

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
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 2022 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| 3.3 其他指标 | 8 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 12 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 | 13 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 16 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| § 7 投资组合报告 | 47 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 47 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 48 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 49 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 53 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 54 |

| | |
|---|-----------|
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 54 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 54 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 54 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 54 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 54 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 54 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 55 |
| § 8 基金份额持有人信息 | 56 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 56 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 56 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 57 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 | 57 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 57 |
| § 10 重大事件揭示 | 57 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 57 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 | 57 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 57 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 57 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 57 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 57 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 58 |
| 10.8 其他重大事件 | 59 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 60 |
| 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 | 60 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 61 |
| § 12 备查文件目录 | 61 |
| 12.1 备查文件目录 | 61 |
| 12.2 存放地点 | 61 |
| 12.3 查阅方式 | 61 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-----------------------------|
| 基金名称 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基 |
| 基金简称 | 粤港澳大湾区 ETF |
| 场内简称 | 大湾区 ETF |
| 基金主代码 | 512970 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 9 月 23 日 |
| 基金管理人 | 平安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 286,987,638.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 上海证券交易所 |
| 上市日期 | 2019 年 11 月 11 日 |

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|-------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日) |
| 本期已实现收益 | 1,194,007.12 |
| 本期利润 | -46,591,679.67 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1625 |
| 本期加权平均净值利润率 | -13.01% |
| 本期基金份额净值增长率 | -11.13% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 85,002,072.71 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.2962 |
| 期末基金资产净值 | 371,989,710.71 |
| 期末基金份额净值 | 1.2962 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2022 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 29.62% |

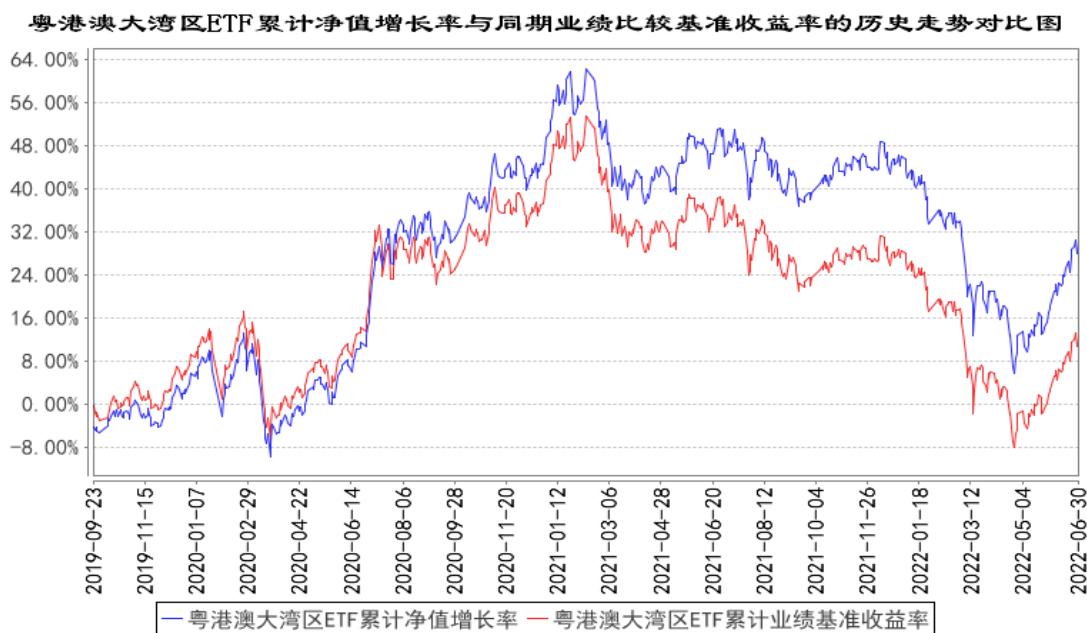
- 注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；
3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去一个月 | 10.76% | 1.17% | 10.34% | 1.21% | 0.42% | -0.04% |
| 过去三个月 | 8.10% | 1.55% | 7.17% | 1.59% | 0.93% | -0.04% |
| 过去六个月 | -11.13% | 1.59% | -12.57% | 1.64% | 1.44% | -0.05% |
| 过去一年 | -13.95% | 1.35% | -18.38% | 1.39% | 4.43% | -0.04% |
| 自基金合同生效起至今 | 29.62% | 1.38% | 12.30% | 1.42% | 17.32% | -0.04% |

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



- 注：1、本基金基金合同于 2019 年 09 月 23 日正式生效；
 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司成立于 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 2022 年 6 月 30 日，平安基金共管理 169 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5504 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 粤港澳大 湾区发展 主题交易 型开放 式指 数证 券投 资基 金基 金经 理 | 2019 年 10 月 11 日 | - | 8 年 | 刘洁倩女士，浙江大学博士，曾担任国泰 基金管理有限公司产品研究主管。2018 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心指数研究员、基金经理助理。 现任平安中证粤港澳大湾区发展主题交易 型开放式指数证券投资基金、平安中证光 伏产业交易型开放式指数证券投资基金、 平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券 投资基金、平安中证新材料主题交易型开 放式指数证券投资基金、平安中证光伏产 业指型发起式证券投资基金、平安中证沪 港深线上消费主题交易型开放式指数证 券投资基金基金经理。 |
| 王宁宁 | 平安中证 粤港澳大 湾区发展 主题交易 型开放 式指 数证 券投 资基 金基 金经 理 | 2020 年 11 月 18 日 | - | 5 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、 |

| | | | | | |
|-----|--|-------------------|---|-----|---|
| | 投资基金 基金经理 助理 | | | | 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、平安中证沪深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安上海金交易型开放式证券投资基金基金经理助理。 |
| 王仁增 | 平安中证 粤港澳大 湾区发展 主题交易 型开放 式指 数证 券投 资基 金 | 2021 年 7 月 8 日 | - | 8 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 |

| | | | | | |
|----|----------------------------|-----------------|-----------------|------|--|
| | 基金经理助理 | | | | 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、平安上海金交易型开放式证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金基金经理助理。 |
| 成钧 | ETF 指数投资中心投资执行总经理，平安中证粤港澳大 | 2019 年 9 月 23 日 | 2022 年 6 月 23 日 | 11 年 | 成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心投 |

| | | | | |
|--|--|--|--|--|
| | 湾区发展 主题交易 型开放式 指数证券 投资基金 基金经理 | | | 资执行总经理。同时担任平安沪深 300 交 易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平 安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易 型开放式指数证券投资基金联接基金、平 安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 联接基金、平安创业板交易型开放式指 数证券投资基金、平安中债-中高等级公司 债利差因子交易型开放式指数证券投资基金 、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型 开放式指数证券投资基金、平安中债 0-5 年广东省地方政府债交易型开放式指数证 券投资基金、平安股息精选沪港深股票型 证券投资基金、平安富时中国国企开放共 赢交易型开放式指数证券投资基金、平安 中证新能源汽车产业交易型开放式指数证 券投资基金发起式联接基金、平安中证光 伏产业指数型发起式证券投资基金、平安 中证港股通医药卫生综合交易型开放式指 数证券投资基金、平安上海金交易型开放 式证券投资基金基金经理。 |
|--|--|--|--|--|

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。
3、自 2022 年 7 月 18 日起，王宁宁不再担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基金经理助理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

作为一只投资于粤港澳大湾区主题公司的被动型产品，基金在投资管理上，采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。报告期内，本基金的日均偏离度为 0.05%，年化跟踪误差 1.04%，较好地完成了基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2962 元，本报告期基金份额净值增长率为-11.13%，业绩比较基准收益率为-12.57%。

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 年下半年，疫情之后复工复产有望推动制造业投资明显回升，在稳增长政策支持下，基建投资仍有望保持高增长势头。消费方面，随着各地消费刺激政策出台，三季度消费有望迎来集中释放，四季度消费将有望恢复常态。从股债收益比来看，A 股市场估值整体不贵，且政策改革的加快推进，有利于市场整体风险偏好的提升，因此市场整体向下风险不大。综上考虑，我们对权益资产的前景仍保持谨慎乐观。作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引

和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|------------|------------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6. 4. 7. 1 | 11,940,642.46 | 4,389,077.06 |
| 结算备付金 | | 6,837.02 | 825,633.80 |
| 存出保证金 | | 6,379.25 | 10,661.91 |
| 交易性金融资产 | 6. 4. 7. 2 | 360,250,702.20 | 406,622,332.30 |
| 其中：股票投资 | | 360,250,702.20 | 406,622,332.30 |
| 基金投资 | | — | — |
| 债券投资 | | — | — |
| 资产支持证券投资 | | — | — |
| 贵金属投资 | | — | — |
| 其他投资 | | — | — |
| 衍生金融资产 | 6. 4. 7. 3 | — | — |
| 买入返售金融资产 | 6. 4. 7. 4 | — | — |
| 债权投资 | 6. 4. 7. 5 | — | — |
| 其中：债券投资 | | — | — |
| 资产支持证券投资 | | — | — |
| 其他投资 | | — | — |
| 其他债权投资 | 6. 4. 7. 6 | — | — |
| 其他权益工具投资 | 6. 4. 7. 7 | — | — |
| 应收清算款 | | — | 7,116,267.08 |
| 应收股利 | | — | — |
| 应收申购款 | | — | — |
| 递延所得税资产 | | — | — |
| 其他资产 | 6. 4. 7. 8 | 75,616.24 | -1,095.64 |
| 资产总计 | | 372,280,177.17 | 418,962,876.51 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
| 负债： | | | |
| 短期借款 | | — | — |
| 交易性金融负债 | | — | — |
| 衍生金融负债 | 6. 4. 7. 3 | — | — |
| 卖出回购金融资产款 | | — | — |
| 应付清算款 | | — | — |
| 应付赎回款 | | — | — |

| | | | |
|-------------|-------------|----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | | 43,700.15 | 53,118.52 |
| 应付托管费 | | 14,566.71 | 17,706.17 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6. 4. 7. 9 | 232,199.60 | 281,489.48 |
| 负债合计 | | 290,466.46 | 352,314.17 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6. 4. 7. 10 | 286,987,638.00 | 286,987,638.00 |
| 其他综合收益 | 6. 4. 7. 11 | - | - |
| 未分配利润 | 6. 4. 7. 12 | 85,002,072.71 | 131,622,924.34 |
| 净资产合计 | | 371,989,710.71 | 418,610,562.34 |
| 负债和净资产总计 | | 372,280,177.17 | 418,962,876.51 |

注： 报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2962 元，基金份额总额 286,987,638.00 份。

6.2 利润表

会计主体：平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2022年1月1日至2022年 6月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日 |
|-------------------|-------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 一、营业收入 | | -45,991,987.33 | 4,529,680.90 |
| 1. 利息收入 | | 50,289.75 | 83,831.64 |
| 其中：存款利息收入 | 6. 4. 7. 13 | 17,719.91 | 18,979.88 |
| 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 | | 26,522.55 | 57,016.06 |
| 证券出借利息收入 | | 6,047.29 | 7,835.70 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 1,748,651.77 | 19,321,774.74 |
| 其中：股票投资收益 | 6. 4. 7. 14 | -1,487,924.01 | 16,915,214.43 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6. 4. 7. 15 | - | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6. 4. 7. 16 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------------|-------------------|-------------------|
| 贵金属投资收益 | 6. 4. 7. 17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6. 4. 7. 18 | - | - |
| 股利收益 | 6. 4. 7. 19 | 3, 236, 575. 78 | 2, 406, 560. 31 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6. 4. 7. 20 | -47, 785, 686. 79 | -14, 881, 786. 38 |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列） | 6. 4. 7. 21 | -5, 242. 06 | 5, 860. 90 |
| 减：二、营业总支出 | | 599, 692. 34 | 849, 889. 91 |
| 1. 管理人报酬 | 6. 4. 10. 2. 1 | 266, 927. 63 | 321, 339. 96 |
| 2. 托管费 | 6. 4. 10. 2. 2 | 88, 975. 81 | 107, 113. 36 |
| 3. 销售服务费 | 6. 4. 10. 2. 3 | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6. 4. 7. 22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6. 4. 7. 23 | 243, 788. 90 | 421, 436. 59 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -46, 591, 679. 67 | 3, 679, 790. 99 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -46, 591, 679. 67 | 3, 679, 790. 99 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -46, 591, 679. 67 | 3, 679, 790. 99 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金管理人

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | | |
|-----------------|---------------------------------------|--------|-------------------|-------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金份额) | 286, 987, 638. 00 | - | 131, 622, 924. 34 | 418, 610, 562. 34 |

| | | | | |
|---|----------------|---|----------------|----------------|
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 286,987,638.00 | - | 131,622,924.34 | 418,610,562.34 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | - | - | -46,620,851.63 | -46,620,851.63 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -46,591,679.67 | -46,591,679.67 |
| (二)、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) | - | - | -29,171.96 | -29,171.96 |
| 其中:1.基金申购款 | 2,000,000.00 | - | 371,819.00 | 2,371,819.00 |
| 2.基金赎回款 | -2,000,000.00 | - | -400,990.96 | -2,400,990.96 |
| (三)、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) | | | | |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 286,987,638.00 | - | 85,002,072.71 | 371,989,710.71 |
| 项目 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 292,987,638.00 | - | 144,694,001.54 | 437,681,639.54 |
| 加:会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 292,987,638.00 | - | 144,694,001.54 | 437,681,639.54 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -3,000,000.00 | - | 2,121,513.62 | -878,486.38 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | 3,679,790.99 | 3,679,790.99 |
| (二)、本期基金份额交易产 | -3,000,000.00 | - | -1,558,277.37 | -4,558,277.37 |

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| 生的基 金净 值变 动数 (净值 减少以 “-”号 填列) | | | | |
| 其中:1. 基金申 购款 | 2,000,000.00 | - | 1,105,512.92 | 3,105,512.92 |
| 2 .基金赎 回款 | -5,000,000.00 | - | -2,663,790.29 | -7,663,790.29 |
| (三)、 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) | - | - | - | - |
| (四)、 其他综 合收益 结转留 存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期 期未净 资产(基 金净值) | 289,987,638.00 | - | 146,815,515.16 | 436,803,153.16 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]2117号《关于准予平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由平安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币6,009,960,641.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0497号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年9月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为6,009,987,638.00份基金份额，其中认购资金利息折合26,997.00份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]229号审核同意，本基金6,009,987,638.00份基金份额于2019年11月11日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数中证粤港澳大湾区发展主题指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；主要投资范围为标的指数的成份股及其备选成份股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债券等)、货币市场工具、权证、股指期货、银行存款、同业存单、资产支持证券、债券回购以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。本基金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%。本基金的业绩比较准为标的指数收益率，即中证粤港澳大湾区发展主题指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本

准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>}、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金本报告期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计估计与最近一期年度报告相一致。

本报告期所采用的会计政策除了下述会计政策变更外，其余与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 会计政策的变更

6.4.4.1.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产

主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用

损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

6.4.4.1.3 收入/(损失)的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行

价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

债券投资和资产支持证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和资产支持证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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人

缴纳的增值税后的净额 确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

6.4.4.1.4 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债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，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管理业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 4,389,077.06 元、825,633.80 元、10,661.91 元、0.00 元、-1,095.64 元和 7,116,267.08 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 4,389,564.98 元、826,005.30 元、10,666.71 元、-2,315.75 元、355.89 元和 7,116,267.08 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 406,622,332.30 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 406,622,332.30 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付交易费用，金额分别为 53,118.52 元、17,706.17 元和 36,489.48 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和其他负债-应付交易费用，金额分别为 53,118.52 元、17,706.17 元和 36,489.48 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|--------------|-------------------|
| 活期存款 | 11,940,642.46 |
| 等于：本金 | 11,939,607.72 |
| 加：应计利息 | 1,034.74 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 11,940,642.46 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | | |
|-------------------|-------------------|------|----------------|----------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 373,059,765.10 | - | 360,250,702.20 | -12,809,062.90 |
| 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 | 373,059,765.10 | - | 360,250,702.20 | -12,809,062.90 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：本基金于本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期无债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期无其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 |
|-------|-------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | - |

| | | |
|------|--|-----------|
| 待摊费用 | | 75,616.24 |
| 合计 | | 75,616.24 |

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | |
|-------------|-------------------|------------|
| 应付券商交易单元保证金 | — | |
| 应付赎回费 | | — |
| 应付证券出借违约金 | | — |
| 应付交易费用 | | 23,022.46 |
| 其中：交易所市场 | | 23,022.46 |
| 银行间市场 | | — |
| 应付利息 | | — |
| 预提费用 | | 139,177.14 |
| 应付指数使用费 | | 70,000.00 |
| 合计 | | 232,199.60 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|---------------|----------------------------|----------------|
| | 基金份额(份) | 账面金额 |
| 上年度末 | 286,987,638.00 | 286,987,638.00 |
| 本期申购 | 2,000,000.00 | 2,000,000.00 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -2,000,000.00 | -2,000,000.00 |
| 基金拆分/份额折算前 | — | — |
| 基金拆分/份额折算调整 | — | — |
| 本期申购 | — | — |
| 本期赎回(以“-”号填列) | — | — |
| 本期末 | 286,987,638.00 | 286,987,638.00 |

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|----------------|----------------|----------------|
| 本期期初 | 207,947,216.27 | -76,324,291.93 | 131,622,924.34 |
| 本期利润 | 1,194,007.12 | -47,785,686.79 | -46,591,679.67 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 2,574.06 | -31,746.02 | -29,171.96 |
| 其中：基金申购款 | 1,456,523.01 | -1,084,704.01 | 371,819.00 |
| 基金赎回款 | -1,453,948.95 | 1,052,957.99 | -400,990.96 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |

| | | | |
|-----|----------------|-----------------|---------------|
| 本期末 | 209,143,797.45 | -124,141,724.74 | 85,002,072.71 |
|-----|----------------|-----------------|---------------|

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 活期存款利息收入 | 14,915.43 |
| 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 | 2,734.66 |
| 其他 | 69.82 |
| 合计 | 17,719.91 |

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -1,330,801.99 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -157,122.02 |
| 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 | -1,487,924.01 |

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 卖出股票成交总额 | 21,218,534.08 |
| 减：卖出股票成本总额 | 22,485,894.62 |
| 减：交易费用 | 63,441.45 |
| 买卖股票差价收入 | -1,330,801.99 |

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 赎回基金份额对价总额 | 2,400,990.96 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 1,655,592.96 |
| 减：赎回股票成本总额 | 902,520.02 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | -157,122.02 |

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益产生的证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益**6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券买卖差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益**6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 3,236,575.78 |
| 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 | 3,236,575.78 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------------------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 1. 交易性金融资产 | -47,785,686.79 |
| 股票投资 | -47,785,686.79 |
| 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 | -47,785,686.79 |

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | -5,242.06 |
| 合计 | -5,242.06 |

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

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------|----------------------|
| | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
| 审计费用 | 29,752.78 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行费用 | 228.00 |
| 指数使用费 | 70,000.00 |
| 其他 | 84,300.75 |
| 合计 | 243,788.90 |

6.4.7.24 分部报告

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

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|----------------------|----------|
| 平安基金管理有限公司（“平安基金”） | 基金管理人 |
| 中国工商银行股份有限公司（“工商银行”） | 基金托管人 |
| 大华资产管理有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 三亚盈湾旅业有限公司 | 基金管理人的股东 |
| 平安信托有限责任公司 | 基金管理人的股东 |

| | |
|--------------------------|----------------------|
| 深圳平安汇通投资管理有限公司（“平安汇通”） | 基金管理人的子公司 |
| 平安证券股份有限公司（“平安证券”） | 基金管理人的股东的子公司、基金销售机构 |
| 中国平安保险(集团)股份有限公司（“平安集团”） | 基金管理人的最终控股母公司 |
| 平安银行股份有限公司（“平安银行”） | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |
| 中国平安人寿保险股份有限公司（“平安人寿”） | 与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-------|----------------------------|-------------------------|---------------------------------|---------------------|
| | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期股票 成交总额的比例(%) |
| 平安证券 | 11,840,783.52 | 28.94 | 30,504,114.40 | 28.98 |

6.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|-------|----------------------------|---------------------------|---------------------------------|---------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) | 成交金额 | 占当期债券回购 成交总额的比例 (%) |
| 平安证券 | 246,000,000.00 | 100.00 | 428,000,000.00 | 68.15 |

6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | | |
|-------|----------------------------|--------------------|--------------|----------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金总量 的比例 (%) | 期末应付佣金余 额 | 占期末应付佣金 总额的比例 (%) |
| 平安证券 | 8,475.17 | 28.84 | 5,467.21 | 23.75 |

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

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6 月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 266,927.63 | 321,339.96 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | - | - |

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 ×0.15%/ 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2022年1月1日至2022年6 月30日 | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 88,975.81 | 107,113.36 |

注：支付基金托管行工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值 ×0.05%/ 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|-------|-------------------|-----------------------------|---------------------|-----------------------------|
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比 例（%） | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%) |
| 平安人寿 | 100,012,730.00 | 34.8491 | 100,012,730.00 | 34.8491 |

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2022年1月1日至2022年6月30日 | | 上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日 | |
|---------|----------------------------|-----------|---------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 工商银行-活期 | 11,940,642.46 | 14,915.43 | 5,401,751.38 | 13,681.16 |

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| 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 |
| - | - | - | - | - | - |
| 上年度可比期间 | | | | | |
| 2021年1月1日至2021年6月30日 | | | | | |
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位： 张） | 总金额 |

| | | | | | |
|------------|--------|------|------|-------|----------|
| | | | | 张) | |
| 平安证券股份有限公司 | 605011 | 杭州热电 | 公开发行 | 525 | 3,239.25 |
| 平安证券股份有限公司 | 605162 | 新中港 | 公开发行 | 1,377 | 8,358.39 |

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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

(1) 于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有 547,813.00 股中国平安，成本总额为人民币 43,056,929.40 元，估值总额为人民币 25,577,388.97 元，占基金资产净值的比例为 6.88%(2021 年 6 月 30：数量：1,686,913 股；成本：145,375,843.73 元；市值：120,445,588.20 元；占基金资产净值的比例：8.77%)。

(2) 于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有 490,639.00 股平安银行，成本总额为人民币 7,854,402.50 元，估值总额为人民币 7,349,772.22 元，占基金资产净值的比例为 1.98%(2021 年 6 月 30：数量：2,594,839 股；成本：42,936,559.02 元；市值：33,213,939.20 元；占基金资产净值的比例：2.42%)。

6.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|-----------------|------|--------|-------|--------|--------------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量 (单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 300834 | 星辉环材 | 2022 年 1 月 6 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 55.57 | 30.03 | 271 | 15,059.47 | 8,138.13 | - |
| 301103 | 何氏眼科 | 2022 年 3 月 14 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 32.67 | 32.02 | 372 | 12,155.00 | 11,911.44 | - |
| 301116 | 益客 | 2022 年 | 6 个月 | 新股锁 | 11.40 | 20.46 | 577 | 6,577.80 | 11,805.42 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|------|-------|-------|-------|-----------|-----------|--|---|
| | 食品 | 1月10日 | | 定 | | | | | | | |
| 301122 | 采纳股份 | 2022年1月19日 | 6个月 | 新股锁定 | 50.31 | 70.37 | 285 | 14,338.35 | 20,055.45 | | - |
| 301123 | 奕东电子 | 2022年1月14日 | 6个月 | 新股锁定 | 37.23 | 25.39 | 375 | 13,961.25 | 9,521.25 | | - |
| 301130 | 西点药业 | 2022年2月16日 | 6个月 | 新股锁定 | 22.55 | 37.70 | 237 | 5,344.35 | 8,934.90 | | - |
| 301158 | 德石股份 | 2022年1月7日 | 6个月 | 新股锁定 | 15.64 | 20.38 | 379 | 5,927.56 | 7,724.02 | | - |
| 301181 | 标榜股份 | 2022年2月11日 | 6个月 | 新股锁定 | 40.25 | 30.59 | 257 | 10,344.25 | 7,861.63 | | - |
| 301196 | 唯科科技 | 2022年1月4日 | 6个月 | 新股锁定 | 64.08 | 37.52 | 160 | 10,252.80 | 6,003.20 | | - |
| 301201 | 诚达药业 | 2022年1月12日 | 6个月 | 新股锁定 | 72.69 | 71.54 | 237 | 17,227.53 | 16,954.98 | | - |
| 301207 | 华兰疫苗 | 2022年2月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 56.88 | 56.42 | 226 | 12,854.88 | 12,750.92 | | - |
| 301216 | 万凯新材 | 2022年3月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 35.68 | 29.84 | 388 | 13,843.84 | 11,577.92 | | - |
| 301219 | 腾远钴业 | 2022年3月10日 | 6个月 | 新股锁定 | 96.82 | 87.82 | 115 | 11,134.72 | 10,099.30 | | - |
| 301235 | 华康医疗 | 2022年1月21日 | 6个月 | 新股锁定 | 39.30 | 37.93 | 418 | 16,427.40 | 15,854.74 | | - |
| 301236 | 软通动力 | 2022年3月8日 | 6个月 | 新股锁定 | 48.59 | 31.38 | 468 | 22,738.56 | 14,685.84 | | - |
| 301237 | 和顺科技 | 2022年3月16日 | 6个月 | 新股锁定 | 56.69 | 41.86 | 235 | 13,322.15 | 9,837.10 | | - |
| 301256 | 华融化学 | 2022年3月14日 | 6个月 | 新股锁定 | 8.05 | 10.08 | 1,758 | 14,151.90 | 17,720.64 | | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|-----------------|------|------|-------|-------|--------|------------|------------|---|
| 301258 | 富士莱 | 2022 年 3 月 21 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 48.30 | 41.68 | 221 | 10,674.30 | 9,211.28 | - |
| 301263 | 泰恩康 | 2022 年 3 月 22 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 19.93 | 31.38 | 600 | 11,958.00 | 18,828.00 | - |
| 688283 | 坤恒顺维 | 2022 年 2 月 8 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 33.80 | 45.41 | 1,595 | 53,911.00 | 72,428.95 | - |
| 688306 | 均普智能 | 2022 年 3 月 15 日 | 6 个月 | 新股锁定 | 5.08 | 5.19 | 22,740 | 115,519.20 | 118,020.60 | - |

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

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3. 基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中由金融工具产生的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难，另一

方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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公司发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

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

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金管理人通过由风险管理人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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2022年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|---------------------|----------------------|----------|------------------------|--------------------|-----------------------|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 11,940,642.46 | - | - | - | 11,940,642.46 |
| 结算备付金 | 6,837.02 | - | - | - | 6,837.02 |
| 存出保证金 | 6,379.25 | - | - | - | 6,379.25 |
| 交易性金融资产 | - | - | -360,250,702.20 | - | 360,250,702.20 |
| 其他资产 | - | - | - | -75,616.24 | 75,616.24 |
| 资产总计 | 11,953,858.73 | - | -360,326,318.44 | - | 372,280,177.17 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | -43,700.15 | 43,700.15 |
| 应付托管费 | - | - | - | -14,566.71 | 14,566.71 |
| 其他负债 | - | - | - | -232,199.60 | 232,199.60 |
| 负债总计 | - | - | - | -290,466.46 | 290,466.46 |
| 利率敏感度缺口 | 11,953,858.73 | - | -360,035,851.98 | - | 371,989,710.71 |
| 上年度末 2021年12月31日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 4,389,077.06 | - | - | - | 4,389,077.06 |
| 结算备付金 | 825,633.80 | - | - | - | 825,633.80 |
| 存出保证金 | 10,661.91 | - | - | - | 10,661.91 |
| 交易性金融资产 | - | - | -406,622,332.30 | - | 406,622,332.30 |
| 应收利息 | - | - | - | -1,095.64 | -1,095.64 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | -7,116,267.08 | 7,116,267.08 |
| 资产总计 | 5,225,372.77 | - | -413,737,503.74 | - | 418,962,876.51 |
| 负债 | | | | | |

| | | | | | |
|---------|--------------|---|---|-----------------|----------------|
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 53,118.52 | 53,118.52 |
| 应付托管费 | - | - | - | 17,706.17 | 17,706.17 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 36,489.48 | 36,489.48 |
| 其他负债 | - | - | - | 245,000.00 | 245,000.00 |
| 负债总计 | - | - | - | 352,314.17 | 352,314.17 |
| 利率敏感度缺口 | 5,225,372.77 | - | - | -413,385,189.57 | 418,610,562.34 |

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于报告期末，本基金未持有交易性债券（上年度末：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（上年度末：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场价格变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的最大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2022年6月30日 | | 上年度末 2021年12月31日 | |
|-------------------|-------------------|--------------|---------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产 —股票投资 | 360,250,702.20 | 96.84 | 406,622,332.30 | 97.14 |
| 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 | 360,250,702.20 | 96.84 | 406,622,332.30 | 97.14 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除“沪深 300 指数”以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----------------|---------------------------|-----------------------------|------------------------|
| | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| 分析 | | 本期末（2022 年 6 月 30 日） | 上年度末（2021 年 12 月 31 日） |
| 沪深 300 指数上升 5% | 19,912,876.75 | 19,983,128.17 | |
| 沪深 300 指数下降 5% | -19,912,876.75 | -19,983,128.17 | |

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2022 年 6 月 30 日 | 上年度末 2021 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 359,830,776.49 | 403,677,929.63 |
| 第二层次 | - | 1,826,464.42 |
| 第三层次 | 419,925.71 | 1,117,938.25 |

| | | |
|----|----------------|----------------|
| 合计 | 360,250,702.20 | 406,622,332.30 |
|----|----------------|----------------|

6.4.14.2.2 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；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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|----------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 360,250,702.20 | 96.77 |
| | 其中：股票 | 360,250,702.20 | 96.77 |
| 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 | 11,947,479.48 | 3.21 |
| 8 | 其他各项资产 | 81,995.49 | 0.02 |
| 9 | 合计 | 372,280,177.17 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采矿业 | 1,474,990.00 | 0.40 |
| C | 制造业 | 243,158,014.08 | 65.37 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,489,612.40 | 0.67 |
| E | 建筑业 | — | — |
| F | 批发和零售业 | 854,256.50 | 0.23 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 8,307,575.76 | 2.23 |
| H | 住宿和餐饮业 | — | — |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 2,615,671.12 | 0.70 |
| J | 金融业 | 68,569,981.90 | 18.43 |
| K | 房地产业 | 18,736,660.77 | 5.04 |
| L | 租赁和商务服务业 | 3,440,678.85 | 0.92 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,137,286.50 | 1.11 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 325,358.00 | 0.09 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | — | — |
| P | 教育 | — | — |
| Q | 卫生和社会工作 | 2,336,165.00 | 0.63 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | — | — |
| S | 综合 | 1,759,028.55 | 0.47 |
| | 合计 | 358,205,279.43 | 96.29 |

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | — | — |
| B | 采矿业 | — | — |
| C | 制造业 | 1,933,013.61 | 0.52 |
| 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 | 28,010.16 | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | — | — |

| | | | |
|---|-----------------|--------------|------|
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 29,141.44 | 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 | 26,361.74 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 16,984.38 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 11,911.44 | 0.00 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,045,422.77 | 0.55 |

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 91,673 | 30,572,028.77 | 8.22 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 625,932 | 26,414,330.40 | 7.10 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 547,813 | 25,577,388.97 | 6.88 |
| 4 | 002475 | 立讯精密 | 501,511 | 16,946,056.69 | 4.56 |
| 5 | 300760 | 迈瑞医疗 | 49,056 | 15,364,339.20 | 4.13 |
| 6 | 000333 | 美的集团 | 247,729 | 14,960,354.31 | 4.02 |
| 7 | 300124 | 汇川技术 | 186,599 | 12,291,276.13 | 3.30 |
| 8 | 300014 | 亿纬锂能 | 114,644 | 11,177,790.00 | 3.00 |
| 9 | 002709 | 天赐材料 | 136,300 | 8,458,778.00 | 2.27 |
| 10 | 000063 | 中兴通讯 | 321,855 | 8,216,958.15 | 2.21 |
| 11 | 000651 | 格力电器 | 239,239 | 8,067,139.08 | 2.17 |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 490,639 | 7,349,772.22 | 1.98 |
| 13 | 000002 | 万科 A | 344,200 | 7,056,100.00 | 1.90 |
| 14 | 000100 | TCL 科技 | 1,419,000 | 6,797,010.00 | 1.83 |
| 15 | 603288 | 海天味业 | 70,268 | 6,349,416.48 | 1.71 |
| 16 | 600048 | 保利发展 | 363,167 | 6,340,895.82 | 1.70 |
| 17 | 601615 | 明阳智能 | 170,193 | 5,752,523.40 | 1.55 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|---------|--------------|--|------|
| 18 | 002352 | 顺丰控股 | 99,025 | 5,526,585.25 | | 1.49 |
| 19 | 300769 | 德方纳米 | 11,400 | 4,658,952.00 | | 1.25 |
| 20 | 002340 | 格林美 | 483,800 | 4,402,580.00 | | 1.18 |
| 21 | 002920 | 德赛西威 | 28,100 | 4,158,800.00 | | 1.12 |
| 22 | 300207 | 欣旺达 | 121,652 | 3,844,203.20 | | 1.03 |
| 23 | 002180 | 纳思达 | 71,600 | 3,624,392.00 | | 0.97 |
| 24 | 002027 | 分众传媒 | 511,245 | 3,440,678.85 | | 0.92 |
| 25 | 601238 | 广汽集团 | 223,502 | 3,406,170.48 | | 0.92 |
| 26 | 300568 | 星源材质 | 116,800 | 3,391,872.00 | | 0.91 |
| 27 | 300601 | 康泰生物 | 68,012 | 3,072,782.16 | | 0.83 |
| 28 | 002008 | 大族激光 | 85,110 | 2,819,694.30 | | 0.76 |
| 29 | 000776 | 广发证券 | 149,702 | 2,799,427.40 | | 0.75 |
| 30 | 300037 | 新宙邦 | 52,520 | 2,760,451.20 | | 0.74 |
| 31 | 600499 | 科达制造 | 133,700 | 2,759,568.00 | | 0.74 |
| 32 | 600999 | 招商证券 | 187,670 | 2,704,324.70 | | 0.73 |
| 33 | 300454 | 深信服 | 25,204 | 2,615,671.12 | | 0.70 |
| 34 | 002841 | 视源股份 | 33,750 | 2,542,050.00 | | 0.68 |
| 35 | 300529 | 健帆生物 | 48,880 | 2,487,503.20 | | 0.67 |
| 36 | 603882 | 金域医学 | 28,300 | 2,336,165.00 | | 0.63 |
| 37 | 002625 | 光启技术 | 130,700 | 2,257,189.00 | | 0.61 |
| 38 | 002850 | 科达利 | 14,100 | 2,241,900.00 | | 0.60 |
| 39 | 300724 | 捷佳伟创 | 24,700 | 2,206,945.00 | | 0.59 |
| 40 | 688036 | 传音控股 | 24,347 | 2,172,482.81 | | 0.58 |
| 41 | 001979 | 招商蛇口 | 160,265 | 2,152,358.95 | | 0.58 |
| 42 | 002938 | 鹏鼎控股 | 70,384 | 2,126,300.64 | | 0.57 |
| 43 | 000066 | 中国长城 | 195,750 | 2,118,015.00 | | 0.57 |
| 44 | 600183 | 生益科技 | 117,106 | 1,989,630.94 | | 0.53 |
| 45 | 601138 | 工业富联 | 200,900 | 1,976,856.00 | | 0.53 |
| 46 | 300012 | 华测检测 | 85,000 | 1,972,850.00 | | 0.53 |
| 47 | 002916 | 深南电路 | 20,580 | 1,928,551.80 | | 0.52 |
| 48 | 600029 | 南方航空 | 256,300 | 1,873,553.00 | | 0.50 |
| 49 | 600383 | 金地集团 | 137,000 | 1,841,280.00 | | 0.49 |
| 50 | 300676 | 华大基因 | 25,095 | 1,799,311.50 | | 0.48 |
| 51 | 002138 | 顺络电子 | 65,200 | 1,776,700.00 | | 0.48 |
| 52 | 000009 | 中国宝安 | 130,395 | 1,759,028.55 | | 0.47 |
| 53 | 002030 | 达安基因 | 99,400 | 1,708,686.00 | | 0.46 |
| 54 | 002465 | 海格通信 | 186,416 | 1,694,521.44 | | 0.46 |
| 55 | 003816 | 中国广核 | 596,700 | 1,670,760.00 | | 0.45 |
| 56 | 300136 | 信维通信 | 97,844 | 1,648,671.40 | | 0.44 |
| 57 | 002294 | 信立泰 | 56,400 | 1,584,840.00 | | 0.43 |
| 58 | 002456 | 欧菲光 | 230,600 | 1,547,326.00 | | 0.42 |
| 59 | 000636 | 风华高科 | 81,900 | 1,538,901.00 | | 0.41 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 60 | 002683 | 广东宏大 | 53,000 | 1,474,990.00 | 0.40 |
| 61 | 603160 | 汇顶科技 | 23,200 | 1,436,776.00 | 0.39 |
| 62 | 300832 | 新产业 | 31,840 | 1,436,302.40 | 0.39 |
| 63 | 002600 | 领益智造 | 285,900 | 1,435,218.00 | 0.39 |
| 64 | 600380 | 健康元 | 116,009 | 1,432,711.15 | 0.39 |
| 65 | 603833 | 欧派家居 | 9,261 | 1,395,447.48 | 0.38 |
| 66 | 002736 | 国信证券 | 145,806 | 1,395,363.42 | 0.38 |
| 67 | 000513 | 丽珠集团 | 37,961 | 1,374,567.81 | 0.37 |
| 68 | 000069 | 华侨城 A | 207,400 | 1,346,026.00 | 0.36 |
| 69 | 000050 | 深天马 A | 124,258 | 1,238,852.26 | 0.33 |
| 70 | 002152 | 广电运通 | 125,600 | 1,164,312.00 | 0.31 |
| 71 | 600332 | 白云山 | 35,500 | 1,121,445.00 | 0.30 |
| 72 | 300146 | 汤臣倍健 | 51,579 | 1,116,685.35 | 0.30 |
| 73 | 300482 | 万孚生物 | 27,020 | 1,099,984.20 | 0.30 |
| 74 | 002797 | 第一创业 | 170,000 | 1,089,700.00 | 0.29 |
| 75 | 600872 | 中炬高新 | 28,790 | 996,421.90 | 0.27 |
| 76 | 600004 | 白云机场 | 60,861 | 907,437.51 | 0.24 |
| 77 | 688208 | 道通科技 | 27,495 | 905,135.40 | 0.24 |
| 78 | 000999 | 华润三九 | 20,010 | 900,450.00 | 0.24 |
| 79 | 002791 | 坚朗五金 | 6,700 | 869,124.00 | 0.23 |
| 80 | 000039 | 中集集团 | 62,100 | 860,085.00 | 0.23 |
| 81 | 603233 | 大参林 | 22,997 | 719,806.10 | 0.19 |
| 82 | 002399 | 海普瑞 | 38,600 | 678,588.00 | 0.18 |
| 83 | 000027 | 深圳能源 | 96,240 | 616,898.40 | 0.17 |
| 84 | 603228 | 景旺电子 | 26,405 | 616,028.65 | 0.17 |
| 85 | 000021 | 深科技 | 47,300 | 550,572.00 | 0.15 |
| 86 | 000987 | 越秀金控 | 76,093 | 534,933.79 | 0.14 |
| 87 | 002511 | 中顺洁柔 | 41,060 | 514,071.20 | 0.14 |
| 88 | 002939 | 长城证券 | 47,600 | 483,616.00 | 0.13 |
| 89 | 002745 | 木林森 | 46,700 | 456,259.00 | 0.12 |
| 90 | 002429 | 兆驰股份 | 114,500 | 439,680.00 | 0.12 |
| 91 | 300888 | 稳健医疗 | 6,500 | 432,250.00 | 0.12 |
| 92 | 003035 | 南网能源 | 57,500 | 365,125.00 | 0.10 |
| 93 | 002867 | 周大生 | 22,350 | 347,095.50 | 0.09 |
| 94 | 300979 | 华利集团 | 4,700 | 343,476.00 | 0.09 |
| 95 | 301029 | 怡合达 | 4,000 | 326,000.00 | 0.09 |
| 96 | 000967 | 盈峰环境 | 64,300 | 325,358.00 | 0.09 |
| 97 | 300973 | 立高食品 | 2,600 | 270,270.00 | 0.07 |
| 98 | 002945 | 华林证券 | 14,500 | 221,125.00 | 0.06 |
| 99 | 601139 | 深圳燃气 | 29,100 | 201,954.00 | 0.05 |
| 100 | 301177 | 迪阿股份 | 1,812 | 134,450.40 | 0.04 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 688063 | 派能科技 | 3,007 | 938,785.40 | 0.25 |
| 2 | 688345 | 博力威 | 2,332 | 143,348.04 | 0.04 |
| 3 | 688317 | 之江生物 | 3,731 | 139,502.09 | 0.04 |
| 4 | 688306 | 均普智能 | 22,740 | 118,020.60 | 0.03 |
| 5 | 688685 | 迈信林 | 2,612 | 74,703.20 | 0.02 |
| 6 | 688283 | 坤恒顺维 | 1,595 | 72,428.95 | 0.02 |
| 7 | 688737 | 中自科技 | 1,700 | 70,261.00 | 0.02 |
| 8 | 688607 | 康众医疗 | 1,890 | 48,535.20 | 0.01 |
| 9 | 688655 | 迅捷兴 | 3,083 | 39,585.72 | 0.01 |
| 10 | 688501 | 青达环保 | 1,759 | 27,071.01 | 0.01 |
| 11 | 301122 | 采纳股份 | 285 | 20,055.45 | 0.01 |
| 12 | 301101 | 明月镜片 | 371 | 19,043.43 | 0.01 |
| 13 | 301263 | 泰恩康 | 600 | 18,828.00 | 0.01 |
| 14 | 301256 | 华融化学 | 1,758 | 17,720.64 | 0.00 |
| 15 | 301127 | 天源环保 | 1,526 | 16,984.38 | 0.00 |
| 16 | 301201 | 诚达药业 | 237 | 16,954.98 | 0.00 |
| 17 | 301235 | 华康医疗 | 418 | 15,854.74 | 0.00 |
| 18 | 301168 | 通灵股份 | 329 | 14,831.32 | 0.00 |
| 19 | 301236 | 软通动力 | 468 | 14,685.84 | 0.00 |
| 20 | 301221 | 光庭信息 | 220 | 14,262.60 | 0.00 |
| 21 | 301199 | 迈赫股份 | 402 | 12,880.08 | 0.00 |
| 22 | 301207 | 华兰疫苗 | 226 | 12,750.92 | 0.00 |
| 23 | 301103 | 何氏眼科 | 372 | 11,911.44 | 0.00 |
| 24 | 301116 | 益客食品 | 577 | 11,805.42 | 0.00 |
| 25 | 301216 | 万凯新材 | 388 | 11,577.92 | 0.00 |
| 26 | 301096 | 百诚医药 | 133 | 10,507.00 | 0.00 |
| 27 | 301111 | 粤万年青 | 379 | 10,392.18 | 0.00 |
| 28 | 301219 | 腾远钴业 | 115 | 10,099.30 | 0.00 |
| 29 | 301237 | 和顺科技 | 235 | 9,837.10 | 0.00 |
| 30 | 301190 | 善水科技 | 412 | 9,776.76 | 0.00 |
| 31 | 301100 | 风光股份 | 446 | 9,624.68 | 0.00 |
| 32 | 301123 | 奕东电子 | 375 | 9,521.25 | 0.00 |
| 33 | 301258 | 富士莱 | 221 | 9,211.28 | 0.00 |
| 34 | 301166 | 优宁维 | 156 | 9,182.16 | 0.00 |
| 35 | 301130 | 西点药业 | 237 | 8,934.90 | 0.00 |
| 36 | 301189 | 奥尼电子 | 251 | 8,360.81 | 0.00 |
| 37 | 300834 | 星辉环材 | 271 | 8,138.13 | 0.00 |
| 38 | 301181 | 标榜股份 | 257 | 7,861.63 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 39 | 301158 | 德石股份 | 379 | 7,724.02 | 0.00 |
| 40 | 301198 | 喜悦智行 | 340 | 7,667.00 | 0.00 |
| 41 | 301196 | 唯科科技 | 160 | 6,003.20 | 0.00 |
| 42 | 603206 | 嘉环科技 | 10 | 193.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 300769 | 德方纳米 | 3,882,983.80 | 0.93 |
| 2 | 300568 | 星源材质 | 3,076,181.62 | 0.73 |
| 3 | 002850 | 科达利 | 2,092,180.00 | 0.50 |
| 4 | 002600 | 领益智造 | 1,300,631.85 | 0.31 |
| 5 | 002709 | 天赐材料 | 789,255.00 | 0.19 |
| 6 | 002180 | 纳思达 | 469,278.00 | 0.11 |
| 7 | 002594 | 比亚迪 | 444,015.00 | 0.11 |
| 8 | 601615 | 明阳智能 | 422,743.00 | 0.10 |
| 9 | 300454 | 深信服 | 385,668.00 | 0.09 |
| 10 | 600036 | 招商银行 | 368,335.00 | 0.09 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 342,907.00 | 0.08 |
| 12 | 300760 | 迈瑞医疗 | 342,670.00 | 0.08 |
| 13 | 002475 | 立讯精密 | 339,147.00 | 0.08 |
| 14 | 688220 | 翱捷科技 | 313,284.16 | 0.07 |
| 15 | 301029 | 怡合达 | 310,735.00 | 0.07 |
| 16 | 000333 | 美的集团 | 296,587.00 | 0.07 |
| 17 | 688207 | 格灵深瞳 | 273,231.31 | 0.07 |
| 18 | 002294 | 信立泰 | 270,729.00 | 0.06 |
| 19 | 300724 | 捷佳伟创 | 263,678.00 | 0.06 |
| 20 | 000066 | 中国长城 | 250,134.00 | 0.06 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|----------------|
| 1 | 002594 | 比亚迪 | 1,279,910.00 | 0.31 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 940,655.00 | 0.22 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 924,325.00 | 0.22 |
| 4 | 300760 | 迈瑞医疗 | 733,285.00 | 0.18 |
| 5 | 600685 | 中船防务 | 698,456.00 | 0.17 |
| 6 | 002572 | 索菲亚 | 688,802.93 | 0.16 |
| 7 | 002475 | 立讯精密 | 672,194.00 | 0.16 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 568,872.00 | 0.14 |

| | | | | |
|----|--------|--------|------------|------|
| 9 | 300124 | 汇川技术 | 485,906.00 | 0.12 |
| 10 | 300014 | 亿纬锂能 | 464,408.00 | 0.11 |
| 11 | 688223 | 晶科能源 | 461,883.48 | 0.11 |
| 12 | 001914 | 招商积余 | 352,075.00 | 0.08 |
| 13 | 000651 | 格力电器 | 345,776.00 | 0.08 |
| 14 | 000063 | 中兴通讯 | 343,226.00 | 0.08 |
| 15 | 000089 | 深圳机场 | 340,336.00 | 0.08 |
| 16 | 002705 | 新宝股份 | 328,291.00 | 0.08 |
| 17 | 000001 | 平安银行 | 323,724.00 | 0.08 |
| 18 | 000002 | 万科 A | 283,990.00 | 0.07 |
| 19 | 000100 | TCL 科技 | 279,089.00 | 0.07 |
| 20 | 688207 | 格灵深瞳 | 278,671.02 | 0.07 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|---------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 24,074,751.33 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 21,218,534.08 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本报告期末本基金未持有债券投资。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

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

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字(2022)21 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、未报送权益类投资业务 EAST 数据；五、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；六、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；七、漏报委托贷款业务 EAST 数据；八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报，根据中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对招商银行股份有限公司罚款 300 万元。

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 6,379.25 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 75,616.24 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 81,995.49 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1 | 688306 | 均普智能 | 118,020.60 | 0.03 | 新股锁定 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数 (户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|--------------|---------------|----------------|---------------|---------------|---------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比 例（%） | 持有份额 | 占总份额比例 (%) |
| 814 | 352,564.67 | 274,009,805.00 | 95.48 | 12,977,833.00 | 4.52 |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额(份) | 占上市总份额比例(%) |
|----|------------------------|----------------|-------------|
| 1 | 安邦人寿保险股份有限公司—保守型投资组合 | 173,149,075.00 | 60.33 |
| 2 | 中国平安人寿保险股份有限公司—分红—个险分红 | 100,012,730.00 | 34.85 |
| 3 | 周旭 | 1,008,000.00 | 0.35 |
| 4 | 陶莉 | 1,000,000.00 | 0.35 |
| 5 | 海通证券股份有限公司 | 848,000.00 | 0.30 |
| 6 | 杨德凤 | 630,000.00 | 0.22 |
| 7 | 王静 | 441,617.00 | 0.15 |
| 8 | 王喜洁 | 400,000.00 | 0.14 |
| 9 | 霍健 | 349,700.00 | 0.12 |

| | | | |
|----|-----|------------|------|
| 10 | 孙尔维 | 349,500.00 | 0.12 |
|----|-----|------------|------|

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|------------------------------------|------------------|
| 基金合同生效日（2019 年 9 月 23 日） 基金份额总额 | 6,009,987,638.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 286,987,638.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 286,987,638.00 |

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元 数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|------------|-------------------|-------------------------|-----------|-----------------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成 交总额的比例 (%) | 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 (%) | |
| 中泰证券 | 2 | 29,074,331.8 3 | 71.06 | 20,911.69 | 71.16 | - |
| 平安证券 | 2 | 11,840,783.5 2 | 28.94 | 8,475.17 | 28.84 | - |
| 长江证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 东方财富 证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | 6 | - | - | - | - | - |
| 太平洋证 券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 新时代 | 2 | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | 3 | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、本报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更情况

2、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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------|------|-------------------------|--------|---------------------------|------|-------------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券 成交总额的 比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回 购成交总额的 比例(%) | 成交金额 | 占当期权证 成交总额的 比例(%) |
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|------------|---|---|----------------|--------|---|---|
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 平安证券 | - | - | 246,000,000.00 | 100.00 | - | - |
| 长江证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方财富 证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国盛证券 | - | - | - | - | - | - |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |
| 太平洋证 券 | - | - | - | - | - | - |
| 新时代 | - | - | - | - | - | - |
| 招商证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中信建投 证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|--------------|-------------|
| 1 | 关于旗下证券投资基金实施新会计准则等相关事宜的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年01月01日 |
| 2 | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年01月12日 |
| 3 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金管理 2021 年第 4 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年01月21日 |
| 4 | 平安基金管理有限公司关于旗下基金新增华安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 | 2022年03月22日 |
| 5 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金管理 2021 年年度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年03月31日 |
| 6 | 平安基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金产品风险评级相关事项的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年04月02日 |
| 7 | 平安基金管理有限公司关于旗下基金新增东吴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 | 2022年04月07日 |
| 8 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金管理 2022 年第 1 季度报告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年04月21日 |
| 9 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金管理招募说明 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022年05月31日 |

| | | | |
|----|---|--------------|------------------|
| | 书（更新） | | |
| 10 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 05 月 31 日 |
| 11 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 06 月 21 日 |
| 12 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 06 月 24 日 |
| 13 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新） | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 06 月 24 日 |
| 14 | 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 06 月 24 日 |
| 15 | 平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告 | 中国证监会规定报刊及网站 | 2022 年 06 月 30 日 |

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|-------|----------------|-------------------------|----------------|------|------|----------------|---------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 2022/01/01--2022/06/30 | 173,149,075.00 | 0.00 | 0.00 | 173,149,075.00 | 60.33 |
| | 2 | 2022/01/01--2022/06/30 | 100,012,730.00 | 0.00 | 0.00 | 100,012,730.00 | 34.85 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

产品特有风险

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注：无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会准予平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金募集注册的文件
- (2) 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (3) 平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (4) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

12.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

12.3 查阅方式

- (1) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件
- (2) 投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司，客户服务电话：400-800-4800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日