

# 平安中证畜牧养殖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：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2021 年 03 月 04 日（基金合同生效日）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         |
| 3.3 过去三年基金的利润分配情况                       | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 12        |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 12        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 13        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 13        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 13        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 14        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 14        |
| 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       | 14        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>14</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 14        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见       | 15        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>15</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 15        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 15        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>17</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 17        |
| 7.2 利润表                                 | 18        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 19        |
| 7.4 报表附注                                | 20        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>45</b> |

|                                                    |           |
|----------------------------------------------------|-----------|
| 8.1 期末基金资产组合情况 .....                               | 45        |
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                         | 46        |
| 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 .....            | 47        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                          | 50        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                         | 51        |
| 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 .....           | 51        |
| 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 .....        | 51        |
| 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 .....        | 51        |
| 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 .....           | 51        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....                    | 51        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....                    | 52        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                                | 52        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                         | <b>53</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                        | 53        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                             | 53        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....                     | 54        |
| 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 .....             | 54        |
| 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 ..... | 54        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                        | <b>54</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                           | <b>54</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                             | 54        |
| 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 .....             | 54        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....                  | 55        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                               | 55        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                        | 55        |
| 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 .....                | 55        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....                       | 55        |
| 11.8 其他重大事件 .....                                  | 56        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>                   | <b>57</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 .....           | 57        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                          | 57        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                           | <b>57</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                                  | 57        |
| 13.2 存放地点 .....                                    | 57        |
| 13.3 查阅方式 .....                                    | 58        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                        |
|--------------|------------------------|
| 基金名称         | 平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 平安中证畜牧养殖 ETF           |
| 场内简称         | 养殖 ETF                 |
| 基金主代码        | 516760                 |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                 |
| 基金合同生效日      | 2021 年 3 月 4 日         |
| 基金管理人        | 平安基金管理有限公司             |
| 基金托管人        | 招商银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额   | 158,215,079.00 份       |
| 基金合同存续期      | 不定期                    |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所                |
| 上市日期         | 2021 年 3 月 12 日        |

### 2.2 基金产品说明

|        |                                                                                                                                                                                                               |
|--------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。                                                                                                                                     |
| 投资策略   | 本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。 |
| 业绩比较基准 | 中证畜牧养殖指数收益率                                                                                                                                                                                                   |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为被动式投资的股票型指数基金，跟踪中证畜牧养殖指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金若投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。                                                |

### 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                | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 陈特正                       | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 0755-22626828             | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | fundservice@pingan.com.cn | yan_zhang@cmbchina.com |

|        |                                 |                      |
|--------|---------------------------------|----------------------|
| 客户服务电话 | 400-800-4800                    | 95555                |
| 传真     | 0755-23997878                   | 0755-83195201        |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码   | 518048                          | 518040               |
| 法定代表人  | 罗春风                             | 缪建民                  |

## 2.4 信息披露方式

|                     |                                                                     |
|---------------------|---------------------------------------------------------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称      | 证券日报                                                                |
| 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 3 月 4 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------------------------|
| 本期已实现收益       | -9,820,208.52                            |
| 本期利润          | -9,484,082.53                            |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.0500                                  |
| 本期加权平均净值利润率   | -5.75%                                   |
| 本期基金份额净值增长率   | -6.40%                                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末                                  |
| 期末可供分配利润      | -10,130,119.63                           |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.0640                                  |
| 期末基金资产净值      | 148,084,959.37                           |
| 期末基金份额净值      | 0.9360                                   |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末                                  |
| 基金份额累计净值增长率   | -6.40%                                   |

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。

4. 本基金合同于 2021 年 3 月 4 日正式生效, 截止报告期末未满一年。

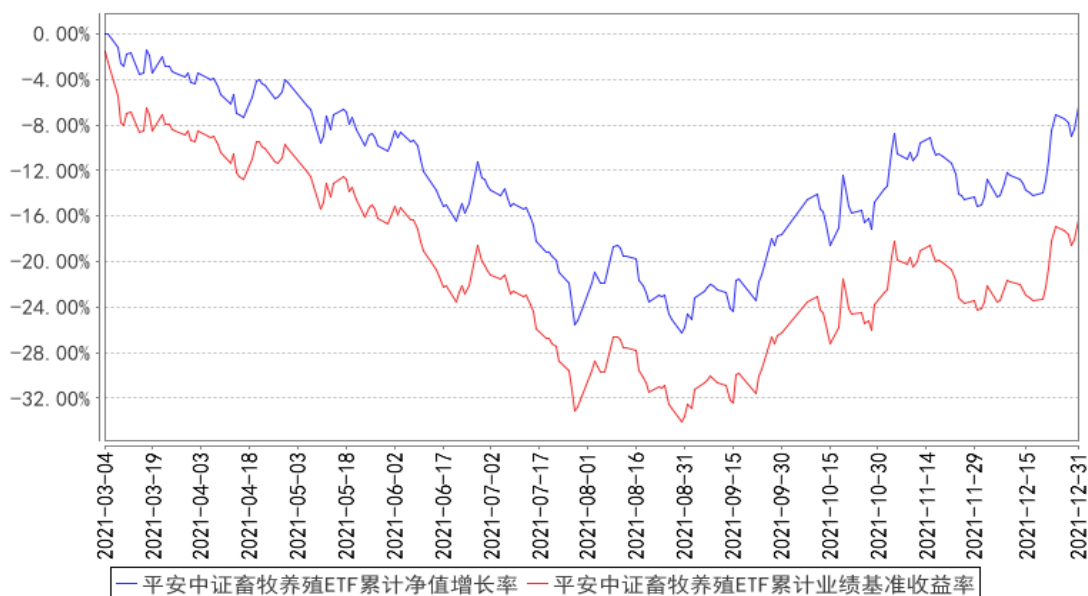
## 3.2 基金净值表现

### 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      | 13.62%   | 1.51%       | 13.60%     | 1.57%         | 0.02% | -0.06% |
| 过去六个月      | 7.38%    | 1.47%       | 5.04%      | 1.53%         | 2.34% | -0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | -6.40%   | 1.36%       | -16.30%    | 1.44%         | 9.90% | -0.08% |

### 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

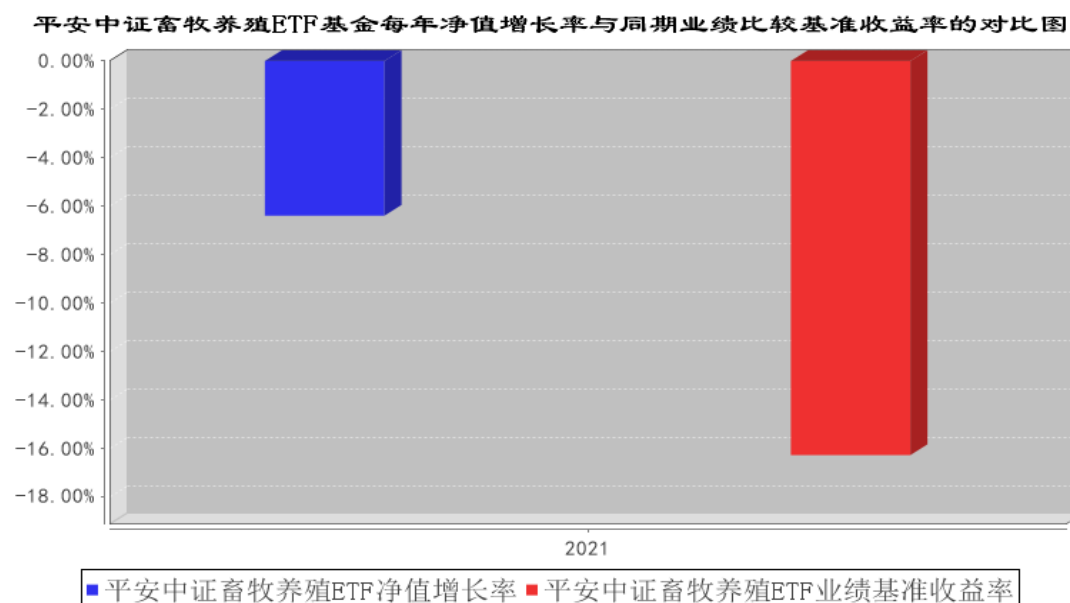
平安中证畜牧养殖ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注: 1、本基金基金合同于 2021 年 03 月 04 日正式生效, 截至报告期末未满一年;

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



注：1. 本基金合同于 2021 年 03 月 04 日正式生效；

2. 2021 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金基金合同于2021年3月4日正式生效，自基金合同生效日至报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本金为 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 |        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                            |
| 刘 洁 倩 | 平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理               | 2021 年 3 月 4 日  | -    | 8 年    | 刘洁倩女士，浙江大学博士，曾担任国泰基金管理有限公司产品研究主管。2018 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心指数研究员、基金经理助理。现任平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。                                                                                                                                                               |
| 钱 晶   | ETF 指数中心投资副总监，平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理 | 2021 年 3 月 4 日  | -    | 10 年   | 钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数中心投资副总监，同时担任平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新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、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |
| 王 宁 宁 | 平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理             | 2021 年 3 月 15 日 | -    | 4 年    | 王宁宁女士，法国雷恩高等商学院硕士，曾任平安道远投资管理（上海）有限公司量化投资部助理产品经理，2018 年 11 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心指数研究员，同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资                                                                                                                                                                                                                                                               |

|       |                              |                |   |     |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               |
|-------|------------------------------|----------------|---|-----|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|       |                              |                |   |     | 基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、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 | 平安中证畜牧养殖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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                    |

|  |  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | <p>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。</p> |
|--|--|--|--|--|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

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

本基金投资于中证畜牧养殖指数。在投资管理上，采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 0.9360 元，本报告期基金份额净值增长率为-6.40%，业绩比较基准收益率为-16.30%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对

员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

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

## § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 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 21072 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         | 平安中证畜牧养殖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畜牧养殖 ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间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。<br>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安中证畜牧养殖 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。                                                          |
| 强调事项            | —                                                                                                                                                                                                                         |
| 其他事项            | —                                                                                                                                                                                                                         |
| 其他信息            | —                                                                                                                                                                                                                         |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 平安中证畜牧养殖 ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。<br>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安中证畜                                         |

|                 |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |
|-----------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----|
|                 | <p>牧养殖 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安中证畜牧养殖 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安中证畜牧养殖 ETF 基金的财务报告过程。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |    |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安中证畜牧养殖 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安中证畜牧养殖 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <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 3 月 25 日                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |    |



## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：平安中证畜牧养殖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<br>2021 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资 产：</b>     |            |                                 |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 3,974,887.70                    |
| 结算备付金           |            | 271,633.54                      |
| 存出保证金           |            | 43,474.55                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 144,117,788.59                  |
| 其中：股票投资         |            | 144,117,788.59                  |
| 基金投资            |            | -                               |
| 债券投资            |            | -                               |
| 资产支持证券投资        |            | -                               |
| 贵金属投资           |            | -                               |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               |
| 应收证券清算款         |            | 191,395.18                      |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 582.33                          |
| 应收股利            |            | -                               |
| 应收申购款           |            | -                               |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | 7,105.84                        |
| 资产总计            |            | 148,606,867.73                  |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 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         |            | 68,226.62                       |
| 应付托管费           |            | 13,645.34                       |
| 应付销售服务费         |            | -                               |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 114,879.91                      |
| 应交税费            |            | -                               |
| 应付利息            |            | -                               |

|               |          |                |
|---------------|----------|----------------|
| 应付利润          |          | -              |
| 递延所得税负债       |          | -              |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 325,156.49     |
| 负债合计          |          | 521,908.36     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 158,215,079.00 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -10,130,119.63 |
| 所有者权益合计       |          | 148,084,959.37 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 148,606,867.73 |

注：1. 本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日止期间。

2. 报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9360 元，基金份额总额 158,215,079.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------------------|------------|-------------------------------------------------|
| 一、收入                   |            | -7,718,343.98                                   |
| 1. 利息收入                |            | 105,439.78                                      |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 89,975.01                                       |
| 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             |            | 15,464.77                                       |
| 证券出借利息收入               |            | -                                               |
| 其他利息收入                 |            | -                                               |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -8,668,294.67                                   |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -10,505,737.64                                  |
| 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   | -                                               |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 1,837,442.97                                    |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | 336,125.99                                      |
| 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   | 508,384.92                                      |

|                     |            |               |
|---------------------|------------|---------------|
| 减：二、费用              |            | 1,765,738.55  |
| 1. 管理人报酬            | 7.4.10.2.1 | 681,116.13    |
| 2. 托管费              | 7.4.10.2.2 | 136,223.29    |
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | -             |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.19   | 655,083.28    |
| 5. 利息支出             |            | -             |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -             |
| 6. 税金及附加            |            | -             |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.20   | 293,315.85    |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) |            | -9,484,082.53 |
| 减：所得税费用             |            | -             |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列)   |            | -9,484,082.53 |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 3 月 4 日(基金合同生效日)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)                        | 225,215,079.00                                  | -              | 225,215,079.00  |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | -                                               | -9,484,082.53  | -9,484,082.53   |
| 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)      | -67,000,000.00                                  | -646,037.10    | -67,646,037.10  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 153,000,000.00                                  | -22,996,492.94 | 130,003,507.06  |
| 2. 基金赎回款                               | -220,000,000.00                                 | 22,350,455.84  | -197,649,544.16 |
| 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)                        | 158,215,079.00                                  | -10,130,119.63 | 148,084,959.37  |

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：

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]365 号《关于准予平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证畜牧养殖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 225,214,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0228 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 225,215,079.00 份,其中认购资金利息折合 1,079.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]100 号审核同意,本基金 225,215,079.00 份基金份额于 2021 年 3 月 12 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数表现,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;本基金主要投资于标的指数的成份股及其备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、港股通标的股票、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、分离交易可转债的纯债部分、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债、政府支持债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权、银行存款(包括协议存款、通知存款以及定期存款等其他银行存款)、同业存单、资产支持证券、债券回购、现金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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的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%;投资港股通标的股票的比例不超过本基金股票

资产的 10%。本基金在每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证畜牧养殖指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安中证畜牧养殖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 03 月 04 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的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 03 月 04 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2021 年 03 月 04 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

##### 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 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴

20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目             | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|----------------|-------------------------|
| 活期存款           | 3,974,887.70            |
| 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             | 3,974,887.70            |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |                |            |
|---------------|-------------------------|----------------|------------|
|               | 成本                      | 公允价值           | 公允价值变动     |
| 股票            | 143,781,662.60          | 144,117,788.59 | 336,125.99 |
| 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            | 143,781,662.60          | 144,117,788.59 | 336,125.99 |

注：于 2021 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为

零。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末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<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|
| 应收活期存款利息   | 426.46                  |
| 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  | 134.42                  |
| 应收债券利息     | —                       |
| 应收资产支持证券利息 | —                       |
| 应收买入返售证券利息 | —                       |
| 应收申购款利息    | —                       |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —                       |
| 应收出借证券利息   | —                       |
| 其他         | 21.45                   |
| 合计         | 582.33                  |

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

| 项目    | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------|-------------------------|
| 其他应收款 | —                       |
| 待摊费用  | —                       |
| 现金差额  | 7,105.84                |
| 合计    | 7,105.84                |

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 114,879.91              |
| 银行间市场应付交易费用 | —                       |
| 合计          | 114,879.91              |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 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        | 166,164.38              |
| 应退替代款       | 158,992.11              |
| 合计          | 325,156.49              |

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

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |                 |
|---------------|-------------------------------------------------|-----------------|
|               | 基金份额（份）                                         | 账面金额            |
| 基金合同生效日       | 225,215,079.00                                  | 225,215,079.00  |
| 本期申购          | 153,000,000.00                                  | 153,000,000.00  |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -220,000,000.00                                 | -220,000,000.00 |
| 基金拆分/份额折算前    | —                                               | —               |
| 基金拆分/份额折算调整   | —                                               | —               |
| 本期申购          | —                                               | —               |
| 本期赎回（以“-”号填列） | —                                               | —               |
| 本期末           | 158,215,079.00                                  | 158,215,079.00  |

注：1. 本基金自 2021 年 2 月 24 日至 2021 年 2 月 26 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 225,214,000.00 元，折合为 225,214,000.00 份基金份额。根据《平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 1,079.00 元在本基金成立后，折合为 1,079.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及 2021 年 3 月 9 日发布的《平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 3 月 11 日止期间暂不向投资人开放基金交易，基金交易申购、赎回业务自 2021 年 3 月 12 日起开始办理。

#### 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       |
|---------|---------------|------------|---------------|
| 基金合同生效日 | —             | —          | —             |
| 本期利润    | -9,820,208.52 | 336,125.99 | -9,484,082.53 |

|                |               |                |                |
|----------------|---------------|----------------|----------------|
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,226,973.42  | -2,873,010.52  | -646,037.10    |
| 其中：基金申购款       | -2,262,358.67 | -20,734,134.27 | -22,996,492.94 |
| 基金赎回款          | 4,489,332.09  | 17,861,123.75  | 22,350,455.84  |
| 本期已分配利润        | -             | -              | -              |
| 本期末            | -7,593,235.10 | -2,536,884.53  | -10,130,119.63 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年3月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-----------|--------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 26,386.55                            |
| 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 | 7,417.98                             |
| 其他        | 56,170.48                            |
| 合计        | 89,975.01                            |

#### 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<br>2021年3月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|------------------|--------------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -8,174,952.88                        |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -2,330,784.76                        |
| 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               | -10,505,737.64                       |

##### 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<br>2021年3月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|------------|--------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 201,893,656.02                       |
| 减：卖出股票成本总额 | 210,068,608.90                       |
| 买卖股票差价收入   | -8,174,952.88                        |

##### 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<br>2021年3月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
|-------------|--------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 197,649,544.16                       |
| 减：现金支付赎回款总额 | 161,448,511.16                       |

|            |               |
|------------|---------------|
| 减：赎回股票成本总额 | 38,531,817.76 |
| 赎回差价收入     | -2,330,784.76 |

#### 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：本基金本报告期内无股票投资收益。

### 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：本基金本报告期内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：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|-------------------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 1,837,442.97                                    |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | -                                               |
| 基金投资产生的股利收益   | -                                               |
| 合计            | 1,837,442.97                                    |

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                   | 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|------------------------|-------------------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产             | 336,125.99                                      |
| 股票投资                   | 336,125.99                                      |
| 债券投资                   | -                                               |
| 资产支持证券投资               | -                                               |
| 基金投资                   | -                                               |
| 贵金属投资                  | -                                               |
| 其他                     | -                                               |
| 2. 衍生工具                | -                                               |
| 权证投资                   | -                                               |
| 3. 其他                  | -                                               |
| 减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税 | -                                               |
| 合计                     | 336,125.99                                      |

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

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|---------|-------------------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                                               |
| 替代损益    | 508,384.92                                      |
| 合计      | 508,384.92                                      |

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

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|-----------|-------------------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 655,083.28                                      |
| 银行间市场交易费用 | —                                               |
| 合计        | 655,083.28                                      |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年<br>12 月 31 日 |
|---------|----------------------------------------------------|
| 审计费用    | 50,000.00                                          |
| 信息披露费   | 100,000.00                                         |
| 证券出借违约金 | —                                                  |
| 银行费用    | 2,151.47                                           |
| 其他      | 141,164.38                                         |
| 合计      | 293,315.85                                         |

#### 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               |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”）       | 基金托管人               |
| 大华资产管理有限公司               | 基金管理人的股东            |
| 三亚盈湾旅业有限公司               | 基金管理人的股东            |
| 平安信托有限责任公司               | 基金管理人的股东            |
| 深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”）   | 基金管理人的子公司           |
| 平安证券股份有限公司（“平安证券”）       | 基金管理人的股东的子公司、基金销售机构 |
| 中国平安保险（集团）股份有限公司（“平安集团”） | 基金管理人的最终控股母公司       |

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

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内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

注：本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

##### 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 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 681,116.13                                |
| 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 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 136,223.29                                |

注：支付基金托管行招商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：本基金本报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

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

注：本基金本报告期内转融通证券出借业务均未发生重大关联交易事项。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：无。

#### 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<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |           |
|---------|-------------------------------------------------|-----------|
|         | 期末余额                                            | 当期利息收入    |
| 招商银行-活期 | 3,974,887.70                                    | 26,386.55 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 本期<br>2021 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |        |      |      |           |          |
|-------------------------------------------------|--------|------|------|-----------|----------|
| 关联方名称                                           | 证券代码   | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 |          |
|                                                 |        |      |      | 数量（单位：张）  | 总金额      |
| 平安证券                                            | 605011 | 杭州热电 | 公开发行 | 525       | 3,239.25 |

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

## 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |                 |                  |        |       |        |          |          |           |    |
|----------------------|------|-----------------|------------------|--------|-------|--------|----------|----------|-----------|----|
| 证券代码                 | 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  | 323      | 3,843.70 | 14,680.35 | -  |
| 301018               | 申菱环境 | 2021 年 6 月 28 日 | 2022 年 1 月 7 日   | 新股锁定   | 8.29  | 26.06  | 782      | 6,482.78 | 20,378.92 | -  |
| 301020               | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日 | 2022 年 1 月 6 日   | 新股锁定   | 10.64 | 30.44  | 421      | 4,479.44 | 12,815.24 | -  |
| 301021               | 英诺激光 | 2021 年 6 月 28 日 | 2022 年 1 月 6 日   | 新股锁定   | 9.46  | 41.43  | 290      | 2,743.40 | 12,014.70 | -  |
| 301026               | 浩通科技 | 2021 年 7 月 8 日  | 2022 年 1 月 17 日  | 新股锁定   | 18.03 | 62.73  | 203      | 3,660.09 | 12,734.19 | -  |
| 301027               | 华蓝集团 | 2021 年 7 月 8 日  | 2022 年 01 月 19 日 | 新股锁定   | 11.45 | 16.65  | 286      | 3,274.70 | 4,761.90  | -  |
| 301028               | 东亚机械 | 2021 年 7 月 12 日 | 2022 年 1 月 20 日  | 新股锁定   | 5.31  | 13.50  | 635      | 3,371.85 | 8,572.50  | -  |
| 301029               | 怡合达  | 2021 年 7 月 14 日 | 2022 年 1 月 24 日  | 新股锁定   | 14.14 | 89.87  | 373      | 5,274.22 | 33,521.51 | -  |
| 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  | 196      | 4,319.84 | 11,030.88 | -  |

|        |          |                       |                        |          |       |       |       |          |           |   |
|--------|----------|-----------------------|------------------------|----------|-------|-------|-------|----------|-----------|---|
| 301036 | 双乐股份     | 2021 年<br>7 月 21<br>日 | 2022 年<br>02 月 16<br>日 | 新股锁<br>定 | 23.38 | 29.93 | 162   | 3,787.56 | 4,848.66  | - |
| 301037 | 保立佳      | 2021 年<br>7 月 21<br>日 | 2022 年<br>2 月 7<br>日   | 新股锁<br>定 | 14.82 | 24.26 | 193   | 2,860.26 | 4,682.18  | - |
| 301038 | 深水规<br>院 | 2021 年<br>7 月 22<br>日 | 2022 年<br>2 月 7<br>日   | 新股锁<br>定 | 6.68  | 20.23 | 266   | 1,776.88 | 5,381.18  | - |
| 301040 | 中环海<br>陆 | 2021 年<br>7 月 26<br>日 | 2022 年<br>2 月 7<br>日   | 新股锁<br>定 | 13.57 | 38.51 | 241   | 3,270.37 | 9,280.91  | - |
| 301041 | 金百泽      | 2021 年<br>8 月 2 日     | 2022 年<br>2 月 11<br>日  | 新股锁<br>定 | 7.31  | 28.21 | 215   | 1,571.65 | 6,065.15  | - |
| 301045 | 天禄科<br>技 | 2021 年<br>8 月 6 日     | 2022 年<br>02 月 17<br>日 | 新股锁<br>定 | 15.81 | 28.37 | 335   | 5,296.35 | 9,503.95  | - |
| 301046 | 能辉科<br>技 | 2021 年<br>8 月 10<br>日 | 2022 年<br>2 月 17<br>日  | 新股锁<br>定 | 8.34  | 48.99 | 290   | 2,418.60 | 14,207.10 | - |
| 301048 | 金鹰重<br>工 | 2021 年<br>8 月 11<br>日 | 2022 年<br>02 月 28<br>日 | 新股锁<br>定 | 4.13  | 12.96 | 814   | 3,361.82 | 10,549.44 | - |
| 301053 | 远信工<br>业 | 2021 年<br>8 月 25<br>日 | 2022 年<br>3 月 1<br>日   | 新股锁<br>定 | 11.87 | 28.78 | 155   | 1,839.85 | 4,460.90  | - |
| 301056 | 森赫股<br>份 | 2021 年<br>8 月 27<br>日 | 2022 年<br>3 月 7<br>日   | 新股锁<br>定 | 3.93  | 11.09 | 572   | 2,247.96 | 6,343.48  | - |
| 301057 | 汇隆新<br>材 | 2021 年<br>8 月 31<br>日 | 2022 年<br>3 月 9<br>日   | 新股锁<br>定 | 8.03  | 19.02 | 218   | 1,750.54 | 4,146.36  | - |
| 301058 | 中粮工<br>科 | 2021 年<br>9 月 1 日     | 2022 年<br>3 月 9<br>日   | 新股锁<br>定 | 3.55  | 18.24 | 1,386 | 4,920.30 | 25,280.64 | - |
| 301059 | 金三江      | 2021 年<br>9 月 3 日     | 2022 年<br>3 月 14<br>日  | 新股锁<br>定 | 8.09  | 19.30 | 259   | 2,095.31 | 4,998.70  | - |
| 301060 | 兰卫医<br>学 | 2021 年<br>9 月 6 日     | 2022 年<br>3 月 14<br>日  | 新股锁<br>定 | 4.17  | 30.94 | 587   | 2,447.79 | 18,161.78 | - |
| 301062 | 上海艾<br>录 | 2021 年<br>9 月 7 日     | 2022 年<br>3 月 14       | 新股锁<br>定 | 3.31  | 17.01 | 523   | 1,731.13 | 8,896.23  | - |

|        |      |                        | 日                     |          |       |       |     |           |           |   |
|--------|------|------------------------|-----------------------|----------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 301063 | 海锅股份 | 2021 年<br>9 月 9 日      | 2022 年<br>3 月 24<br>日 | 新股锁<br>定 | 17.40 | 36.11 | 153 | 2,662.20  | 5,524.83  | - |
| 301068 | 大地海洋 | 2021 年<br>9 月 16<br>日  | 2022 年<br>3 月 28<br>日 | 新股锁<br>定 | 13.98 | 28.38 | 144 | 2,013.12  | 4,086.72  | - |
| 301069 | 凯盛新材 | 2021 年<br>9 月 16<br>日  | 2022 年<br>3 月 28<br>日 | 新股锁<br>定 | 5.17  | 44.21 | 539 | 2,786.63  | 23,829.19 | - |
| 301072 | 中捷精工 | 2021 年<br>9 月 22<br>日  | 2022 年<br>3 月 29<br>日 | 新股锁<br>定 | 7.46  | 33.41 | 181 | 1,350.26  | 6,047.21  | - |
| 301073 | 君亭酒店 | 2021 年<br>9 月 22<br>日  | 2022 年<br>3 月 30<br>日 | 新股锁<br>定 | 12.24 | 32.00 | 144 | 1,762.56  | 4,608.00  | - |
| 301078 | 孩子王  | 2021 年<br>9 月 30<br>日  | 2022 年<br>4 月 14<br>日 | 新股锁<br>定 | 5.77  | 12.14 | 655 | 3,779.35  | 7,951.70  | - |
| 301079 | 邵阳液压 | 2021 年<br>10 月 11<br>日 | 2022 年<br>4 月 19<br>日 | 新股锁<br>定 | 11.92 | 24.82 | 140 | 1,668.80  | 3,474.80  | - |
| 301081 | 严牌股份 | 2021 年<br>10 月 13<br>日 | 2022 年<br>4 月 20<br>日 | 新股锁<br>定 | 12.95 | 17.44 | 345 | 4,467.75  | 6,016.80  | - |
| 301082 | 久盛电气 | 2021 年<br>10 月 14<br>日 | 2022 年<br>4 月 27<br>日 | 新股锁<br>定 | 15.48 | 21.53 | 770 | 11,919.60 | 16,578.10 | - |
| 301083 | 百胜智能 | 2021 年<br>10 月 13<br>日 | 2022 年<br>4 月 21<br>日 | 新股锁<br>定 | 9.08  | 14.21 | 416 | 3,777.28  | 5,911.36  | - |
| 301087 | 可孚医疗 | 2021 年<br>10 月 15<br>日 | 2022 年<br>4 月 25<br>日 | 新股锁<br>定 | 93.09 | 75.34 | 92  | 8,564.28  | 6,931.28  | - |
| 301089 | 拓新药业 | 2021 年<br>10 月 20<br>日 | 2022 年<br>4 月 27<br>日 | 新股锁<br>定 | 19.11 | 67.93 | 160 | 3,057.60  | 10,868.80 | - |
| 301090 | 华润材料 | 2021 年<br>10 月 19<br>日 | 2022 年<br>4 月 26<br>日 | 新股锁<br>定 | 10.45 | 11.22 | 633 | 6,614.85  | 7,102.26  | - |
| 301092 | 争光股份 | 2021 年<br>10 月 21<br>日 | 2022 年<br>5 月 5<br>日  | 新股锁<br>定 | 36.31 | 35.52 | 115 | 4,175.65  | 4,084.80  | - |
| 301093 | 华兰股  | 2021 年                 | 2022 年                | 新股锁      | 58.08 | 49.85 | 90  | 5,227.20  | 4,486.50  | - |

|        | 份    | 10月21<br>日          | 5月5<br>日           | 定         |        |        |       |           |           |   |
|--------|------|---------------------|--------------------|-----------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 301096 | 百诚医药 | 2021年<br>12月13<br>日 | 2022年<br>6月20<br>日 | 新股锁<br>定  | 79.60  | 78.53  | 55    | 4,378.00  | 4,319.15  | - |
| 301100 | 风光股份 | 2021年<br>12月10<br>日 | 2022年<br>6月17<br>日 | 新股锁<br>定  | 27.81  | 31.14  | 184   | 5,117.04  | 5,729.76  | - |
| 301101 | 明月镜片 | 2021年<br>12月9<br>日  | 2022年<br>6月16<br>日 | 新股锁<br>定  | 26.91  | 43.36  | 208   | 5,597.28  | 9,018.88  | - |
| 301111 | 粤万年青 | 2021年<br>11月30<br>日 | 2022年<br>6月7<br>日  | 新股锁<br>定  | 10.48  | 36.68  | 379   | 3,971.92  | 13,901.72 | - |
| 301127 | 天源环保 | 2021年<br>12月23<br>日 | 2022年<br>6月30<br>日 | 新股锁<br>定  | 12.03  | 17.12  | 583   | 7,013.49  | 9,980.96  | - |
| 301133 | 金钟股份 | 2021年<br>11月19<br>日 | 2022年<br>5月26<br>日 | 新股锁<br>定  | 14.33  | 26.95  | 286   | 4,098.38  | 7,707.70  | - |
| 301136 | 招标股份 | 2021年<br>12月31<br>日 | 2022年<br>1月11<br>日 | 新股未<br>上市 | 10.52  | 10.52  | 4,718 | 49,633.36 | 49,633.36 | - |
| 301149 | 隆华新材 | 2021年<br>11月3<br>日  | 2022年<br>5月10<br>日 | 新股锁<br>定  | 10.07  | 16.76  | 776   | 7,814.32  | 13,005.76 | - |
| 301168 | 通灵股份 | 2021年<br>12月2<br>日  | 2022年<br>6月10<br>日 | 新股锁<br>定  | 39.08  | 52.13  | 132   | 5,158.56  | 6,881.16  | - |
| 301177 | 迪阿股份 | 2021年<br>12月8<br>日  | 2022年<br>6月15<br>日 | 新股锁<br>定  | 116.88 | 116.08 | 86    | 10,051.68 | 9,982.88  | - |
| 301185 | 鸥玛软件 | 2021年<br>11月11<br>日 | 2022年<br>5月19<br>日 | 新股锁<br>定  | 11.88  | 21.16  | 529   | 6,284.52  | 11,193.64 | - |
| 301189 | 奥尼电子 | 2021年<br>12月21<br>日 | 2022年<br>6月28<br>日 | 新股锁<br>定  | 66.18  | 56.62  | 97    | 6,419.46  | 5,492.14  | - |
| 301190 | 善水科技 | 2021年<br>12月17<br>日 | 2022年<br>6月24<br>日 | 新股锁<br>定  | 27.85  | 27.46  | 163   | 4,539.55  | 4,475.98  | - |
| 301198 | 喜悦智行 | 2021年<br>11月25<br>日 | 2022年<br>6月2<br>日  | 新股锁<br>定  | 21.76  | 29.20  | 196   | 4,264.96  | 5,723.20  | - |

|        |          |                        |                       |          |       |       |     |          |          |   |
|--------|----------|------------------------|-----------------------|----------|-------|-------|-----|----------|----------|---|
| 301199 | 迈赫股份     | 2021 年<br>11 月 30<br>日 | 2022 年<br>6 月 7<br>日  | 新股锁<br>定 | 29.28 | 32.00 | 176 | 5,153.28 | 5,632.00 | - |
| 301221 | 光庭信<br>息 | 2021 年<br>12 月 15<br>日 | 2022 年<br>6 月 22<br>日 | 新股锁<br>定 | 69.89 | 88.72 | 88  | 6,150.32 | 7,807.36 | - |

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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 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

注：本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 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同责任，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发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

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

#### 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票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日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，并按照合约规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<br>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                    | 3,974,887.70 | -     | -     | -               | 3,974,887.70   |
| 结算备付金                   | 271,633.54   | -     | -     | -               | 271,633.54     |
| 存出保证金                   | 43,474.55    | -     | -     | -               | 43,474.55      |
| 交易性金融资产                 | -            | -     | -     | 144,117,788.59  | 144,117,788.59 |
| 应收利息                    | -            | -     | -     | 582.33          | 582.33         |
| 应收证券清算款                 | -            | -     | -     | 191,395.18      | 191,395.18     |
| 其他资产                    | -            | -     | -     | 7,105.84        | 7,105.84       |
| 资产总计                    | 4,289,995.79 | -     | -     | 144,316,871.94  | 148,606,867.73 |
| 负债                      |              |       |       |                 |                |
| 应付管理人报酬                 | -            | -     | -     | 68,226.62       | 68,226.62      |
| 应付托管费                   | -            | -     | -     | 13,645.34       | 13,645.34      |
| 应付交易费用                  | -            | -     | -     | 114,879.91      | 114,879.91     |
| 其他负债                    | -            | -     | -     | 325,156.49      | 325,156.49     |
| 负债总计                    | -            | -     | -     | 521,908.36      | 521,908.36     |
| 利率敏感度缺口                 | 4,289,995.79 | -     | -     | -143,794,963.58 | 148,084,959.37 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 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，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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<br>2021 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 144,117,788.59          | 97.32         |
| 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            | 144,117,788.59          | 97.32         |

#### 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<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |                           | 本期末（2021 年 12 月 31 日）           |
| 分析 | 沪深 300 指数上升<br>5%         | 3,335,296.07                    |
|    | 沪深 300 指数下降<br>5%         | -3,335,296.07                   |

#### 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 143,538,814.82 元，属于第二层次的余额为 49,633.36 元，属于第三层次的

余额为 529,340.41 元。

(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 3 月 4 日 -

购买 337,974.36

兑付 -

出售 -

转入第三层级 -

转出第三层级 -102,888.68

当期利得或损失总额 294,254.73

计入损益的利得或损失 294,254.73

2021 年 12 月 31 日 529,340.41

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 294,254.73

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 529,340.41 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。

(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 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间, 本基金申购基金份额的对价总额为 130,003,507.06 元, 其中包括以股票支付的申购款 23,108,449.64 元和以现金支付的申购款 106,895,057.42 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               | 144,117,788.59 | 96.98         |
|    | 其中: 股票             | 144,117,788.59 | 96.98         |
| 2  | 基金投资               | —              | —             |
| 3  | 固定收益投资             | —              | —             |
|    | 其中: 债券             | —              | —             |
|    | 资产支持证券             | —              | —             |
| 4  | 贵金属投资              | —              | —             |
| 5  | 金融衍生品投资            | —              | —             |
| 6  | 买入返售金融资产           | —              | —             |
|    | 其中: 买断式回购的买入返售金融资产 | —              | —             |
| 7  | 银行存款和结算备付金合计       | 4,246,521.24   | 2.86          |
| 8  | 其他各项资产             | 242,557.90     | 0.16          |
| 9  | 合计                 | 148,606,867.73 | 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。

## 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         | 61,287,211.38  | 41.39        |
| B  | 采矿业              | —              | —            |
| C  | 制造业              | 82,198,480.08  | 55.51        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | —              | —            |
| E  | 建筑业              | —              | —            |
| F  | 批发和零售业           | —              | —            |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | —              | —            |
| H  | 住宿和餐饮业           | —              | —            |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | —              | —            |
| J  | 金融业              | —              | —            |
| K  | 房地产业             | —              | —            |
| L  | 租赁和商务服务业         | —              | —            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | —              | —            |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | —              | —            |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —              | —            |
| P  | 教育               | —              | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | —              | —            |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —              | —            |
| S  | 综合               | —              | —            |
|    | 合计               | 143,485,691.46 | 96.89        |

### 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              | 415,262.36 | 0.28         |
| 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          | 17,934.58  | 0.01 |
| 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 | 19,001.00  | 0.01 |
| J | 金融业             | -          | -    |
| K | 房地产业            | -          | -    |
| L | 租赁和商务服务业        | -          | -    |
| M | 科学研究和技术服务业      | 103,583.33 | 0.07 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业   | 19,340.48  | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业   | -          | -    |
| P | 教育              | -          | -    |
| Q | 卫生和社会工作         | 18,161.78  | 0.01 |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 29,491.80  | 0.02 |
| S | 综合              | -          | -    |
|   | 合计              | 632,097.13 | 0.43 |

### 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  | 002385 | 大北农  | 1,416,450 | 14,858,560.50 | 10.03        |
| 2  | 300498 | 温氏股份 | 762,607   | 14,687,810.82 | 9.92         |
| 3  | 002311 | 海大集团 | 192,153   | 14,084,814.90 | 9.51         |
| 4  | 000876 | 新希望  | 910,500   | 13,848,705.00 | 9.35         |
| 5  | 002714 | 牧原股份 | 252,902   | 13,494,850.72 | 9.11         |
| 6  | 600201 | 生物股份 | 482,534   | 7,889,430.90  | 5.33         |
| 7  | 002299 | 圣农发展 | 318,800   | 7,705,396.00  | 5.20         |
| 8  | 002157 | 正邦科技 | 672,300   | 6,494,418.00  | 4.39         |
| 9  | 002124 | 天邦股份 | 629,160   | 4,051,790.40  | 2.74         |
| 10 | 002100 | 天康生物 | 323,200   | 3,458,240.00  | 2.34         |
| 11 | 600195 | 中牧股份 | 260,500   | 3,404,735.00  | 2.30         |
| 12 | 002567 | 唐人神  | 412,284   | 3,079,761.48  | 2.08         |
| 13 | 002458 | 益生股份 | 253,300   | 2,864,823.00  | 1.93         |

|    |        |      |         |              |      |
|----|--------|------|---------|--------------|------|
| 14 | 000735 | 罗牛山  | 393,100 | 2,802,803.00 | 1.89 |
| 15 | 603718 | 海利生物 | 164,600 | 2,518,380.00 | 1.70 |
| 16 | 300119 | 瑞普生物 | 98,900  | 2,385,468.00 | 1.61 |
| 17 | 002746 | 仙坛股份 | 221,800 | 2,326,682.00 | 1.57 |
| 18 | 600299 | 安迪苏  | 172,600 | 2,126,432.00 | 1.44 |
| 19 | 300761 | 立华股份 | 52,800  | 1,996,368.00 | 1.35 |
| 20 | 603363 | 傲农生物 | 145,320 | 1,845,564.00 | 1.25 |
| 21 | 603566 | 普莱柯  | 83,400  | 1,843,140.00 | 1.24 |
| 22 | 688526 | 科前生物 | 59,600  | 1,640,788.00 | 1.11 |
| 23 | 603609 | 禾丰股份 | 158,400 | 1,622,016.00 | 1.10 |
| 24 | 600975 | 新五丰  | 207,100 | 1,406,209.00 | 0.95 |
| 25 | 300505 | 川金诺  | 44,900  | 1,375,736.00 | 0.93 |
| 26 | 603477 | 巨星农牧 | 85,600  | 1,326,800.00 | 0.90 |
| 27 | 002234 | 民和股份 | 74,300  | 1,274,988.00 | 0.86 |
| 28 | 603668 | 天马科技 | 94,100  | 1,180,955.00 | 0.80 |
| 29 | 002548 | 金新农  | 177,390 | 1,041,279.30 | 0.70 |
| 30 | 002688 | 金河生物 | 168,000 | 1,029,840.00 | 0.70 |
| 31 | 001201 | 东瑞股份 | 24,068  | 928,543.44   | 0.63 |
| 32 | 002982 | 湘佳股份 | 17,900  | 873,341.00   | 0.59 |
| 33 | 605296 | 神农集团 | 19,000  | 765,890.00   | 0.52 |
| 34 | 300871 | 回盛生物 | 22,400  | 637,952.00   | 0.43 |
| 35 | 300967 | 晓鸣股份 | 23,000  | 613,180.00   | 0.41 |

### 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  | 301136 | 招标股份 | 4,718 | 49,633.36 | 0.03         |
| 2  | 301029 | 怡合达  | 373   | 33,521.51 | 0.02         |
| 3  | 603230 | 内蒙新华 | 1,140 | 29,491.80 | 0.02         |
| 4  | 301058 | 中粮工科 | 1,386 | 25,280.64 | 0.02         |
| 5  | 301069 | 凯盛新材 | 539   | 23,829.19 | 0.02         |
| 6  | 301018 | 申菱环境 | 782   | 20,378.92 | 0.01         |
| 7  | 001296 | 长江材料 | 310   | 18,376.80 | 0.01         |
| 8  | 301060 | 兰卫医学 | 587   | 18,161.78 | 0.01         |
| 9  | 301082 | 久盛电气 | 770   | 16,578.10 | 0.01         |
| 10 | 300994 | 久祺股份 | 323   | 14,680.35 | 0.01         |
| 11 | 301046 | 能辉科技 | 290   | 14,207.10 | 0.01         |
| 12 | 301111 | 粤万年青 | 379   | 13,901.72 | 0.01         |
| 13 | 301149 | 隆华新材 | 776   | 13,005.76 | 0.01         |
| 14 | 301020 | 密封科技 | 421   | 12,815.24 | 0.01         |
| 15 | 301026 | 浩通科技 | 203   | 12,734.19 | 0.01         |
| 16 | 301021 | 英诺激光 | 290   | 12,014.70 | 0.01         |



|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 17 | 301185 | 鸥玛软件 | 529   | 11,193.64 | 0.01 |
| 18 | 301035 | 润丰股份 | 196   | 11,030.88 | 0.01 |
| 19 | 301089 | 拓新药业 | 160   | 10,868.80 | 0.01 |
| 20 | 301048 | 金鹰重工 | 814   | 10,549.44 | 0.01 |
| 21 | 301177 | 迪阿股份 | 86    | 9,982.88  | 0.01 |
| 22 | 301127 | 天源环保 | 583   | 9,980.96  | 0.01 |
| 23 | 301045 | 天禄科技 | 335   | 9,503.95  | 0.01 |
| 24 | 300774 | 倍杰特  | 444   | 9,359.52  | 0.01 |
| 25 | 301040 | 中环海陆 | 241   | 9,280.91  | 0.01 |
| 26 | 301101 | 明月镜片 | 208   | 9,018.88  | 0.01 |
| 27 | 301062 | 上海艾录 | 523   | 8,896.23  | 0.01 |
| 28 | 301028 | 东亚机械 | 635   | 8,572.50  | 0.01 |
| 29 | 301078 | 孩子王  | 655   | 7,951.70  | 0.01 |
| 30 | 300814 | 中富电路 | 328   | 7,832.64  | 0.01 |
| 31 | 301221 | 光庭信息 | 88    | 7,807.36  | 0.01 |
| 32 | 301133 | 金钟股份 | 286   | 7,707.70  | 0.01 |
| 33 | 301090 | 华润材料 | 633   | 7,102.26  | 0.00 |
| 34 | 301087 | 可孚医疗 | 92    | 6,931.28  | 0.00 |
| 35 | 301168 | 通灵股份 | 132   | 6,881.16  | 0.00 |
| 36 | 301033 | 迈普医学 | 108   | 6,476.76  | 0.00 |
| 37 | 301056 | 森赫股份 | 572   | 6,343.48  | 0.00 |
| 38 | 301041 | 金百泽  | 215   | 6,065.15  | 0.00 |
| 39 | 301072 | 中捷精工 | 181   | 6,047.21  | 0.00 |
| 40 | 301081 | 严牌股份 | 345   | 6,016.80  | 0.00 |
| 41 | 301083 | 百胜智能 | 416   | 5,911.36  | 0.00 |
| 42 | 301100 | 风光股份 | 184   | 5,729.76  | 0.00 |
| 43 | 301198 | 喜悦智行 | 196   | 5,723.20  | 0.00 |
| 44 | 301199 | 迈赫股份 | 176   | 5,632.00  | 0.00 |
| 45 | 301063 | 海锅股份 | 153   | 5,524.83  | 0.00 |
| 46 | 301189 | 奥尼电子 | 97    | 5,492.14  | 0.00 |
| 47 | 301038 | 深水规院 | 266   | 5,381.18  | 0.00 |
| 48 | 301059 | 金三江  | 259   | 4,998.70  | 0.00 |
| 49 | 301036 | 双乐股份 | 162   | 4,848.66  | 0.00 |
| 50 | 301027 | 华蓝集团 | 286   | 4,761.90  | 0.00 |
| 51 | 603176 | 汇通集团 | 1,924 | 4,713.80  | 0.00 |
| 52 | 301037 | 保立佳  | 193   | 4,682.18  | 0.00 |
| 53 | 301073 | 君亭酒店 | 144   | 4,608.00  | 0.00 |
| 54 | 301093 | 华兰股份 | 90    | 4,486.50  | 0.00 |
| 55 | 301190 | 善水科技 | 163   | 4,475.98  | 0.00 |
| 56 | 301053 | 远信工业 | 155   | 4,460.90  | 0.00 |
| 57 | 301096 | 百诚医药 | 55    | 4,319.15  | 0.00 |
| 58 | 301057 | 汇隆新材 | 218   | 4,146.36  | 0.00 |

|    |        |      |     |          |      |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 59 | 301068 | 大地海洋 | 144 | 4,086.72 | 0.00 |
| 60 | 301092 | 争光股份 | 115 | 4,084.80 | 0.00 |
| 61 | 301079 | 邵阳液压 | 140 | 3,474.80 | 0.00 |
| 62 | 688098 | 申联生物 | 49  | 540.96   | 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末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 002714 | 牧原股份 | 46,709,462.60 | 31.54          |
| 2  | 002311 | 海大集团 | 41,392,531.49 | 27.95          |
| 3  | 300498 | 温氏股份 | 38,477,312.72 | 25.98          |
| 4  | 000876 | 新希望  | 37,254,590.51 | 25.16          |
| 5  | 002385 | 大北农  | 30,422,691.50 | 20.54          |
| 6  | 002157 | 正邦科技 | 23,317,062.15 | 15.75          |
| 7  | 002299 | 圣农发展 | 20,157,636.00 | 13.61          |
| 8  | 600201 | 生物股份 | 15,996,403.09 | 10.80          |
| 9  | 002124 | 天邦股份 | 14,109,845.20 | 9.53           |
| 10 | 002100 | 天康生物 | 8,474,078.73  | 5.72           |
| 11 | 000735 | 罗牛山  | 7,991,108.00  | 5.40           |
| 12 | 300119 | 瑞普生物 | 7,173,039.00  | 4.84           |
| 13 | 002458 | 益生股份 | 6,757,009.00  | 4.56           |
| 14 | 002567 | 唐人神  | 6,546,320.50  | 4.42           |
| 15 | 600195 | 中牧股份 | 5,438,014.30  | 3.67           |
| 16 | 300761 | 立华股份 | 4,666,569.72  | 3.15           |
| 17 | 600789 | 鲁抗医药 | 3,554,727.31  | 2.40           |
| 18 | 603718 | 海利生物 | 3,550,535.86  | 2.40           |
| 19 | 002746 | 仙坛股份 | 3,208,336.00  | 2.17           |
| 20 | 603609 | 禾丰股份 | 3,057,210.00  | 2.06           |
| 21 | 002548 | 金新农  | 3,054,772.70  | 2.06           |
| 22 | 002234 | 民和股份 | 2,961,967.81  | 2.00           |

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 002311 | 海大集团 | 28,269,433.00 | 19.09          |
| 2  | 002714 | 牧原股份 | 26,206,052.06 | 17.70          |
| 3  | 300498 | 温氏股份 | 26,103,339.18 | 17.63          |
| 4  | 000876 | 新希望  | 19,980,117.08 | 13.49          |
| 5  | 002385 | 大北农  | 18,176,443.50 | 12.27          |
| 6  | 002157 | 正邦科技 | 11,937,759.71 | 8.06           |

|    |        |      |               |      |
|----|--------|------|---------------|------|
| 7  | 002299 | 圣农发展 | 10,927,808.00 | 7.38 |
| 8  | 002124 | 天邦股份 | 7,069,753.00  | 4.77 |
| 9  | 002100 | 天康生物 | 4,798,791.26  | 3.24 |
| 10 | 000735 | 罗牛山  | 4,560,565.10  | 3.08 |
| 11 | 300119 | 瑞普生物 | 4,291,340.54  | 2.90 |
| 12 | 002458 | 益生股份 | 4,173,125.90  | 2.82 |
| 13 | 002567 | 唐人神  | 3,431,921.85  | 2.32 |
| 14 | 600789 | 鲁抗医药 | 2,672,812.97  | 1.80 |
| 15 | 300761 | 立华股份 | 2,516,031.00  | 1.70 |
| 16 | 002234 | 民和股份 | 1,863,722.75  | 1.26 |
| 17 | 002746 | 仙坛股份 | 1,705,869.30  | 1.15 |
| 18 | 002548 | 金新农  | 1,695,316.52  | 1.14 |
| 19 | 300106 | 西部牧业 | 1,581,422.00  | 1.07 |
| 20 | 002688 | 金河生物 | 1,512,079.00  | 1.02 |

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 | 369,273,639.62 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 201,893,656.02 |

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持权证投资。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

## 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

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

因福建圣农发展股份有限公司因业绩预测结果不准确或不及时，深圳证券交易所于2021-07-02 依据相关法规给予：监管关注处分决定。

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

本基金投资的前十名证券中的其它证券本期没有发行主体被监管部门立案调查、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额         |
|----|---------|------------|
| 1  | 存出保证金   | 43,474.55  |
| 2  | 应收证券清算款 | 191,395.18 |
| 3  | 应收股利    | —          |
| 4  | 应收利息    | 582.33     |
| 5  | 应收申购款   | —          |
| 6  | 其他应收款   | —          |
| 7  | 待摊费用    | —          |
| 8  | 其他      | 7,105.84   |
| 9  | 合计      | 242,557.90 |

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1  | 301136 | 招标股份 | 49,633.36   | 0.03         | 新股未上市    |
| 2  | 301029 | 怡合达  | 33,521.51   | 0.02         | 新股锁定     |
| 3  | 301058 | 中粮工科 | 25,280.64   | 0.02         | 新股锁定     |
| 4  | 301069 | 凯盛新材 | 23,829.19   | 0.02         | 新股锁定     |

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构        |           |                |           |
|----------|-----------|--------------|-----------|----------------|-----------|
|          |           | 机构投资者        |           | 个人投资者          |           |
|          |           | 持有份额         | 占总份额比例（%） | 持有份额           | 占总份额比例（%） |
| 5,644    | 28,032.44 | 6,768,779.00 | 4.28      | 151,446,300.00 | 95.72     |

#### 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  | 张磊            | 20,000,000.00 | 12.64       |
| 2  | 华泰证券股份有限公司    | 4,010,400.00  | 2.53        |
| 3  | 贾维燕           | 2,130,000.00  | 1.35        |
| 4  | 李秀婷           | 1,990,000.00  | 1.26        |
| 5  | 红星美凯龙控股集团有限公司 | 1,690,600.00  | 1.07        |
| 6  | 黄华章           | 1,483,300.00  | 0.94        |
| 7  | 邝明            | 1,350,000.00  | 0.85        |
| 8  | 刘国春           | 1,052,000.00  | 0.66        |

|    |    |              |      |
|----|----|--------------|------|
| 9  | 于波 | 1,000,000.00 | 0.63 |
| 10 | 丁洋 | 948,700.00   | 0.60 |

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目               | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例（%） |
|------------------|-----------|-------------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 3,000.00  | 0.0019      |

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

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

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（2021 年 3 月 4 日）基金份额总额      | 225,215,079.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 153,000,000.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 220,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 158,215,079.00 |

## § 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

- 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。
- 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。
- 自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金于 2021 年 3 月 4 日成立，初次聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。报告期内应支付给该事务所的报酬为 50,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 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 |    |
| 银河证券 | 3      | 508,787,378.31 | 89.81%       | 361,904.17 | 89.81%     | -  |
| 中信证券 | 2      | 57,696,944.34  | 10.19%       | 41,043.81  | 10.19%     | -  |
| 安信证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东吴证券 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 信达证券 | 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。

3、本基金本报告期内合同生效，上述租用席位均为本期新增所用。

#### 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<br>成交总额的<br>比例 | 成交金额           | 占当期债券回<br>购成交总额的<br>比例 | 成交金额 | 占当期权证<br>成交总额的<br>比例 |
|------|------|----------------------|----------------|------------------------|------|----------------------|
| 银河证券 | -    | -                    | -              | -                      | -    | -                    |
| 中信证券 | -    | -                    | 248,500,000.00 | 100.00%                | -    | -                    |
| 安信证券 | -    | -                    | -              | -                      | -    | -                    |
| 东吴证券 | -    | -                    | -              | -                      | -    | -                    |
| 信达证券 | -    | -                    | -              | -                      | -    | -                    |

### 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关于平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告                         | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 05 日 |
| 2  | 中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要                                       | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 05 日 |
| 3  | 平安基金管理有限公司平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金开放申购赎回业务的公告                        | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 09 日 |
| 4  | 平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金份额上市交易公告书                                  | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 09 日 |
| 5  | 平安基金管理有限公司关于新增平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金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 12 日 |
| 6  | 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 |
| 7  | 平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新                                      | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 03 月 30 日 |
| 8  | 平安中证畜牧养殖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 |
| 9  | 平安中证畜牧养殖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 |
| 11 | 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 |
| 12 | 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 |
| 13 | 平安中证畜牧养殖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 |



|    |                                          |              |                  |
|----|------------------------------------------|--------------|------------------|
| 14 | 平安中证畜牧养殖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 30 日 |
| 15 | 平安中证畜牧养殖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 |
| 16 | 平安中证畜牧养殖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 30 日 |
| 17 | 平安中证畜牧养殖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 30 日 |
| 18 | 平安基金管理有限公司关于旗下基金新增开源证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2021 年 12 月 20 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

注：无。

### 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 31 日起正式生效。有关详细信息参见本公司于 2021 年 3 月 31 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畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- （2）平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- （3）平安中证畜牧养殖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 30 日