072	三聚环保	2022 年 1 月 6 日	7.93	14,600	115,778.00
130	300088	长信科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 7 日	13.28	13,400	177,952.00
131	300115	长盈精密	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 4 日	19.84	27,500	545,600.00
132	300133	华策影视	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	6.77	38,800	262,676.00
133	300146	汤臣倍	2022 年 1 月 6 日	26.96	11,600	312,736.00



		健				0
134	300168	万达信息	2022年1月4日-2022年1月4日	13.02	28,100	365,862.00
135	300182	捷成股份	2022年1月6日	6.33	24,800	156,984.00
136	300253	卫宁健康	2022年1月12日	16.76	23,800	398,888.00
137	300257	开山股份	2022年1月4日-2022年1月4日	15.88	18,500	293,780.00
138	300271	华宇软件	2022年1月4日-2022年1月4日	12.70	22,400	284,480.00
139	300296	利亚德	2022年1月6日	10.25	19,100	195,775.00
140	300315	掌趣科技	2022年1月4日-2022年1月6日	4.86	71,000	345,060.00
141	300418	昆仑万维	2022年1月6日	23.15	11,900	275,485.00
142	300630	普利制药	2022年1月6日	55.04	11,500	632,960.00
143	300699	光威复材	2022年1月6日	84.48	11,400	963,072.00
144	600006	东风汽车	2022年1月6日	6.81	10,000	68,100.00
145	600008	首创环保	2022年1月6日	3.41	36,200	123,442.00
146	600021	上海电力	2022年1月6日	12.82	11,700	149,994.00
147	600022	山东钢铁	2022年1月6日	1.79	47,200	84,488.00
148	600026	中远海能	2022年1月6日	5.92	11,100	65,712.00
149	600027	华电国际	2022年1月6日	5.35	15,000	80,250.00
150	600037	歌华有线	2022年1月6日	8.68	11,000	95,480.00
151	600056	中国医药	2022年1月6日	11.81	10,000	118,100.00
152	600060	海信视像	2022年1月6日	13.45	11,500	154,675.00
153	600062	华润双鹤	2022年1月6日	13.37	10,000	133,700.00
154	600120	浙江东方	2022年1月6日	4.42	19,500	86,190.00
155	600126	杭钢股	2022年1月6日	5.13	19,800	101,574.00

		份				0
156	600141	兴发集团	2022 年 1 月 6 日	37.88	10,000	378,800.00
157	600153	建发股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	9.07	54,700	496,129.00
158	600155	华创阳安	2022 年 1 月 6 日	9.96	13,700	136,452.00
159	600157	永泰能源	2022 年 1 月 4 日	1.82	115,600	210,392.00
160	600158	中体产业	2022 年 1 月 6 日	15.12	10,000	151,200.00
161	600160	巨化股份	2022 年 1 月 6 日	12.91	14,200	183,322.00
162	600166	福田汽车	2022 年 1 月 6 日	3.44	41,000	141,040.00
163	600167	联美控股	2022 年 1 月 6 日	9.01	13,400	120,734.00
164	600170	上海建工	2022 年 1 月 6 日	3.60	49,600	178,560.00
165	600171	上海贝岭	2022 年 1 月 6 日	25.66	10,000	256,600.00
166	600177	雅戈尔	2022 年 1 月 7 日	6.89	15,200	104,728.00
167	600195	中牧股份	2022 年 1 月 6 日	13.07	10,000	130,700.00
168	600201	生物股份	2022 年 1 月 6 日	16.35	13,600	222,360.00
169	600208	新湖中宝	2022 年 1 月 6 日	2.98	15,000	44,700.00
170	600236	桂冠电力	2022 年 1 月 4 日	6.42	12,200	78,324.00
171	600256	广汇能源	2022 年 1 月 6 日	6.54	34,700	226,938.00
172	600266	城建发展	2022 年 1 月 6 日	4.50	13,100	58,950.00
173	600282	南钢股份	2022 年 1 月 6 日	3.70	32,900	121,730.00
174	600297	广汇汽车	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 6 日	2.67	80,100	213,867.00
175	600307	酒钢宏兴	2022 年 1 月 6 日	2.20	39,400	86,680.00
176	600325	华发股份	2022 年 1 月 6 日	6.02	19,100	114,982.00
177	600329	中新药	2022 年 1 月 6 日	31.41	13,100	411,471.00

		业				0
178	600339	中油工程	2022 年 1 月 6 日	3.08	23,200	71,456.00
179	600348	华阳股份	2022 年 1 月 6 日	11.85	15,800	187,230.00
180	600369	西南证券	2022 年 1 月 7 日	5.29	18,100	95,749.00
181	600376	首开股份	2022 年 1 月 6 日	5.66	12,200	69,052.00
182	600380	健康元	2022 年 1 月 6 日	12.84	17,100	219,564.00
183	600390	五矿资本	2022 年 1 月 7 日	5.32	12,300	65,436.00
184	600392	盛和资源	2022 年 1 月 6 日	19.62	20,600	404,172.00
185	600398	海澜之家	2022 年 1 月 6 日	6.41	19,000	121,790.00
186	600409	三友化工	2022 年 1 月 6 日	8.70	10,600	92,220.00
187	600415	小商品城	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	4.85	52,500	254,625.00
188	600418	江淮汽车	2022 年 1 月 6 日	17.40	12,400	215,760.00
189	600435	北方导航	2022 年 1 月 6 日	10.68	11,400	121,752.00
190	600446	金证股份	2022 年 1 月 6 日	14.32	10,000	143,200.00
191	600466	蓝光发展	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	2.04	27,100	55,284.00
192	600487	亨通光电	2022 年 1 月 25 日	15.12	10,000	151,200.00
193	600497	驰宏锌锗	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	4.99	26,500	132,235.00
194	600500	中化国际	2022 年 1 月 6 日	8.56	18,900	161,784.00
195	600507	方大特钢	2022 年 1 月 6 日	7.80	10,800	84,240.00
196	600516	方大炭素	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	10.82	44,200	478,244.00
197	600517	国网英大	2022 年 1 月 6 日	7.29	10,000	72,900.00
198	600522	中天科技	2022 年 1 月 19 日	16.96	13,600	230,656.00
199	600528	中铁工	2022 年 1 月 6 日	8.21	17,200	141,212.00

		业				0
200	600529	山东药玻	2022 年 1 月 6 日	43.90	10,000	439,000.00
201	600535	天士力	2022 年 1 月 6 日	15.85	10,200	161,670.00
202	600549	厦门钨业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	22.63	20,100	454,863.00
203	600566	济川药业	2022 年 1 月 6 日	28.34	12,000	340,080.00
204	600567	山鹰国际	2022 年 1 月 7 日	3.29	17,700	58,233.00
205	600572	康恩贝	2022 年 1 月 6 日	5.00	18,200	91,000.00
206	600582	天地科技	2022 年 1 月 6 日	4.38	18,600	81,468.00
207	600598	北大荒	2022 年 1 月 6 日	14.56	16,900	246,064.00
208	600623	华谊集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 4 日	9.10	15,400	140,140.00
209	600637	东方明珠	2022 年 1 月 17 日	9.45	10,600	100,170.00
210	600642	申能股份	2022 年 1 月 6 日	7.37	21,400	157,718.00
211	600649	城投控股	2022 年 1 月 6 日	4.11	15,600	64,116.00
212	600657	信达地产	2022 年 1 月 6 日	3.73	11,800	44,014.00
213	600667	太极实业	2022 年 1 月 6 日	8.08	21,000	169,680.00
214	600673	东阳光	2022 年 1 月 6 日	8.88	12,800	113,664.00
215	600699	均胜电子	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 6 日	21.97	35,600	782,132.00
216	600704	物产中大	2022 年 1 月 6 日	5.92	22,900	135,568.00
217	600705	中航产融	2022 年 1 月 4 日	3.97	27,800	110,366.00
218	600717	天津港	2022 年 1 月 6 日	4.19	17,600	73,744.00
219	600728	佳都科技	2022 年 1 月 28 日	8.33	12,200	101,626.00
220	600733	北汽蓝谷	2022 年 1 月 6 日	10.02	23,300	233,466.00
221	600739	辽宁成大	2022 年 1 月 6 日	19.52	16,400	320,128.00
222	600755	厦门国	2022 年 1 月 6 日	7.21	19,100	137,711.00

		贸				0
223	600765	中航重机	2022年1月6日	50.49	10,000	504,900.00
224	600776	东方通信	2022年1月6日	11.51	10,000	115,100.00
225	600782	新钢股份	2022年1月6日	5.28	11,800	62,304.00
226	600787	中储股份	2022年1月4日-2022年1月6日	6.24	27,400	170,976.00
227	600808	马钢股份	2022年1月6日	3.69	20,000	73,800.00
228	600811	东方集团	2022年1月6日-2022年1月28日	3.01	61,800	186,018.00
229	600820	隧道股份	2022年1月6日	5.38	21,000	112,980.00
230	600823	世茂股份	2022年1月6日	3.28	14,900	48,872.00
231	600839	四川长虹	2022年1月6日	3.31	39,100	129,421.00
232	600859	王府井	2022年1月6日	27.00	13,900	375,300.00
233	600863	内蒙华电	2022年1月4日-2022年1月6日	3.94	66,600	262,404.00
234	600867	通化东宝	2022年1月6日	10.96	20,900	229,064.00
235	600871	石化油服	2022年1月7日	2.14	10,300	22,042.00
236	600875	东方电气	2022年1月6日	21.42	13,000	278,460.00
237	600879	航天电子	2022年1月6日	8.24	19,800	163,152.00
238	600884	杉杉股份	2022年1月6日	32.77	10,100	330,977.00
239	600885	宏发股份	2022年1月4日-2022年1月4日	74.64	23,600	1,761,504.00
240	600895	张江高科	2022年1月4日-2022年1月4日	15.06	25,800	388,548.00
241	600901	江苏租赁	2022年1月6日	5.09	17,400	88,566.00
242	600909	华安证券	2022年1月7日	5.41	15,400	83,314.00
243	600928	西安银行	2022年1月6日	4.30	19,500	83,850.00
244	600959	江苏有	2022年1月6日	3.29	17,000	55,930.00

		线				
245	600967	内蒙一机	2022年1月6日	11.95	12,400	148,180.00
246	600968	海油发展	2022年1月4日	2.93	10,500	30,765.00
247	600970	中材国际	2022年1月28日	11.43	12,000	137,160.00
248	600988	赤峰黄金	2022年1月4日	14.90	10,400	154,960.00
249	601000	唐山港	2022年1月6日	2.75	30,400	83,600.00
250	601003	柳钢股份	2022年1月6日	5.22	10,000	52,200.00
251	601005	重庆钢铁	2022年1月6日	2.09	51,300	107,217.00
252	601016	节能风电	2022年1月4日-2022年1月6日	6.51	62,400	406,224.00
253	601077	渝农商行	2022年1月4日	3.85	32,100	123,585.00
254	601098	中南传媒	2022年1月6日	9.57	10,600	101,442.00
255	601106	中国一重	2022年1月6日	3.48	29,100	101,268.00
256	601117	中国化学	2022年1月7日	12.00	13,300	159,600.00
257	601118	海南橡胶	2022年1月6日	5.28	10,000	52,800.00
258	601128	常熟银行	2022年1月6日	6.61	27,600	182,436.00
259	601139	深圳燃气	2022年1月6日	8.83	10,000	88,300.00
260	601168	西部矿业	2022年1月6日	13.61	21,500	292,615.00
261	601179	中国西电	2022年1月6日	5.55	21,000	116,550.00
262	601198	东兴证券	2022年1月4日	11.63	38,300	445,429.00
263	601228	广州港	2022年1月6日	3.33	13,900	46,287.00
264	601333	广深铁路	2022年1月6日	2.24	34,200	76,608.00
265	601555	东吴证券	2022年1月20日	8.86	21,000	186,060.00
266	601598	中国外运	2022年1月6日	4.48	17,800	79,744.00
267	601608	中信重	2022年1月6日	4.46	13,200	58,872.00

		工				
268	601699	潞安环能	2022年1月6日	11.31	12,200	137,982.00
269	601717	郑煤机	2022年1月6日	11.59	11,400	132,126.00
270	601718	际华集团	2022年1月4日-2022年1月6日	2.98	38,500	114,730.00
271	601860	紫金银行	2022年1月6日	3.35	22,600	75,710.00
272	601866	中远海发	2022年1月4日-2022年1月6日	3.25	94,000	305,500.00
273	601872	招商轮船	2022年1月12日	4.10	16,800	68,880.00
274	601880	辽港股份	2022年1月6日	1.73	37,900	65,567.00
275	601958	金钼股份	2022年1月6日	6.85	10,400	71,240.00
276	601969	海南矿业	2022年1月28日	12.01	10,300	123,703.00
277	601975	招商南油	2022年1月6日	2.01	35,700	71,757.00
278	601991	大唐发电	2022年1月7日	3.24	13,500	43,740.00
279	601992	金隅集团	2022年1月6日	2.84	46,900	133,196.00
280	601997	贵阳银行	2022年1月6日	6.51	12,600	82,026.00
281	603000	人民网	2022年1月4日-2022年1月6日	14.42	20,600	297,052.00
282	603077	和邦生物	2022年1月6日	3.41	46,900	159,929.00
283	603198	迎驾贡酒	2022年1月6日	69.45	10,700	743,115.00
284	603228	景旺电子	2022年1月6日	34.53	11,400	393,642.00
285	603708	家家悦	2022年1月6日	16.64	10,900	181,376.00
286	603712	七一二	2022年1月6日	43.30	10,300	445,990.00
287	603858	步长制药	2022年1月4日-2022年1月6日	21.09	22,400	472,416.00
288	603866	桃李面包	2022年1月6日	28.40	11,900	337,960.00
289	603885	吉祥航	2022年1月6日	17.75	10,000	177,500.00

		空				0
290	002683	广东宏大	2022 年 1 月 4 日	30.12	10,000	301,200.00
合计	-	-	-	-	6,110,000	57,391,954.00

#### 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



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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股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，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 个工作日内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 个工作日内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	7,721,423.23	-	-	-	7,721,423.23
结算备付金	4,146,811.76	-	-	-	4,146,811.76
存出保证金	266,357.94	-	-	5,978,668.80	6,245,026.74
交易性金融资产	-	-	-	1,261,603,631.98	1,261,603,631.98
买入返售金融资产	15,000,000.00	-	-	-	15,000,000.00
应收利息	-	-	-	31,291.05	31,291.05
应收股利	-	-	-	3,400.00	3,400.00
应收证券清算款	-	-	-	5,119,023.26	5,119,023.26
资产总计	27,134,592.93	-	-	1,272,736,015.09	1,299,870,608.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	531,770.56	531,770.56
应付托管费	-	-	-	106,354.11	106,354.11
应付交易费用	-	-	-	458,578.90	458,578.90

应交税费	-	-	-	57,542.34	57,542.34
其他负债	-	-	-	424,275.63	424,275.63
负债总计	-	-	-	1,578,521.54	1,578,521.54
利率敏感度缺口	27,134,592.93	-	-	-1,271,157,493.55	1,298,292,086.48
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	9,004,813.91	-	-	-	9,004,813.91
结算备付金	5,357,455.28	-	-	-	5,357,455.28
存出保证金	908,161.11	-	-	8,451,244.00	9,359,405.11
交易性金融资产	-	-	-	-1,895,019,341.51	1,895,019,341.51
买入返售金融资产	25,000,000.00	-	-	-	25,000,000.00
应收利息	-	-	-	128,223.81	128,223.81
应收证券清算款	-	-	-	6,998,429.17	6,998,429.17
资产总计	40,270,430.30	-	-	-1,910,597,238.49	1,950,867,668.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	797,388.06	797,388.06
应付托管费	-	-	-	159,477.62	159,477.62
应付交易费用	-	-	-	519,188.27	519,188.27
其他负债	-	-	-	544,969.77	544,969.77
负债总计	-	-	-	2,021,023.72	2,021,023.72
利率敏感度缺口	40,270,430.30	-	-	-1,908,576,214.77	1,948,846,645.07

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	1,261,603,631.98	97.17	1,895,019,341.51	97.24
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,261,603,631.98	97.17	1,895,019,341.51	97.24

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

#### 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%	38,585,202.73	98,655,574.19
	沪深 300 指数下降 5%	-38,585,202.73	-98,655,574.19

#### 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 1,256,588,532.19 元, 属于第二层次的余额为 3,300,831.64 元, 属于第三层次的余额为 1,714,268.15 元(2020 年 12 月 31 日: 第一层次 1,889,323,256.02 元, 第二层次 5,696,085.49 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 1,655,651.36

兑付 -

出售 -

转入第三层级 -

转出第三层级 -828,347.50

当期利得或损失总额 886,964.29

计入损益的利得或损失 886,964.29

2021 年 12 月 31 日 1,714,268.15

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 886,964.29

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

1,714,268.15 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 269,779,600.60 元(2020 年度：1,169,866,255.79 元)，其中包括以股票支付的申购款 125,345,344.77 元和以现金支付的申购款 144,434,255.83 元(2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 508,268,898.24 元和以现金支付的申购款 661,597,357.55 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	1,261,603,631.98	97.06
	其中：股票	1,261,603,631.98	97.06
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	15,000,000.00	1.15
	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	11,868,234.99	0.91
8	其他各项资产	11,398,741.05	0.88
9	合计	1,299,870,608.02	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. 本基金本报告期末融出证券市值为 57,391,954.00，占净值比例 4.42%。

## 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	13,962,557.36	1.08
B	采矿业	48,496,827.78	3.74
C	制造业	759,758,132.66	58.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	47,077,369.55	3.63
E	建筑业	23,908,507.74	1.84
F	批发和零售业	38,817,887.56	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	29,543,577.67	2.28
H	住宿和餐饮业	7,411,921.92	0.57
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,748,002.83	8.30
J	金融业	90,343,329.54	6.96
K	房地产业	32,551,064.17	2.51
L	租赁和商务服务业	15,373,657.10	1.18
M	科学研究和技术服务业	4,428,675.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	10,830,360.27	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	2,618,460.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	16,246,357.01	1.25
S	综合	9,053,064.54	0.70
	合计	1,258,169,752.70	96.91

### 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	2,634,068.20	0.20
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	341,818.62	0.03
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	216,369.94	0.02
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	146,440.42	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	38,206.72	0.00
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	0.00
S	综合	-	-
	合计	3,433,879.28	0.26

### 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	002340	格林美	859,300	8,893,755.00	0.69



2	600522	中天科技	476,300	8,078,048.00	0.62
3	000733	振华科技	64,600	8,028,488.00	0.62
4	000723	美锦能源	458,400	7,439,832.00	0.57
5	601615	明阳智能	280,600	7,323,660.00	0.56
6	600157	永泰能源	3,975,500	7,235,410.00	0.56
7	600399	抚顺特钢	282,900	7,007,433.00	0.54
8	600885	宏发股份	93,594	6,985,856.16	0.54
9	600884	杉杉股份	207,420	6,797,153.40	0.52
10	000009	中国宝安	461,778	6,663,456.54	0.51
11	002384	东山精密	244,800	6,634,080.00	0.51
12	601117	中国化学	549,400	6,592,800.00	0.51
13	601555	东吴证券	722,840	6,404,362.40	0.49
14	002013	中航机电	347,200	6,312,096.00	0.49
15	002385	大北农	592,500	6,215,325.00	0.48
16	300285	国瓷材料	144,096	6,134,166.72	0.47
17	002180	纳思达	126,400	6,036,864.00	0.46
18	002268	卫士通	106,200	5,940,828.00	0.46
19	300751	迈为股份	9,200	5,909,160.00	0.46
20	605358	立昂微	49,100	5,892,491.00	0.45
21	300037	新宙邦	51,600	5,830,800.00	0.45
22	300088	长信科技	439,000	5,829,920.00	0.45
23	688099	晶晨股份	44,200	5,754,840.00	0.44
24	600765	中航重机	113,300	5,720,517.00	0.44
25	600563	法拉电子	24,190	5,621,756.00	0.43
26	688005	容百科技	48,200	5,570,956.00	0.43
27	002028	思源电气	109,800	5,403,258.00	0.42
28	600298	安琪酵母	89,300	5,390,148.00	0.42
29	600256	广汇能源	821,520	5,372,740.80	0.41
30	600862	中航高科	150,200	5,371,152.00	0.41
31	600141	兴发集团	138,960	5,263,804.80	0.41
32	300363	博腾股份	58,500	5,232,825.00	0.40
33	300253	卫宁健康	306,000	5,128,560.00	0.40
34	600487	亨通光电	338,500	5,118,120.00	0.39
35	002185	华天科技	401,100	5,097,981.00	0.39
36	603456	九洲药业	89,200	5,018,392.00	0.39
37	000988	华工科技	179,700	5,006,442.00	0.39
38	601636	旗滨集团	288,300	4,929,930.00	0.38
39	600392	盛和资源	251,010	4,924,816.20	0.38
40	600754	锦江酒店	81,900	4,799,340.00	0.37
41	300058	蓝色光标	444,866	4,773,412.18	0.37
42	600418	江淮汽车	273,700	4,762,380.00	0.37
43	300699	光威复材	55,735	4,708,492.80	0.36

44	300223	北京君正	34,700	4,649,800.00	0.36
45	601168	西部矿业	341,100	4,642,371.00	0.36
46	603613	国联股份	43,100	4,633,250.00	0.36
47	603589	口子窖	65,000	4,606,550.00	0.35
48	000630	铜陵有色	1,317,800	4,585,944.00	0.35
49	603267	鸿远电子	24,700	4,432,168.00	0.34
50	600516	方大炭素	409,240	4,427,976.80	0.34
51	002138	顺络电子	115,803	4,421,358.54	0.34
52	002797	第一创业	601,900	4,405,908.00	0.34
53	600486	扬农化工	33,513	4,396,905.60	0.34
54	688536	思瑞浦	5,700	4,377,600.00	0.34
55	300136	信维通信	172,800	4,375,296.00	0.34
56	000998	隆平高科	188,100	4,375,206.00	0.34
57	300724	捷佳伟创	37,500	4,286,250.00	0.33
58	600875	东方电气	199,000	4,262,580.00	0.33
59	601077	渝农商行	1,107,000	4,261,950.00	0.33
60	300308	中际旭创	99,700	4,237,250.00	0.33
61	000728	国元证券	546,500	4,208,050.00	0.32
62	600038	中直股份	52,400	4,207,720.00	0.32
63	601689	拓普集团	78,885	4,180,905.00	0.32
64	002409	雅克科技	50,900	4,131,553.00	0.32
65	688065	凯赛生物	22,400	4,127,872.00	0.32
66	300474	景嘉微	27,000	4,109,400.00	0.32
67	300146	汤臣倍健	152,400	4,108,704.00	0.32
68	300763	锦浪科技	17,700	4,098,435.00	0.32
69	600233	圆通速递	245,700	4,098,276.00	0.32
70	002080	中材科技	120,400	4,096,008.00	0.32
71	002223	鱼跃医疗	108,298	4,093,664.40	0.32
72	603893	瑞芯微	29,900	4,093,310.00	0.32
73	002353	杰瑞股份	102,284	4,091,360.00	0.32
74	002212	天融信	212,400	4,071,708.00	0.31
75	000519	中兵红箭	150,000	4,000,500.00	0.31
76	300418	昆仑万维	171,510	3,970,456.50	0.31
77	002673	西部证券	480,000	3,873,600.00	0.30
78	688208	道通科技	48,400	3,842,960.00	0.30
79	600733	北汽蓝谷	383,472	3,842,389.44	0.30
80	000547	航天发展	228,700	3,819,290.00	0.29
81	600482	中国动力	193,700	3,815,890.00	0.29
82	000636	风华高科	127,914	3,811,837.20	0.29
83	002439	启明星辰	133,600	3,811,608.00	0.29
84	600705	中航产融	956,000	3,795,320.00	0.29
85	000932	华菱钢铁	741,820	3,790,700.20	0.29

86	603077	和邦生物	1,105,900	3,771,119.00	0.29
87	000039	中集集团	219,720	3,770,395.20	0.29
88	600188	兖矿能源	160,200	3,769,506.00	0.29
89	600699	均胜电子	171,180	3,760,824.60	0.29
90	688002	睿创微纳	47,800	3,755,646.00	0.29
91	600739	辽宁成大	192,300	3,753,696.00	0.29
92	603605	珀莱雅	18,000	3,749,580.00	0.29
93	002444	巨星科技	122,700	3,743,577.00	0.29
94	600529	山东药玻	85,100	3,735,890.00	0.29
95	300296	利亚德	364,200	3,733,050.00	0.29
96	000739	普洛药业	104,881	3,680,274.29	0.28
97	002465	海格通信	330,100	3,604,692.00	0.28
98	002507	涪陵榨菜	94,800	3,583,440.00	0.28
99	000738	航发控制	118,000	3,573,040.00	0.28
100	600988	赤峰黄金	238,700	3,556,630.00	0.27
101	000807	云铝股份	317,600	3,547,592.00	0.27
102	002030	达安基因	175,708	3,524,702.48	0.27
103	601016	节能风电	538,200	3,503,682.00	0.27
104	000960	锡业股份	178,700	3,490,011.00	0.27
105	600521	华海药业	160,300	3,472,098.00	0.27
106	603290	斯达半导	9,100	3,467,100.00	0.27
107	600637	东方明珠	366,600	3,464,370.00	0.27
108	002273	水晶光电	199,209	3,464,244.51	0.27
109	600549	厦门钨业	152,700	3,455,601.00	0.27
110	688521	芯原股份	44,500	3,442,520.00	0.27
111	600732	爱旭股份	145,400	3,396,544.00	0.26
112	600177	雅戈尔	492,900	3,396,081.00	0.26
113	601198	东兴证券	288,900	3,359,907.00	0.26
114	002557	洽洽食品	54,100	3,319,576.00	0.26
115	603127	昭衍新药	28,700	3,312,841.00	0.26
116	002078	太阳纸业	288,300	3,312,567.00	0.26
117	002985	北摩高科	27,450	3,306,627.00	0.25
118	600201	生物股份	202,030	3,303,190.50	0.25
119	600704	物产中大	557,750	3,301,880.00	0.25
120	300383	光环新网	220,300	3,269,252.00	0.25
121	601128	常熟银行	491,500	3,248,815.00	0.25
122	600642	申能股份	439,601	3,239,859.37	0.25
123	002156	通富微电	166,704	3,239,058.72	0.25
124	603444	吉比特	7,647	3,225,886.95	0.25
125	002299	圣农发展	133,200	3,219,444.00	0.25
126	600879	航天电子	388,500	3,201,240.00	0.25
127	300357	我武生物	55,715	3,192,469.50	0.25

128	600497	驰宏锌锗	636,500	3,176,135.00	0.24
129	600369	西南证券	594,900	3,147,021.00	0.24
130	600027	华电国际	584,300	3,126,005.00	0.24
131	000830	鲁西化工	204,700	3,123,722.00	0.24
132	600160	巨化股份	241,730	3,120,734.30	0.24
133	300618	寒锐钴业	38,900	3,119,002.00	0.24
134	002739	万达电影	199,800	3,092,904.00	0.24
135	600039	四川路桥	256,300	3,085,852.00	0.24
136	600372	中航电子	137,800	3,085,342.00	0.24
137	002092	中泰化学	323,300	3,084,282.00	0.24
138	000623	吉林敖东	166,700	3,078,949.00	0.24
139	002508	老板电器	84,900	3,058,098.00	0.24
140	000983	山西焦煤	367,230	3,036,992.10	0.23
141	600316	洪都航空	77,300	3,019,338.00	0.23
142	600580	卧龙电驱	164,800	3,014,192.00	0.23
143	300115	长盈精密	150,940	2,994,649.60	0.23
144	000629	攀钢钒钛	768,600	2,989,854.00	0.23
145	601997	贵阳银行	458,700	2,986,137.00	0.23
146	603198	迎驾贡酒	42,900	2,979,405.00	0.23
147	002249	大洋电机	338,800	2,978,052.00	0.23
148	002131	利欧股份	1,209,000	2,974,140.00	0.23
149	002373	千方科技	198,337	2,965,138.15	0.23
150	002603	以岭药业	150,120	2,942,352.00	0.23
151	300017	网宿科技	437,900	2,929,551.00	0.23
152	002936	郑州银行	922,163	2,914,035.08	0.22
153	002422	科伦药业	153,200	2,900,076.00	0.22
154	600170	上海建工	798,300	2,873,880.00	0.22
155	000825	太钢不锈	407,400	2,868,096.00	0.22
156	000050	深天马 A	219,800	2,861,796.00	0.22
157	000887	中鼎股份	130,900	2,854,929.00	0.22
158	603218	日月股份	86,600	2,853,470.00	0.22
159	600118	中国卫星	105,100	2,853,465.00	0.22
160	300070	碧水源	396,500	2,850,835.00	0.22
161	000400	许继电气	108,797	2,839,601.70	0.22
162	600166	福田汽车	824,300	2,835,592.00	0.22
163	600803	新奥股份	153,300	2,814,588.00	0.22
164	000750	国海证券	681,540	2,801,129.40	0.22
165	600867	通化东宝	255,200	2,796,992.00	0.22
166	300001	特锐德	112,175	2,789,792.25	0.21
167	600153	建发股份	306,700	2,781,769.00	0.21
168	002926	华西证券	282,400	2,781,640.00	0.21
169	002506	协鑫集成	731,900	2,781,220.00	0.21

170	002372	伟星新材	114,240	2,778,316.80	0.21
171	002191	劲嘉股份	183,400	2,774,842.00	0.21
172	603707	健友股份	65,970	2,770,740.00	0.21
173	300168	万达信息	212,100	2,761,542.00	0.21
174	000027	深圳能源	339,780	2,752,218.00	0.21
175	002266	浙富控股	384,500	2,737,640.00	0.21
176	600859	王府井	101,200	2,732,400.00	0.21
177	002056	横店东磁	144,700	2,730,489.00	0.21
178	600909	华安证券	504,670	2,730,264.70	0.21
179	600236	桂冠电力	422,500	2,712,450.00	0.21
180	000513	丽珠集团	67,286	2,705,570.06	0.21
181	002002	鸿达兴业	445,700	2,700,942.00	0.21
182	600008	首创环保	789,950	2,693,729.50	0.21
183	300251	光线传媒	209,600	2,693,360.00	0.21
184	600066	宇通客车	243,800	2,686,676.00	0.21
185	002065	东华软件	344,100	2,683,980.00	0.21
186	300009	安科生物	204,928	2,682,507.52	0.21
187	000997	新大陆	147,400	2,670,888.00	0.21
188	600271	航天信息	199,000	2,664,610.00	0.21
189	000021	深科技	167,700	2,656,368.00	0.20
190	002152	广电运通	221,800	2,639,420.00	0.20
191	002408	齐翔腾达	250,740	2,632,770.00	0.20
192	600536	中国软件	52,700	2,631,311.00	0.20
193	002203	海亮股份	211,407	2,627,789.01	0.20
194	000975	银泰黄金	298,632	2,621,988.96	0.20
195	300244	迪安诊断	78,000	2,618,460.00	0.20
196	600258	首旅酒店	99,984	2,612,581.92	0.20
197	600171	上海贝岭	101,700	2,609,622.00	0.20
198	002221	东华能源	206,400	2,598,576.00	0.20
199	600535	天士力	162,900	2,581,965.00	0.20
200	300630	普利制药	46,644	2,567,285.76	0.20
201	002572	索菲亚	115,500	2,564,100.00	0.20
202	603156	养元饮品	90,200	2,562,582.00	0.20
203	000656	金科股份	571,500	2,560,320.00	0.20
204	600348	华阳股份	214,700	2,544,195.00	0.20
205	002500	山西证券	385,170	2,542,122.00	0.20
206	300212	易华录	71,912	2,542,089.20	0.20
207	300026	红日药业	322,900	2,528,307.00	0.19
208	601005	重庆钢铁	1,197,300	2,502,357.00	0.19
209	300024	机器人	223,300	2,494,261.00	0.19
210	603568	伟明环保	68,015	2,484,587.95	0.19
211	600998	九州通	167,200	2,461,184.00	0.19

212	000970	中科三环	152,700	2,450,835.00	0.19
213	000012	南玻A	245,502	2,437,834.86	0.19
214	600315	上海家化	60,226	2,433,732.66	0.19
215	000878	云南铜业	181,800	2,430,666.00	0.19
216	601699	潞安环能	214,300	2,423,733.00	0.19
217	002127	南极电商	351,200	2,423,280.00	0.19
218	300315	掌趣科技	497,400	2,417,364.00	0.19
219	000999	华润三九	70,500	2,413,920.00	0.19
220	002745	木林森	159,500	2,413,235.00	0.19
221	000537	广宇发展	99,500	2,397,950.00	0.18
222	002195	二三四五	1,021,408	2,390,094.72	0.18
223	600673	东阳光	269,100	2,389,608.00	0.18
224	600415	小商品城	491,600	2,384,260.00	0.18
225	601872	招商轮船	580,500	2,380,050.00	0.18
226	002250	联化科技	132,200	2,375,634.00	0.18
227	603712	七一二	54,755	2,370,891.50	0.18
228	600801	华新水泥	122,080	2,356,144.00	0.18
229	002683	广东宏大	78,100	2,352,372.00	0.18
230	002511	中顺洁柔	140,057	2,340,352.47	0.18
231	688006	杭可科技	21,700	2,334,486.00	0.18
232	300182	捷成股份	368,500	2,332,605.00	0.18
233	300463	迈克生物	79,900	2,332,281.00	0.18
234	002019	亿帆医药	132,100	2,327,602.00	0.18
235	601866	中远海发	712,546	2,315,774.50	0.18
236	002153	石基信息	80,500	2,313,570.00	0.18
237	600863	内蒙华电	584,700	2,303,718.00	0.18
238	000690	宝新能源	389,100	2,303,472.00	0.18
239	600208	新湖中宝	767,300	2,286,554.00	0.18
240	600970	中材国际	199,200	2,276,856.00	0.18
241	002831	裕同科技	66,960	2,255,882.40	0.17
242	000060	中金岭南	456,800	2,242,888.00	0.17
243	600517	国网英大	306,100	2,231,469.00	0.17
244	601778	晶科科技	258,100	2,201,593.00	0.17
245	000686	东北证券	250,700	2,201,146.00	0.17
246	002505	鹏都农牧	573,800	2,191,916.00	0.17
247	600498	烽火通信	121,900	2,191,762.00	0.17
248	600380	健康元	170,472	2,188,860.48	0.17
249	600839	四川长虹	660,000	2,184,600.00	0.17
250	600155	华创阳安	219,300	2,184,228.00	0.17
251	300482	万孚生物	55,400	2,181,652.00	0.17
252	002294	信立泰	79,700	2,177,404.00	0.17
253	000930	中粮科技	200,100	2,175,087.00	0.17

254	600390	五矿资本	404,800	2,153,536.00	0.17
255	002939	长城证券	166,200	2,152,290.00	0.17
256	600511	国药股份	68,100	2,147,193.00	0.17
257	000729	燕京啤酒	252,300	2,136,981.00	0.16
258	603858	步长制药	101,300	2,136,417.00	0.16
259	600667	太极实业	263,300	2,127,464.00	0.16
260	002701	奥瑞金	303,300	2,123,100.00	0.16
261	601992	金隅集团	745,400	2,116,936.00	0.16
262	600500	中化国际	247,220	2,116,203.20	0.16
263	600718	东软集团	155,879	2,113,719.24	0.16
264	000401	冀东水泥	176,600	2,112,136.00	0.16
265	600728	佳都科技	251,900	2,098,327.00	0.16
266	002430	杭氧股份	69,700	2,091,697.00	0.16
267	600216	浙江医药	121,900	2,082,052.00	0.16
268	688188	柏楚电子	5,400	2,081,484.00	0.16
269	600895	张江高科	138,200	2,081,292.00	0.16
270	300376	易事特	207,000	2,080,350.00	0.16
271	600158	中体产业	137,300	2,075,976.00	0.16
272	600764	中国海防	50,500	2,053,330.00	0.16
273	002382	蓝帆医疗	126,000	2,052,540.00	0.16
274	002004	华邦健康	283,400	2,051,816.00	0.16
275	688029	南微医学	9,600	2,041,632.00	0.16
276	600282	南钢股份	551,500	2,040,550.00	0.16
277	601179	中国西电	367,655	2,040,485.25	0.16
278	002532	天山铝业	249,600	2,034,240.00	0.16
279	002966	苏州银行	300,400	2,033,708.00	0.16
280	002128	电投能源	136,800	2,031,480.00	0.16
281	603225	新凤鸣	136,620	2,028,807.00	0.16
282	000598	兴蓉环境	320,300	2,024,296.00	0.16
283	002368	太极股份	73,496	2,024,079.84	0.16
284	002174	游族网络	131,885	2,009,927.40	0.15
285	300072	三聚环保	251,800	1,996,774.00	0.15
286	002595	豪迈科技	71,900	1,995,944.00	0.15
287	002670	国盛金控	207,403	1,991,068.80	0.15
288	000540	中天金融	751,900	1,985,016.00	0.15
289	002396	星网锐捷	84,100	1,982,237.00	0.15
290	600528	中铁工业	240,833	1,977,238.93	0.15
291	600985	淮北矿业	176,852	1,977,205.36	0.15
292	603866	桃李面包	68,570	1,947,388.00	0.15
293	600297	广汇汽车	725,500	1,937,085.00	0.15
294	002048	宁波华翔	89,400	1,933,722.00	0.15
295	000581	威孚高科	89,399	1,925,654.46	0.15

296	600567	山鹰国际	583,000	1,918,070.00	0.15
297	002958	青农商行	496,200	1,915,332.00	0.15
298	002010	传化智联	220,000	1,914,000.00	0.15
299	600409	三友化工	219,800	1,912,260.00	0.15
300	600827	百联股份	142,900	1,904,857.00	0.15
301	603638	艾迪精密	59,660	1,904,347.20	0.15
302	600755	厦门国贸	264,000	1,903,440.00	0.15
303	601717	郑煤机	164,000	1,900,760.00	0.15
304	002925	盈趣科技	55,650	1,893,769.50	0.15
305	600060	海信视像	140,400	1,888,380.00	0.15
306	300271	华宇软件	147,400	1,871,980.00	0.14
307	000709	河钢股份	759,200	1,867,632.00	0.14
308	600131	国网信通	85,400	1,865,990.00	0.14
309	603885	吉祥航空	104,820	1,860,555.00	0.14
310	000778	新兴铸管	428,200	1,854,106.00	0.14
311	002183	怡亚通	279,811	1,852,348.82	0.14
312	002075	沙钢股份	317,600	1,851,608.00	0.14
313	600598	北大荒	127,000	1,849,120.00	0.14
314	000883	湖北能源	351,600	1,842,384.00	0.14
315	600967	内蒙一机	153,400	1,833,130.00	0.14
316	600325	华发股份	302,200	1,819,244.00	0.14
317	603883	老百姓	36,825	1,818,418.50	0.14
318	600820	隧道股份	336,800	1,811,984.00	0.14
319	600782	新钢股份	342,500	1,808,400.00	0.14
320	002690	美亚光电	48,200	1,805,572.00	0.14
321	600597	光明乳业	123,800	1,797,576.00	0.14
322	600507	方大特钢	230,139	1,795,084.20	0.14
323	600737	中粮糖业	190,857	1,794,055.80	0.14
324	600021	上海电力	139,900	1,793,518.00	0.14
325	601456	国联证券	128,000	1,788,160.00	0.14
326	000990	诚志股份	112,401	1,778,183.82	0.14
327	600566	济川药业	62,700	1,776,918.00	0.14
328	002434	万里扬	120,000	1,768,800.00	0.14
329	603927	中科软	64,527	1,765,458.72	0.14
330	600707	彩虹股份	258,600	1,763,652.00	0.14
331	002281	光迅科技	75,500	1,758,395.00	0.14
332	600022	山东钢铁	979,800	1,753,842.00	0.14
333	601880	辽港股份	1,008,600	1,744,878.00	0.13
334	000987	越秀金控	199,200	1,733,040.00	0.13
335	600663	陆家嘴	157,900	1,714,794.00	0.13
336	601106	中国一重	492,500	1,713,900.00	0.13
337	600435	北方导航	159,900	1,707,732.00	0.13



338	002146	荣盛发展	389,500	1,694,325.00	0.13
339	002124	天邦股份	262,778	1,692,290.32	0.13
340	601577	长沙银行	216,000	1,686,960.00	0.13
341	600446	金证股份	117,800	1,686,896.00	0.13
342	600572	康恩贝	333,000	1,665,000.00	0.13
343	603650	彤程新材	32,400	1,630,368.00	0.13
344	002390	信邦制药	218,000	1,617,560.00	0.12
345	601118	海南橡胶	305,300	1,611,984.00	0.12
346	688088	虹软科技	36,547	1,610,260.82	0.12
347	600259	广晟有色	32,657	1,608,030.68	0.12
348	000898	鞍钢股份	428,300	1,606,125.00	0.12
349	600329	中新药业	51,000	1,601,910.00	0.12
350	600811	东方集团	531,500	1,599,815.00	0.12
351	000877	天山股份	103,880	1,590,402.80	0.12
352	002233	塔牌集团	149,800	1,584,884.00	0.12
353	002440	闰土股份	164,900	1,581,391.00	0.12
354	002429	兆驰股份	325,200	1,580,472.00	0.12
355	000488	晨鸣纸业	218,250	1,580,130.00	0.12
356	603228	景旺电子	45,643	1,576,052.79	0.12
357	600808	马钢股份	427,066	1,575,873.54	0.12
358	002155	湖南黄金	151,400	1,568,504.00	0.12
359	688321	微芯生物	44,300	1,550,943.00	0.12
360	300166	东方国信	143,200	1,546,560.00	0.12
361	001914	招商积余	76,300	1,545,838.00	0.12
362	002416	爱施德	133,280	1,516,726.40	0.12
363	000559	万向钱潮	237,500	1,512,875.00	0.12
364	601200	上海环境	120,148	1,512,663.32	0.12
365	600037	歌华有线	174,200	1,512,056.00	0.12
366	600373	中文传媒	121,700	1,504,212.00	0.12
367	600908	无锡银行	264,700	1,500,849.00	0.12
368	002085	万丰奥威	272,800	1,497,672.00	0.12
369	002110	三钢闽光	219,500	1,492,600.00	0.11
370	600906	财达证券	116,500	1,486,540.00	0.11
371	600167	联美控股	163,990	1,477,549.90	0.11
372	600398	海澜之家	230,300	1,476,223.00	0.11
373	600026	中远海能	248,500	1,471,120.00	0.11
374	601000	唐山港	530,020	1,457,555.00	0.11
375	600546	山煤国际	176,900	1,452,349.00	0.11
376	002705	新宝股份	58,700	1,449,890.00	0.11
377	002081	金螳螂	238,400	1,449,472.00	0.11
378	600064	南京高科	154,700	1,444,898.00	0.11
379	600195	中牧股份	109,947	1,437,007.29	0.11

380	601991	大唐发电	443,400	1,436,616.00	0.11
381	000528	柳工	184,670	1,423,805.70	0.11
382	603000	人民网	98,500	1,420,370.00	0.11
383	000961	中南建设	341,000	1,411,740.00	0.11
384	601611	中国核建	141,280	1,408,561.60	0.11
385	601718	际华集团	472,144	1,406,989.12	0.11
386	000685	中山公用	158,200	1,400,070.00	0.11
387	002038	双鹭药业	128,950	1,393,949.50	0.11
388	002867	周大生	78,350	1,393,063.00	0.11
389	000158	常山北明	201,100	1,391,612.00	0.11
390	000090	天健集团	235,322	1,381,340.14	0.11
391	601608	中信重工	309,100	1,378,586.00	0.11
392	300133	华策影视	203,600	1,378,372.00	0.11
393	600120	浙江东方	311,088	1,375,008.96	0.11
394	000959	首钢股份	239,900	1,374,627.00	0.11
395	002387	维信诺	147,200	1,366,016.00	0.11
396	601333	广深铁路	604,800	1,354,752.00	0.10
397	000758	中色股份	245,928	1,342,766.88	0.10
398	000671	阳光城	442,400	1,336,048.00	0.10
399	000089	深圳机场	182,200	1,333,704.00	0.10
400	003022	联泓新科	35,900	1,308,196.00	0.10
401	600582	天地科技	297,200	1,301,736.00	0.10
402	600376	首开股份	229,900	1,301,234.00	0.10
403	000415	渤海租赁	441,700	1,285,347.00	0.10
404	000718	苏宁环球	269,900	1,271,229.00	0.10
405	601598	中国外运	283,400	1,269,632.00	0.10
406	688289	圣湘生物	21,500	1,268,500.00	0.10
407	002242	九阳股份	54,400	1,262,080.00	0.10
408	600126	杭钢股份	243,127	1,247,241.51	0.10
409	600062	华润双鹤	93,220	1,246,351.40	0.10
410	601975	招商南油	620,000	1,246,200.00	0.10
411	000967	盈峰环境	169,800	1,244,634.00	0.10
412	600307	酒钢宏兴	559,300	1,230,460.00	0.09
413	601098	中南传媒	128,293	1,227,764.01	0.09
414	002458	益生股份	107,384	1,214,513.04	0.09
415	000402	金融街	214,200	1,212,372.00	0.09
416	600556	天下秀	97,000	1,197,950.00	0.09
417	001965	招商公路	155,600	1,193,452.00	0.09
418	601958	金钼股份	172,900	1,184,365.00	0.09
419	600959	江苏有线	358,901	1,180,784.29	0.09
420	600643	爱建集团	173,100	1,170,156.00	0.09
421	002399	海普瑞	67,120	1,147,752.00	0.09

422	000563	陕国投 A	352,240	1,137,735.20	0.09
423	300257	开山股份	71,600	1,137,008.00	0.09
424	600056	中国医药	95,800	1,131,398.00	0.09
425	003035	南网能源	134,600	1,115,834.00	0.09
426	002563	森马服饰	143,400	1,108,482.00	0.09
427	601928	凤凰传媒	136,000	1,100,240.00	0.08
428	600266	城建发展	243,808	1,097,136.00	0.08
429	601860	紫金银行	327,400	1,096,790.00	0.08
430	600717	天津港	259,735	1,088,289.65	0.08
431	600901	江苏租赁	213,700	1,087,733.00	0.08
432	603317	天味食品	40,522	1,086,394.82	0.08
433	300741	华宝股份	22,700	1,086,195.00	0.08
434	600968	海油发展	363,400	1,064,762.00	0.08
435	002815	崇达技术	62,000	1,044,700.00	0.08
436	000937	冀中能源	189,000	1,041,390.00	0.08
437	002244	滨江集团	222,000	1,034,520.00	0.08
438	000717	韶钢松山	215,900	1,025,525.00	0.08
439	600095	湘财股份	101,200	1,024,144.00	0.08
440	600928	西安银行	238,100	1,023,830.00	0.08
441	002423	中粮资本	124,100	1,005,210.00	0.08
442	000028	国药一致	27,100	1,002,158.00	0.08
443	002468	申通快递	109,600	996,264.00	0.08
444	600787	中储股份	158,373	988,247.52	0.08
445	600776	东方通信	85,600	985,256.00	0.08
446	600006	东风汽车	142,000	967,020.00	0.07
447	002424	贵州百灵	126,900	964,440.00	0.07
448	000062	深圳华强	55,970	964,363.10	0.07
449	600729	重庆百货	36,578	951,759.56	0.07
450	600649	城投控股	226,887	932,505.57	0.07
451	600623	华谊集团	101,400	922,740.00	0.07
452	600339	中油工程	297,500	916,300.00	0.07
453	600835	上海机电	57,000	907,440.00	0.07
454	300869	康泰医学	22,300	904,265.00	0.07
455	601139	深圳燃气	102,050	901,101.50	0.07
456	002375	亚厦股份	120,200	900,298.00	0.07
457	600299	安迪苏	72,800	896,896.00	0.07
458	600648	外高桥	67,700	895,671.00	0.07
459	601969	海南矿业	73,000	876,730.00	0.07
460	000031	大悦城	229,300	855,289.00	0.07
461	000156	华数传媒	99,400	840,924.00	0.06
462	000869	张裕 A	24,700	786,942.00	0.06
463	002653	海思科	38,500	785,400.00	0.06

464	600871	石化油服	363,500	777,890.00	0.06
465	600639	浦东金桥	60,400	771,308.00	0.06
466	600377	宁沪高速	89,200	768,904.00	0.06
467	603379	三美股份	33,020	752,195.60	0.06
468	601828	美凯龙	84,110	741,009.10	0.06
469	601869	长飞光纤	22,600	739,924.00	0.06
470	601228	广州港	219,900	732,267.00	0.06
471	002302	西部建设	90,900	729,927.00	0.06
472	603708	家家悦	43,600	725,504.00	0.06
473	601298	青岛港	126,400	719,216.00	0.06
474	000046	泛海控股	375,300	705,564.00	0.05
475	601156	东航物流	31,600	691,408.00	0.05
476	001872	招商港口	40,700	689,865.00	0.05
477	002948	青岛银行	147,000	680,610.00	0.05
478	600823	世茂股份	202,500	664,200.00	0.05
479	002945	华林证券	48,500	662,510.00	0.05
480	000553	安道麦 A	78,400	661,696.00	0.05
481	603719	良品铺子	15,200	645,544.00	0.05
482	603355	莱克电气	21,380	626,861.60	0.05
483	603786	科博达	7,800	626,340.00	0.05
484	001203	大中矿业	40,500	610,740.00	0.05
485	601568	北元集团	72,100	586,173.00	0.05
486	600350	山东高速	112,900	582,564.00	0.04
487	600657	信达地产	154,600	576,658.00	0.04
488	603515	欧普照明	27,620	573,391.20	0.04
489	603056	德邦股份	54,800	560,604.00	0.04
490	600466	蓝光发展	272,840	556,593.60	0.04
491	601665	齐鲁银行	89,500	499,410.00	0.04
492	002946	新乳业	31,300	498,922.00	0.04
493	601003	柳钢股份	92,100	480,762.00	0.04
494	600917	重庆燃气	56,000	469,840.00	0.04
495	600956	新天绿能	26,000	447,460.00	0.03
496	600903	贵州燃气	41,096	397,809.28	0.03
497	002901	大博医疗	7,700	389,774.00	0.03
498	603868	飞科电器	8,500	369,070.00	0.03
499	601187	厦门银行	51,600	356,040.00	0.03
500	603983	丸美股份	10,300	328,261.00	0.03

### 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	688176	亚虹医药	37,990	873,010.20	0.07

2	688707	振华新材	8,130	383,410.80	0.03
3	688690	纳微科技	3,477	277,534.14	0.02
4	301166	优宁维	2,528	258,233.50	0.02
5	688076	诺泰生物	4,984	205,988.72	0.02
6	688767	博拓生物	2,220	147,363.60	0.01
7	688296	和达科技	2,173	107,932.91	0.01
8	688786	悦安新材	1,513	81,717.13	0.01
9	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.01
10	301177	迪阿股份	641	74,407.28	0.01
11	688787	海天瑞声	817	71,364.95	0.01
12	301087	可孚医疗	763	57,484.42	0.00
13	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
14	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
15	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
16	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
17	301127	天源环保	1,685	28,847.20	0.00
18	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
19	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
20	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
21	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
22	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
23	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
24	301082	久盛电气	944	20,421.18	0.00
25	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
26	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
27	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
28	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
29	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
30	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
31	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
32	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
33	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
34	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
35	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
36	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
37	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
38	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
39	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
40	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
41	301185	鸥玛软件	578	12,230.48	0.00
42	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
43	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00

44	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
45	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
46	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
47	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
48	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
49	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
50	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
51	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
52	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
53	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
54	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
55	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
56	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
57	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
58	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
59	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
60	301083	百胜智能	416	5,911.36	0.00
61	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
62	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
63	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
64	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
65	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
66	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
67	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
68	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
69	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
70	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
71	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	000799	酒鬼酒	11,962,330.57	0.61
2	600522	中天科技	7,788,116.95	0.40
3	000733	振华科技	7,512,423.00	0.39
4	600157	永泰能源	7,248,319.00	0.37
5	300751	迈为股份	7,086,514.00	0.36
6	605358	立昂微	6,711,895.81	0.34
7	600399	抚顺特钢	6,442,870.00	0.33
8	601555	东吴证券	6,211,571.30	0.32
9	002384	东山精密	6,134,258.00	0.31

10	300037	新宙邦	6,116,290.00	0.31
11	601868	中国能建	5,991,345.00	0.31
12	300253	卫宁健康	5,940,283.00	0.30
13	688005	容百科技	5,936,838.49	0.30
14	601636	旗滨集团	5,928,909.00	0.30
15	300363	博腾股份	5,567,268.00	0.29
16	002422	科伦药业	5,302,382.00	0.27
17	603456	九洲药业	5,103,379.45	0.26
18	300308	中际旭创	5,087,098.00	0.26
19	002439	启明星辰	5,084,609.00	0.26
20	600298	安琪酵母	5,062,237.00	0.26

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	300274	阳光电源	34,752,283.71	1.78
2	002709	天赐材料	23,962,995.04	1.23
3	002074	国轩高科	19,817,570.17	1.02
4	300012	华测检测	19,012,066.59	0.98
5	600089	特变电工	17,302,675.20	0.89
6	300207	欣旺达	16,458,002.03	0.84
7	300496	中科创达	15,102,141.22	0.77
8	300316	晶盛机电	14,295,677.00	0.73
9	300595	欧普康视	14,211,637.83	0.73
10	000799	酒鬼酒	11,892,899.62	0.61
11	002568	百润股份	11,590,928.08	0.59
12	002791	坚朗五金	10,796,802.00	0.55
13	600460	士兰微	10,741,539.64	0.55
14	002625	光启技术	10,641,692.00	0.55
15	600426	华鲁恒升	10,121,213.70	0.52
16	603882	金域医学	9,719,749.92	0.50
17	600132	重庆啤酒	9,254,709.00	0.47
18	002648	卫星化学	8,945,345.61	0.46
19	603486	科沃斯	8,365,137.00	0.43
20	300285	国瓷材料	8,330,001.15	0.43

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	695,143,970.28
卖出股票收入（成交）总额	1,186,006,669.65

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

代 码	名 称	持仓量（买/ 卖）	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IC2201	IC2201	7	10,328,920.0 0	185,080.00	-
IC2203	IC2203	17	24,839,720.0 0	394,120.00	-
公允价值变动总额合计（元）					579,200.00
股指期货投资本期收益（元）					9,756,815.52
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-636,440.00

#### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金以套期保值为目的开展股指期货投资，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

### 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

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

#### 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	6,245,026.74
2	应收证券清算款	5,119,023.26
3	应收股利	3,400.00
4	应收利息	31,291.05
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,398,741.05

#### 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

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	600885	宏发股份	1,761,504.00	0.14	转融通流通受限
2	002340	格林美	445,050.00	0.03	转融通流通受限
3	000009	中国宝安	334,776.00	0.03	转融通流通受限
4	000723	美锦能源	334,338.00	0.03	转融通流通受限
5	600884	杉杉股份	330,977.00	0.03	转融通流通受限

					限
6	600522	中天科技	230,656.00	0.02	转融通流通受限
7	600157	永泰能源	210,392.00	0.02	转融通流通受限

### 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	873,010.20	0.07	新股锁定
2	688707	振华新材	383,410.80	0.03	新股锁定
3	301166	优宁维	23,908.50	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

#### 9.1.1 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 (%)
921	190,647.25	173,032,926.00	98.55	2,553,195.00	1.45

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
平安 500ETF 联接基金	53,440,243.00	30.4353

### 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	中国平安人寿保险股份有限公司-万能-一个险万能	85,273,882.00	48.57
2	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-一个险分红	22,430,219.00	12.77
3	国信证券股份有限公司	4,051,969.00	2.31
4	北京时代复兴投资管	2,800,000.00	1.59

	理有限公司-时代复兴安心 1 号私募证券投资基金		
5	方正证券股份有限公司	2,400,000.00	1.37
6	东方证券股份有限公司融券专用证券账户	1,461,200.00	0.83
7	大杨集团有限责任公司	500,572.00	0.29
8	中国平安人寿保险股份有限公司-传统-银保账户	237,800.00	0.14
9	黎旭晖	236,286.00	0.13
10	华泰证券股份有限公司	226,346.00	0.13
11	平安银行股份有限公司-平安大华中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	53,440,243.00	30.44

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

### 9.5 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（2018 年 3 月 23 日）基金份额总额	2,648,875,604.00
本报告期期初基金份额总额	285,186,121.00
本报告期基金总申购份额	38,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	147,600,000.00
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	175,586,121.00

## § 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. 2021 年 1 月 26 日，根据工作安排，陈正涛先生不再担任平安银行股份有限公司资产托管事业部总裁。2021 年 2 月 26 日，平安银行股份有限公司任命黄伟先生担任资产托管事业部副总裁（主持工作）。

### 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 4 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 100,000.00 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	
方正证券	2	961,574,389.39	52.09%	683,976.05	52.09%	-
中信证券	3	768,423,974.11	41.63%	546,552.07	41.62%	-
东吴证券	2	44,257,215.6	2.40%	31,481.21	2.40%	-

		6				
光大证券	2	35,120,562.27	1.90%	24,981.18	1.90%	-
国泰君安证券	1	26,145,336.76	1.42%	18,598.46	1.42%	-
兴业证券	1	7,498,028.22	0.41%	5,333.32	0.41%	-
国盛证券	1	2,428,082.99	0.13%	1,727.17	0.13%	-
天风证券	2	560,327.37	0.03%	398.69	0.03%	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
大通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	新增 1个
国信证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	新增 1个
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	退租 2个

中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-

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。其中中信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
方正证券	-	-	13,000,000.00	0.58%	-	-
中信证券	-	-	1,779,000,000.00	79.42%	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	438,000,000.00	19.55%	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	10,000,000.00	0.45%	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
大通证券	-	-	-	-	-	-

东北证券	-	-	-	-	-	-
东方财富 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源 证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
中国国际 金融股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
中银国际 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 500 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	平安中证 500 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 01 日
4	平安中证 500 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 01 日
5	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
6	平安中证 500 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
7	平安中证 500 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
9	平安中证 500 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
10	平安中证 500 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
11	平安中证 500 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 22 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 500 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 21 日
17	平安中证 500 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	平安中证 500 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 27 日
19	平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	中国证监会规定报刊及网站	2021 年 11 月 02 日
20	平安中证 500 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 11 月 29 日
21	平安中证 500 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 11 月 29 日
22	平安基金管理有限公司关于旗下基金	中国证监会规定报刊及	2021 年 12 月 20 日



新增开源证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	网站
--------------------------	----

## § 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--2021/02/01	82,749,719.00	-	60,319,500.00	22,430,219.00	12.77
	2	2021/01/01--2021/12/31	107,123,882.00	-	21,850,000.00	85,273,882.00	48.57
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	3	2021/01/01--2021/12/31	72,404,312.00	39,869,960.00	58,834,029.00	53,440,243.00	30.44
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>							

### 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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安中证 500 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