

平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数 证券投资基金 2018 年年度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 27 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 26 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。

本报告期自 2018 年 6 月 15 日起至 12 月 31 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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	18

6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
§7 年度财务报表.....	21
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	50
8.1 期末基金资产组合情况.....	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	50
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.....	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细.....	64
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.....	64
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.....	65
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	65
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
8.12 投资组合报告附注.....	65
§9 基金份额持有人信息.....	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	69
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	69
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	69
9.5 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的情况.....	70
§10 开放式基金份额变动.....	71
§11 重大事件揭示.....	72
11.1 基金份额持有人大会决议.....	72
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.....	72

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
11.4 基金投资策略的改变	72
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
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	72
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	72
11.8 其他重大事件	74
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	75
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	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§13 备查文件目录.....	76
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 查阅方式	76

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF
场内简称	MSCI 国际
基金主代码	512360
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 6 月 15 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	386,337,704.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018-07-20

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	MSCI 中国 A 股国际指数 (MSCI China A International Index) 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	易会满

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 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	2018年6月15日 (基金合同生效日)-2018年12月31日	2017年	2016年
本期已实现收益	-8,159,797.28	-	-
本期利润	-58,175,859.06	-	-
加权平均基金份额本期利润	-0.1534	-	-
本期加权平均净值利润率	-16.75%	-	-
本期基金份额净值增长率	-15.40%	-	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末	2017年末	2016年末
期末可供分配利润	-59,501,552.41	-	-
期末可供分配基金份额利润	-0.1540	-	-
期末基金资产净值	326,836,151.59	-	-
期末基金份额净值	0.8460	-	-
3.1.3 累计期末指标	2018年末	2017年末	2016年末
基金份额累计净值增长率	-15.40%	-	-

注：1. 本基金基金合同于2018年06月15日正式生效，截至报告期末未满一年；

2. 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；

3. 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）；

4. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.63%	1.64%	-11.61%	1.65%	-0.02%	-0.01%
过去六个月	-12.98%	1.49%	-14.43%	1.50%	1.45%	-0.01%

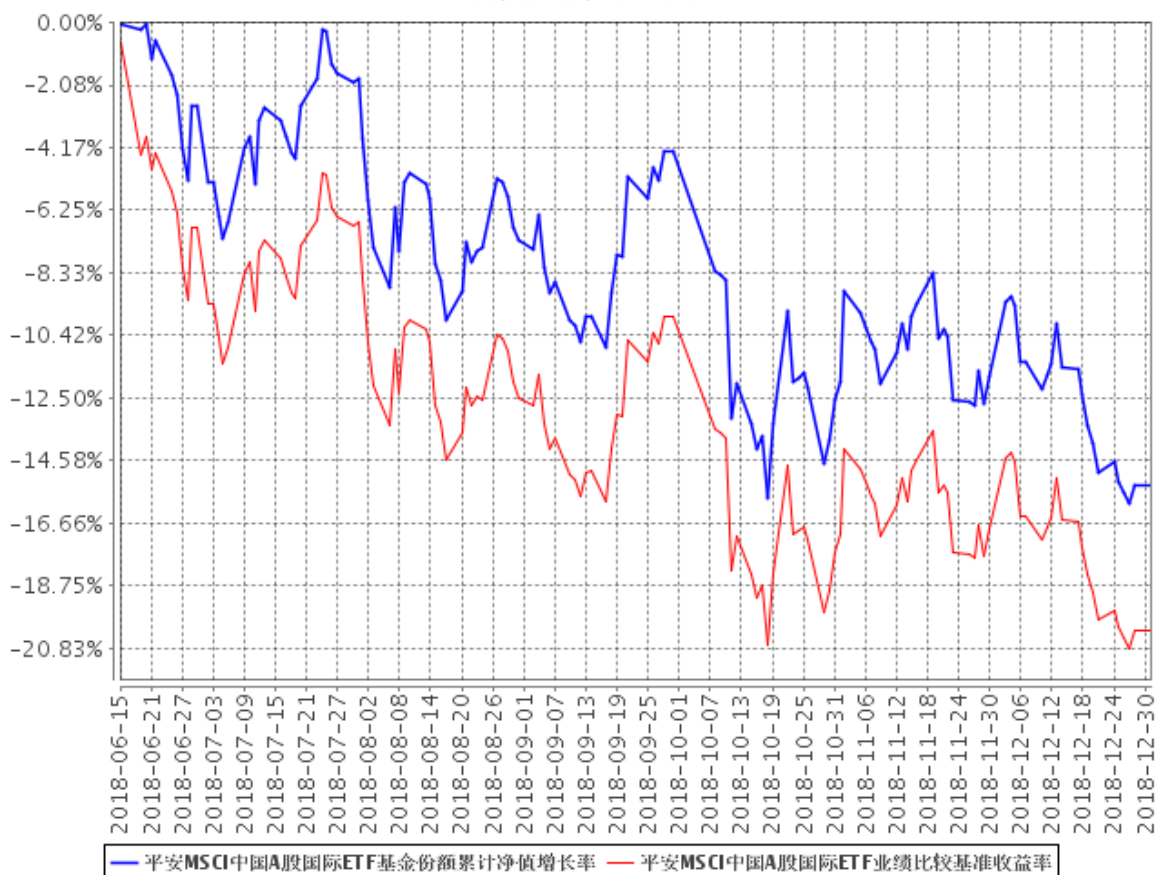
自基金合同生效起至今	-15.40%	1.46%	-20.26%	1.51%	4.86%	-0.05%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	--------

注：1、MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)收益率。MSCI A 股国际指数(MSCI China A International Index)涵盖大中型股票，包括摩根士丹利资本国际中国所有股票指数(MSCI China All Shares Index)的中国 A 股成分股。它基于中国 A 股在摩根士丹利资本国际中国综合股票市场的概念。该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

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

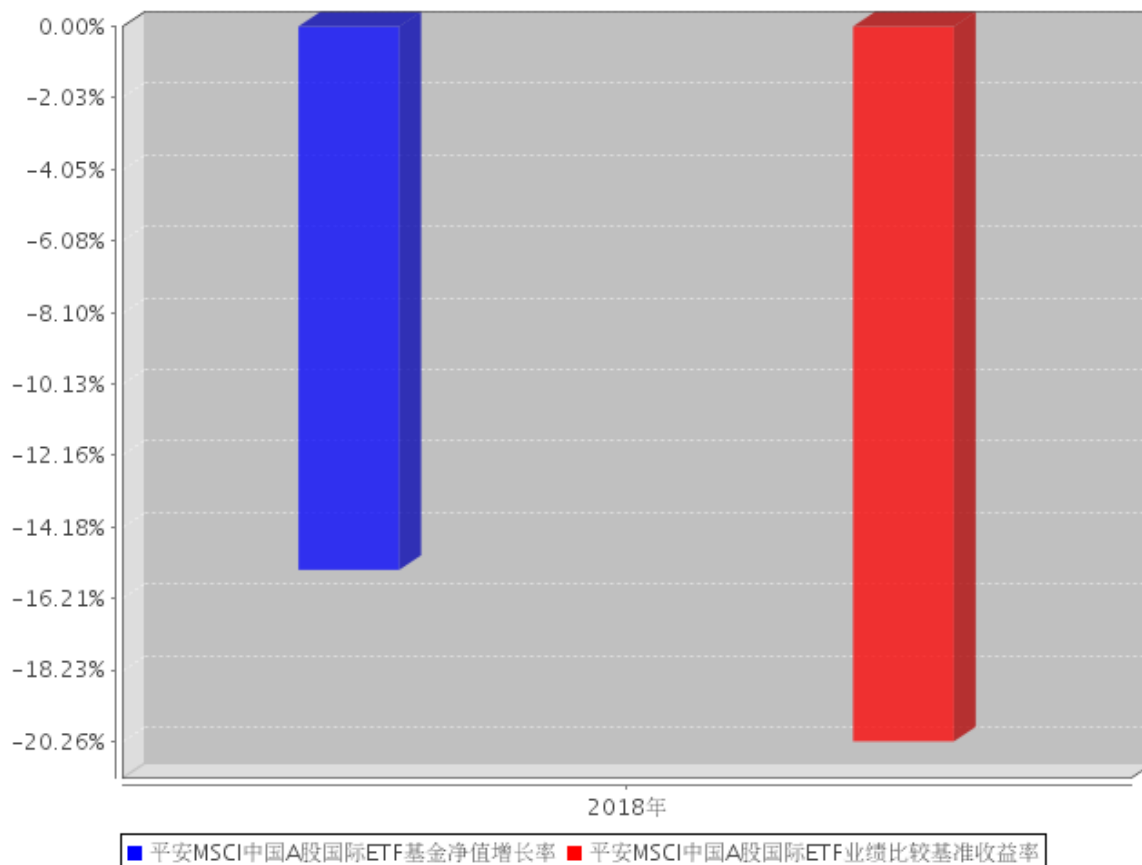
平安MSCI中国A股国际ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2018 年 06 月 15 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合同约定。

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

平安MSCI中国A股国际ETF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对比图



1. 本基金合同于 2018 年 06 月 15 日正式生效，截止报告期末未满一年。
2. 2018 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于 2018 年 6 月 15 日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股权 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2018 年 12 月 31 日，平安基金共管理 66 只公募基金，资产管理总规模 2879 亿元人民币。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
成钧	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理；资产配置事业部 ETF 指数中心指数投资总监；	2018 年 6 月 15 日	-	8	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，现任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基

					金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
刘洁倩	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（助理）	2018 年 7 月 20 日	-	6	刘洁倩女士，浙江大学数学专业博士，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，现任资产配置事业部 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、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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 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基金经理助理。
万纯	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的基金经理（助理）	2018 年 7 月 20 日	-	6	万纯，北京大学计算机软件专业硕士，曾担任中国证券登记结算有限责任公司上海分公司基金业务经办岗。2017 年 7 月加入平安基金管理有限公司，现任资产配置事业部 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、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 MSCI

					中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 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基金经理助理。
--	--	--	--	--	--

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。

4.2 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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则、《平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，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，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管理制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控及报告制度》，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，由投资组合经理、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

回顾 2018 年，中国宏观经济面临来自内外部较大的不确定性。外部中美贸易摩擦引起市场波动较大，叠加美联储加快加息步伐引起全球金融市场震荡起伏。国内市场，“去杠杆”引起市场资金面趋紧，频频爆出股权质押风险，引发市场悲观情绪。截至 2018 年 12 月底，MSCI 中国 A 股国际指数下跌 28.05%。

作为一只投资于 MSCI 中国 A 股国际指数的被动型产品，基金在投资管理上，我们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管理，高度重视绩效归因在组合管理中的

反馈作用，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。截至报告期末，在本基金建仓完毕起的跟踪期内，本基金的日均跟踪误差为 0.03%，年化跟踪误差 0.51%，较好的完成了基金合同中控制年化跟踪误差不超过 2%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 0.8460 元；本报告期基金份额净值增长率为-15.40%，业绩比较基准收益率为-20.26%。

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 2019 年，外部因素企稳，中美谈判渐入佳境，且美联储预计 2019 年加息速度放缓，对国内市场利好。国内方面，政府正在出台组合拳托底经济，适度定向放宽货币政策、加大定向投资、对消费者和企业减税减负、放宽放缓环境政策等都正在推进，市场上行空间大于下行空间。目前市场估值处于底部，对外资吸引力较强，2019 年外资流入有望进一步加速。

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、邮件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工作组,由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组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。估值工作组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量不满 200 人、基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第 23267 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 MSCI 中国 A 股国际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 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 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。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于平安 MSCI 中国 A 股国际 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 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司,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

	<p>的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安 MSCI 中国 A 股国际 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 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督平安 MSCI 中国 A 股国际 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 MSCI 中国 A 股国际 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</p>

	<p>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 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，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	曹翠丽 陈怡
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2019 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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	1,719,634.41	-
结算备付金		121,725.98	-
存出保证金		103,049.74	-
交易性金融资产	7.4.7.2	325,323,162.46	-
其中：股票投资		325,323,162.46	-
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		74,068.99	-
应收利息	7.4.7.5	440.73	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	68,035.50	-
资产总计		327,410,117.81	-
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负债：			
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		18,356.87	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		144,990.35	-
应付托管费		28,998.10	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	32,859.09	-

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	348,761.81	-
负债合计		573,966.22	-
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	386,337,704.00	-
未分配利润	7.4.7.10	-59,501,552.41	-
所有者权益合计		326,836,151.59	-
负债和所有者权益总计		327,410,117.81	-

注：

1. 报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额总额 386,337,704.00 份，基金份额净值 0.8460 元。
2. 本财务报表的实际编制期间为 2018 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间，无上年度可比期间。

7.2 利润表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 6 月 15 日(基金 合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入		-56,234,128.67	-
1.利息收入		154,485.83	-
其中：存款利息收入	7.4.7.11	138,805.70	-
债券利息收入		0.28	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		15,679.85	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-6,553,622.65	-
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-10,864,175.31	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2.12	-
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	4,310,550.54	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-50,016,061.78	-
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	181,069.93	-
减：二、费用		1,941,730.39	-
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	951,217.92	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	190,243.66	-
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	471,861.29	-
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	328,407.52	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-58,175,859.06	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-58,175,859.06	-

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2018 年 6 月 15 日（基金合同生效日）至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 月 15 日（基金合同生效日）至 2018 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）	323,337,704.00	-	323,337,704.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-58,175,859.06	-58,175,859.06
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）	63,000,000.00	-1,325,693.35	61,674,306.65
其中：1.基金申购款	225,000,000.00	-10,865,985.27	214,134,014.73
2.基金赎回款	-162,000,000.00	9,540,291.92	-152,459,708.08
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）	386,337,704.00	-59,501,552.41	326,836,151.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风	_____ 林婉文	_____ 胡明
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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华 MSCI 中国 A 股国际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]528 号《关于准予平安大华 MSCI 中国 A 股国际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(原平安大华基金管理有限公司,已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华 MSCI 中国 A 股国际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 323,321,955.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0365 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 15 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 323,337,704.00 份基金份额,其中网上现金方式认购资金利息折合 15,749.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“工商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]95 号审核同意,本基金 323,337,704.00 份基金份额于 2018 年 7 月 20 日在上交所挂牌交易。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券

投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为 MSCI 中国 A 股国际指数 (MSCI China A International Index)，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化；投资范围为标的指数 MSCI 中国 A 股国际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)。基金的投资组合比例为：投资于 MSCI 中国 A 股国际指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际指数收益率。

本基金的基金管理人平安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了平安 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 (以下简称“平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金”)。平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定 (以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、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 MSCI 中国 A 股国际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 2018 年 6 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年 6 月 15 日 (基金合同生效日) 至 2018 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 2018

年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 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

金融资产和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。

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、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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；基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；(3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；(4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(5) 每一基金份额享有同等分配权；(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别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、资产支持证券和私募债券除外）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估值业务的指导意见》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、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数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。

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[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费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 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
----	-------------------------	--------------------------

活期存款	1,719,634.41	-
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：	1,719,634.41	-

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	375,339,224.24	325,323,162.46	-50,016,061.78
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	375,339,224.24	325,323,162.46	-50,016,061.78
项目	上年度末 2017 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
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	-	-	-

注：于 2018 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 0。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

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

本基金于本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 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	339.53	-
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	54.80	-
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	-	-
其他	46.40	-
合计	440.73	-

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
现金差额	68,035.50	-
合计	68,035.50	-

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	32,859.09	-
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	32,859.09	-

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	177,602.74	-
应付指数使用费	95,121.78	-
应付替代款	75,886.99	-
可退替代款	150.30	-
合计	348,761.81	-

注：可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2018 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	323,337,704.00	323,337,704.00
本期申购	225,000,000.00	225,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-162,000,000.00	-162,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	386,337,704.00	386,337,704.00

注：

1. 本基金自 2018 年 5 月 2 日至 2018 年 6 月 8 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 323,321,955.00 元，折合为 323,321,955.00 份基金份额。根据《平安 MSCI 中国 A 股国际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 15,749.00 元在本基金成立后，折合为 15,749.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2. 根据《平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及本基金管理人于 2018 年 7 月 17 日发布的《平安大华基金管理有限公司关于平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金于 2018 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 7 月 19 日止期间暂不向投资人开放基金申购、赎回业务，相关业务自 2018 年 7 月 20 日起开始办理。

3. 投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-8,159,797.28	-50,016,061.78	-58,175,859.06
本期基金份额交易产生的变动数	489,222.69	-1,814,916.04	-1,325,693.35
其中：基金申购款	350,800.26	-11,216,785.53	-10,865,985.27
基金赎回款	138,422.43	9,401,869.49	9,540,291.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-7,670,574.59	-51,830,977.82	-59,501,552.41

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
活期存款利息收入	64,645.63	-
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	5,630.98	-
其他	68,529.09	-
合计	138,805.70	-

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 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日

	31 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,336,604.93	-
股票投资收益——赎回差价收入	-4,527,570.38	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-10,864,175.31	-

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 2018 年 6 月 15 日(基金 合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	77,845,766.58	-
减：卖出股票成本总额	84,182,371.51	-
买卖股票差价收入	-6,336,604.93	-

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 2018 年 6 月 15 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	152,459,708.08	-
减：现金支付赎回款总额	44,488,326.08	-
减：赎回股票成本总额	112,498,952.38	-
赎回差价收入	-4,527,570.38	-

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
债券投资收益——买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入	2.12	-
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	2.12	-

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成交总额	2,002.40	-
减：卖出债券(、债转股及债券到期兑付)成本总额	2,000.00	-
减：应收利息总额	0.28	-
买卖债券差价收入	2.12	-

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

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

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

本基金于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

本基金于本报告期无贵金属投资。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期无贵金属投资收益。

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**

本基金于本期报告期无衍生工具收益。

7.4.7.15.2 衍生工具收益 ——其他投资收益

本基金于本报告期无衍生工具收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,310,550.54	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,310,550.54	-

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-50,016,061.78	-
——股票投资	-50,016,061.78	-
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-50,016,061.78	-

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 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	181,069.93	-
合计	181,069.93	-

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 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
交易所市场交易费用	471,861.29	-
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	471,861.29	-

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日
审计费用	60,000.00	-
信息披露费	95,000.00	-

上市费	55,000.00	-
银行汇划费	283.00	
其他	400.00	
IOPV 计算费	22,602.74	
指数使用费	95,121.78	
合计	328,407.52	-

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、注册登记机构
工商银行	基金托管人
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安大华汇通财富管理有限公司	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	基金管理人的最终控股母公司
平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易****7.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月15日(基金合同生效日)至 2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
平安证券	110,785,770.81	22.49%	-	-

7.4.10.1.2 债券交易

本基金于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

本基金于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

本基金于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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
平安证券	78,802.30	22.49%	12,476.07	37.97%

注：

1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。
2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	951,217.92	-
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人平安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%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：
日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日	2017年1月1日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	190,243.66	-

注：支付基金托管人工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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×0.1%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

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

本基金于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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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 2018年12月31日		上年度末 2017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 MSCI 中 国 A 股国际 ETF 联接基金	206,160,298.00	53.3627%	-	-

7.4.10.5 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 2018年6月15日(基金合同生效日)至 2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	1,719,634.41	64,645.63	-	-

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

(1) 于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 939,600 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 5,258,707.61 元，估值总额为人民币 4,970,484.00 元，占基金资产净值的比例为 1.52%。

(2) 于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 188,700 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 11,632,743.68 元，估值总额为人民币 10,586,070.00 元，占基金资产净值的比例为 3.24%。

(3) 于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有 299,200 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 2,900,330.73 元，估值总额为人民币 2,806,496.00 元，占基金资产净值的比例为 0.86%。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2018 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
601860	紫金银行	2018 年 12 月 20 日	2019 年 1 月 3 日	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600030	中信证券	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	16.01	2019 年 1 月 10 日	17.15	172,800	2,898,664.21	2,766,528.00	-
002183	怡亚通	2018 年 12 月 25 日	重大事项停牌	5.01	2019 年 1 月 2 日	4.96	36,700	238,556.39	183,867.00	-

注：本基金截至 2018 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金未从事银行间市场债券正回购交易，无质押债券。

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金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市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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涉及的财务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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的，由督察长、风险管理委员会、法律合规监察部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行，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以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按短期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

以上按长期信用评级的债券未评级的债券投资为政策性金融债。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持全部证券在证券交易所上市，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

于 2018 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均较短且不计息，本基金赎回基金份额采用一篮子股票形式，流动性风险相对较低。

7.4.13.3.2 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%。于 2018 年 12 月 31 日，本基金主动投资于流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.0153%。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的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。

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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金，存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,719,634.41	-	-	-	-	-	1,719,634.41
结算备付金	121,725.98	-	-	-	-	-	121,725.98
存出保证金	103,049.74	-	-	-	-	-	103,049.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	325,323,162.46	325,323,162.46
应收证券清算款	-	-	-	-	-	74,068.99	74,068.99
应收利息	-	-	-	-	-	440.73	440.73
其他资产	-	-	-	-	-	68,035.50	68,035.50

资产总计	1,944,410.13	-	-	-	-	325,465,707.68	327,410,117.81
负债							
应付证券清算款		-	-	-	-	18,356.87	18,356.87
应付管理人报酬		-	-	-	-	144,990.35	144,990.35
应付托管费		-	-	-	-	28,998.10	28,998.10
应付交易费用		-	-	-	-	32,859.09	32,859.09
其他负债		-	-	-	-	348,761.81	348,761.81
负债总计		-	-	-	-	573,966.22	573,966.22
利率敏感度缺口	1,944,410.13	-	-	-	-	324,891,741.46	326,836,151.59

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

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券，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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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。

本基金投资于 MSCI 中国 A 股国际指数 (MSCI China A International Index) 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%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及

时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 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	325,323,162.46	99.54	-	-
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	325,323,162.46	99.54	-	-

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2018 年 12 月 31 日）	上年度末（2017 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	17,522,085.17	-
	业绩比较基准减少 5%	-17,522,085.17	-

本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际指数（MSCI China A International Index）收益率。

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 2018 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 322,322,621.66 元, 属于第二层次的余额为 3,000,540.80 元, 无属于第三层次的余额。于 2018 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负债均属于第一层次。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券, 若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况, 本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次; 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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 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 2018 年度, 本基金申购基金份额的对价总额为 214,134,014.73 元, 其中包括以股票支付的申购款 147,503,875.14 元和以现金支付的申购款 66,630,139.59 元。

(3) 其他

除公允价值和基金申购款外, 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	325,323,162.46	99.36
	其中：股票	325,323,162.46	99.36
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	1,841,360.39	0.56
8	其他各项资产	245,594.96	0.08
9	合计	327,410,117.81	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,450,438.00	0.44
B	采矿业	13,567,774.00	4.15
C	制造业	134,737,645.66	41.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,631,713.00	3.56
E	建筑业	10,855,213.00	3.32
F	批发和零售业	8,357,924.00	2.56
G	交通运输、仓储和邮政业	11,022,542.00	3.37
H	住宿和餐饮业	466,218.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,517,642.50	3.83
J	金融业	95,384,653.80	29.18
K	房地产业	17,841,978.00	5.46
L	租赁和商务服务业	4,000,520.20	1.22

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	256,633.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	819,260.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	1,665,981.00	0.51
S	综合	630,841.00	0.19
	合计	325,206,977.16	99.50

8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	66,039.50	0.02
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	50,145.80	0.02
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	116,185.30	0.04

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	21,800	12,862,218.00	3.94
2	601318	中国平安	188,700	10,586,070.00	3.24
3	600036	招商银行	359,500	9,059,400.00	2.77
4	601166	兴业银行	362,000	5,408,280.00	1.65
5	600000	浦发银行	511,300	5,010,740.00	1.53
6	601398	工商银行	939,600	4,970,484.00	1.52
7	601288	农业银行	1,298,100	4,673,160.00	1.43
8	000333	美的集团	115,500	4,257,330.00	1.30
9	601668	中国建筑	731,840	4,171,488.00	1.28
10	002415	海康威视	160,637	4,138,009.12	1.27
11	600900	长江电力	255,700	4,060,516.00	1.24
12	000002	万科A	169,500	4,037,490.00	1.24
13	601328	交通银行	684,200	3,961,518.00	1.21
14	600104	上汽集团	135,600	3,616,452.00	1.11
15	600016	民生银行	618,300	3,542,859.00	1.08
16	000858	五粮液	67,700	3,444,576.00	1.05
17	600276	恒瑞医药	64,130	3,382,857.50	1.04
18	601766	中国中车	353,200	3,185,864.00	0.97
19	601601	中国太保	109,300	3,107,399.00	0.95
20	601988	中国银行	857,300	3,094,853.00	0.95
21	000001	平安银行	299,200	2,806,496.00	0.86
22	600050	中国联通	540,500	2,794,385.00	0.85
23	600030	中信证券	172,800	2,766,528.00	0.85
24	603288	海天味业	39,300	2,703,840.00	0.83
25	601818	光大银行	693,600	2,566,320.00	0.79
26	002304	洋河股份	26,300	2,491,136.00	0.76
27	600048	保利地产	206,700	2,436,993.00	0.75
28	600887	伊利股份	106,000	2,425,280.00	0.74
29	600028	中国石化	443,800	2,241,190.00	0.69
30	601186	中国铁建	200,200	2,176,174.00	0.67
31	601006	大秦铁路	259,200	2,133,216.00	0.65
32	601229	上海银行	190,420	2,130,799.80	0.65

33	600019	宝钢股份	323,600	2,103,400.00	0.64
34	601169	北京银行	368,300	2,066,163.00	0.63
35	600585	海螺水泥	69,900	2,046,672.00	0.63
36	601888	中国国旅	33,929	2,042,525.80	0.62
37	601857	中国石油	282,100	2,033,941.00	0.62
38	601211	国泰君安	130,800	2,003,856.00	0.61
39	001979	招商蛇口	114,700	1,990,045.00	0.61
40	000651	格力电器	52,500	1,873,725.00	0.57
41	601688	华泰证券	114,300	1,851,660.00	0.57
42	601989	中国重工	399,100	1,696,175.00	0.52
43	600015	华夏银行	223,500	1,651,665.00	0.51
44	002594	比亚迪	31,800	1,621,800.00	0.50
45	002024	苏宁易购	163,000	1,605,550.00	0.49
46	000725	京东方 A	593,400	1,560,642.00	0.48
47	601336	新华保险	36,300	1,533,312.00	0.47
48	600690	青岛海尔	107,000	1,481,950.00	0.45
49	600406	国电南瑞	79,700	1,476,841.00	0.45
50	002142	宁波银行	88,800	1,440,336.00	0.44
51	601088	中国神华	76,900	1,381,124.00	0.42
52	000538	云南白药	18,200	1,346,072.00	0.41
53	600999	招商证券	99,600	1,334,640.00	0.41
54	000166	申万宏源	327,500	1,332,925.00	0.41
55	601933	永辉超市	167,400	1,317,438.00	0.40
56	600340	华夏幸福	51,700	1,315,765.00	0.40
57	000776	广发证券	103,100	1,307,308.00	0.40
58	600837	海通证券	141,500	1,245,200.00	0.38
59	600919	江苏银行	202,200	1,207,134.00	0.37
60	000063	中兴通讯	60,000	1,175,400.00	0.36
61	603993	洛阳钼业	308,100	1,158,456.00	0.35
62	000895	双汇发展	48,300	1,139,397.00	0.35
63	600031	三一重工	136,500	1,138,410.00	0.35
64	002027	分众传媒	213,760	1,120,102.40	0.34
65	601939	建设银行	168,900	1,075,893.00	0.33
66	000568	泸州老窖	25,700	1,044,962.00	0.32
67	002475	立讯精密	72,060	1,013,163.60	0.31
68	600741	华域汽车	55,000	1,012,000.00	0.31
69	601899	紫金矿业	297,900	994,986.00	0.30
70	600029	南方航空	149,600	993,344.00	0.30
71	601628	中国人寿	48,300	984,837.00	0.30

72	600010	包钢股份	663,800	982,424.00	0.30
73	600547	山东黄金	32,400	980,100.00	0.30
74	601618	中国中冶	312,800	972,808.00	0.30
75	601009	南京银行	149,000	962,540.00	0.29
76	600886	国投电力	119,200	959,560.00	0.29
77	601985	中国核电	179,200	944,384.00	0.29
78	601155	新城控股	39,600	938,124.00	0.29
79	600436	片仔癀	10,500	909,825.00	0.28
80	000069	华侨城 A	142,700	906,145.00	0.28
81	002230	科大讯飞	36,400	896,896.00	0.27
82	601877	正泰电器	37,000	896,880.00	0.27
83	600332	白云山	24,500	876,120.00	0.27
84	601225	陕西煤业	117,400	873,456.00	0.27
85	600606	绿地控股	141,900	867,009.00	0.27
86	600795	国电电力	338,500	866,560.00	0.27
87	601669	中国电建	178,000	865,080.00	0.26
88	600009	上海机场	17,000	862,920.00	0.26
89	002714	牧原股份	29,960	861,350.00	0.26
90	601012	隆基股份	49,100	856,304.00	0.26
91	600893	航发动力	39,389	855,529.08	0.26
92	600958	东方证券	104,100	829,677.00	0.25
93	000338	潍柴动力	106,400	819,280.00	0.25
94	002044	美年健康	54,800	819,260.00	0.25
95	600196	复星医药	35,000	814,450.00	0.25
96	600703	三安光电	71,200	805,272.00	0.25
97	600518	康美药业	87,230	803,388.30	0.25
98	600660	福耀玻璃	34,900	795,022.00	0.24
99	601138	工业富联	67,900	786,961.00	0.24
100	601901	方正证券	144,800	768,888.00	0.24
101	600018	上港集团	148,000	766,640.00	0.23
102	600383	金地集团	79,000	759,980.00	0.23
103	600023	浙能电力	159,100	752,543.00	0.23
104	600271	航天信息	32,600	746,214.00	0.23
105	600588	用友网络	33,000	702,900.00	0.22
106	600115	东方航空	143,400	681,150.00	0.21
107	600482	中国动力	30,200	672,554.00	0.21
108	000963	华东医药	25,400	672,084.00	0.21
109	002352	顺丰控股	20,400	668,100.00	0.20
110	600705	中航资本	157,100	666,104.00	0.20

111	601727	上海电气	134,400	663,936.00	0.20
112	600027	华电国际	139,700	663,575.00	0.20
113	600674	川投能源	76,200	660,654.00	0.20
114	600085	同仁堂	23,900	657,250.00	0.20
115	600926	杭州银行	88,080	651,792.00	0.20
116	000768	中航飞机	48,400	640,816.00	0.20
117	002311	海大集团	27,200	630,224.00	0.19
118	600011	华能国际	84,800	625,824.00	0.19
119	601111	中国国航	81,700	624,188.00	0.19
120	600637	东方明珠	59,290	607,129.60	0.19
121	002146	荣盛发展	76,100	604,995.00	0.19
122	601788	光大证券	68,500	600,745.00	0.18
123	002736	国信证券	71,500	598,455.00	0.18
124	600176	中国巨石	61,200	591,804.00	0.18
125	002466	天齐锂业	19,900	583,468.00	0.18
126	000656	金科股份	93,500	578,765.00	0.18
127	002236	大华股份	50,400	577,584.00	0.18
128	000100	TCL 集团	234,700	575,015.00	0.18
129	601607	上海医药	33,400	567,800.00	0.17
130	600487	亨通光电	33,060	563,673.00	0.17
131	002008	大族激光	18,400	558,624.00	0.17
132	600570	恒生电子	10,700	556,186.00	0.17
133	002001	新 和 成	37,000	555,370.00	0.17
134	600111	北方稀土	63,100	553,387.00	0.17
135	600438	通威股份	66,800	553,104.00	0.17
136	600498	烽火通信	19,200	546,624.00	0.17
137	600352	浙江龙盛	56,500	545,225.00	0.17
138	601919	中远海控	133,700	540,148.00	0.17
139	601998	中信银行	98,200	535,190.00	0.16
140	601377	兴业证券	115,000	533,600.00	0.16
141	600809	山西汾酒	15,200	532,760.00	0.16
142	000709	河钢股份	187,200	531,648.00	0.16
143	601800	中国交建	47,000	529,220.00	0.16
144	002007	华兰生物	16,100	528,080.00	0.16
145	000876	新 希 望	72,500	527,800.00	0.16
146	600516	方大炭素	30,800	514,668.00	0.16
147	600489	中金黄金	59,900	513,942.00	0.16
148	002422	科伦药业	24,700	510,055.00	0.16
149	002493	荣盛石化	50,500	509,545.00	0.16

150	600346	恒力股份	38,400	508,800.00	0.16
151	601992	金隅集团	145,200	508,200.00	0.16
152	000661	长春高新	2,900	507,500.00	0.16
153	600100	同方股份	51,800	504,014.00	0.15
154	600068	葛洲坝	79,300	501,176.00	0.15
155	600535	天士力	26,100	501,120.00	0.15
156	002202	金风科技	50,100	500,499.00	0.15
157	002032	苏泊尔	9,500	498,750.00	0.15
158	000783	长江证券	96,400	496,460.00	0.15
159	600867	通化东宝	35,200	489,280.00	0.15
160	601360	三六零	23,500	478,695.00	0.15
161	600998	九州通	32,700	477,420.00	0.15
162	600362	江西铜业	35,900	472,444.00	0.14
163	002673	西部证券	61,500	471,705.00	0.14
164	600977	中国电影	32,800	469,696.00	0.14
165	002179	中航光电	13,900	468,152.00	0.14
166	600170	上海建工	154,100	466,923.00	0.14
167	600066	宇通客车	38,900	460,965.00	0.14
168	002050	三花智控	36,300	460,647.00	0.14
169	601117	中国化学	84,600	453,456.00	0.14
170	000423	东阿阿胶	11,400	450,870.00	0.14
171	002558	巨人网络	23,200	449,384.00	0.14
172	600177	雅戈尔	61,700	443,623.00	0.14
173	600760	中航沈飞	16,000	443,360.00	0.14
174	000625	长安汽车	67,000	441,530.00	0.14
175	600089	特变电工	64,900	440,671.00	0.13
176	600256	广汇能源	116,800	439,168.00	0.13
177	600522	中天科技	53,700	437,655.00	0.13
178	600219	南山铝业	206,930	436,622.30	0.13
179	002601	龙蟠佰利	35,400	435,420.00	0.13
180	603799	华友钴业	14,460	435,390.60	0.13
181	002506	协鑫集成	87,000	435,000.00	0.13
182	000425	徐工机械	134,500	434,435.00	0.13
183	000413	东旭光电	96,300	433,350.00	0.13
184	002456	欧菲科技	47,000	431,930.00	0.13
185	600208	新湖中宝	148,300	430,070.00	0.13
186	601021	春秋航空	13,400	426,254.00	0.13
187	002460	赣锋锂业	19,300	426,144.00	0.13
188	000999	华润三九	17,100	425,106.00	0.13

189	600688	上海石化	85,100	424,649.00	0.13
190	601997	贵阳银行	39,700	423,996.00	0.13
191	002624	完美世界	15,100	420,535.00	0.13
192	600655	豫园股份	56,400	417,360.00	0.13
193	002399	海普瑞	18,100	417,205.00	0.13
194	600600	青岛啤酒	11,900	414,834.00	0.13
195	000728	国元证券	58,800	410,424.00	0.13
196	600816	安信信托	93,900	410,343.00	0.13
197	600895	张江高科	27,300	408,135.00	0.12
198	600872	中炬高新	13,700	403,602.00	0.12
199	002013	中航机电	61,900	402,969.00	0.12
200	600528	中铁工业	38,200	401,100.00	0.12
201	000786	北新建材	29,100	400,416.00	0.12
202	002153	石基信息	15,400	399,784.00	0.12
203	603899	晨光文具	13,200	399,300.00	0.12
204	600566	济川药业	11,900	399,007.00	0.12
205	000157	中联重科	111,900	398,364.00	0.12
206	603019	中科曙光	11,100	398,268.00	0.12
207	000627	天茂集团	70,900	397,749.00	0.12
208	002410	广联达	19,100	397,471.00	0.12
209	601872	招商轮船	105,800	390,402.00	0.12
210	600699	均胜电子	16,600	387,776.00	0.12
211	600297	广汇汽车	95,400	387,324.00	0.12
212	601238	广汽集团	37,600	386,904.00	0.12
213	601098	中南传媒	30,900	386,250.00	0.12
214	600038	中直股份	10,300	384,808.00	0.12
215	603858	步长制药	15,220	384,761.60	0.12
216	002241	歌尔股份	55,800	383,904.00	0.12
217	600673	东阳光科	52,700	383,656.00	0.12
218	600642	申能股份	78,400	382,592.00	0.12
219	600875	东方电气	48,100	379,509.00	0.12
220	600109	国金证券	53,000	379,480.00	0.12
221	002065	东华软件	54,400	378,080.00	0.12
222	601198	东兴证券	39,500	377,620.00	0.12
223	002081	金螳螂	46,400	375,840.00	0.11
224	603833	欧派家居	4,700	374,684.00	0.11
225	600583	海油工程	75,700	370,930.00	0.11
226	000938	紫光股份	11,860	370,743.60	0.11
227	600021	上海电力	45,700	370,170.00	0.11

228	603589	口子窖	10,500	368,235.00	0.11
229	000898	鞍钢股份	71,700	367,821.00	0.11
230	600183	生益科技	36,400	366,184.00	0.11
231	000961	中南建设	65,200	365,772.00	0.11
232	600004	白云机场	36,300	364,815.00	0.11
233	000671	阳光城	69,800	362,262.00	0.11
234	600298	安琪酵母	14,200	358,266.00	0.11
235	600497	驰宏锌锗	87,100	357,110.00	0.11
236	601018	宁波港	106,900	357,046.00	0.11
237	002372	伟星新材	23,000	356,730.00	0.11
238	000977	浪潮信息	22,400	356,608.00	0.11
239	000630	铜陵有色	181,000	356,570.00	0.11
240	002110	三钢闽光	27,700	354,283.00	0.11
241	600808	马钢股份	102,300	353,958.00	0.11
242	601555	东吴证券	52,500	351,750.00	0.11
243	600118	中国卫星	20,300	351,596.00	0.11
244	000596	古井贡酒	6,500	350,740.00	0.11
245	000975	银泰资源	34,000	346,460.00	0.11
246	000050	深天马 A	35,200	345,312.00	0.11
247	002223	鱼跃医疗	17,600	345,136.00	0.11
248	600153	建发股份	48,700	343,335.00	0.11
249	600820	隧道股份	54,800	343,048.00	0.10
250	601699	潞安环能	51,300	341,658.00	0.10
251	000792	盐湖股份	48,800	340,624.00	0.10
252	600704	物产中大	73,900	338,462.00	0.10
253	600369	西南证券	97,200	338,256.00	0.10
254	600426	华鲁恒升	27,900	336,753.00	0.10
255	002271	东方雨虹	26,000	336,700.00	0.10
256	600372	中航电子	25,800	334,884.00	0.10
257	600201	生物股份	20,140	334,324.00	0.10
258	000418	小天鹅 A	7,700	333,025.00	0.10
259	600008	首创股份	96,600	331,338.00	0.10
260	000402	金融街	51,300	330,372.00	0.10
261	600675	中华企业	59,000	329,220.00	0.10
262	002508	老板电器	16,300	329,097.00	0.10
263	600415	小商品城	94,100	328,409.00	0.10
264	600398	海澜之家	38,600	327,328.00	0.10
265	002797	第一创业	60,300	326,826.00	0.10
266	002127	南极电商	43,300	325,616.00	0.10

267	600161	天坛生物	15,280	324,700.00	0.10
268	603885	吉祥航空	25,800	323,274.00	0.10
269	002294	信立泰	15,400	321,706.00	0.10
270	000998	隆平高科	21,700	321,160.00	0.10
271	600376	首开股份	44,400	319,236.00	0.10
272	601866	中远海发	139,200	317,376.00	0.10
273	000750	国海证券	72,700	316,972.00	0.10
274	002439	启明星辰	15,400	316,624.00	0.10
275	000860	顺鑫农业	9,900	315,711.00	0.10
276	600160	巨化股份	47,500	314,925.00	0.10
277	002405	四维图新	22,300	314,653.00	0.10
278	600315	上海家化	11,500	313,950.00	0.10
279	002916	深南电路	3,900	312,663.00	0.10
280	603369	今世缘	21,500	311,535.00	0.10
281	601233	桐昆股份	31,900	311,344.00	0.10
282	002465	海格通信	39,824	310,627.20	0.10
283	600511	国药股份	13,300	309,225.00	0.09
284	601333	广深铁路	97,700	308,732.00	0.09
285	000932	华菱钢铁	50,900	308,454.00	0.09
286	601106	中国一重	115,300	307,851.00	0.09
287	600967	内蒙一机	29,478	306,571.20	0.09
288	600373	中文传媒	23,500	305,735.00	0.09
289	000732	泰禾集团	21,800	305,636.00	0.09
290	601179	中国西电	90,300	303,408.00	0.09
291	002049	紫光国微	10,400	300,560.00	0.09
292	000778	新兴铸管	69,500	299,545.00	0.09
293	002371	北方华创	7,900	298,304.00	0.09
294	000983	西山煤电	54,300	298,107.00	0.09
295	002038	双鹭药业	12,000	297,720.00	0.09
296	000027	深圳能源	56,600	297,150.00	0.09
297	601100	恒立液压	15,000	297,150.00	0.09
298	600909	华安证券	62,400	294,528.00	0.09
299	600549	厦门钨业	24,300	293,544.00	0.09
300	000623	吉林敖东	20,200	291,486.00	0.09
301	601099	太平洋	117,000	291,330.00	0.09
302	600885	宏发股份	12,900	291,024.00	0.09
303	002640	跨境通	26,900	290,520.00	0.09
304	002085	万丰奥威	37,300	289,075.00	0.09
305	002555	三七互娱	30,600	288,864.00	0.09

306	002500	山西证券	48,600	287,712.00	0.09
307	002195	二三四五	77,870	287,340.30	0.09
308	000401	冀东水泥	23,000	284,740.00	0.09
309	600339	中油工程	78,400	284,592.00	0.09
310	002174	游族网络	15,200	282,568.00	0.09
311	002180	纳思达	12,200	279,624.00	0.09
312	600782	新钢股份	54,900	279,441.00	0.09
313	600466	蓝光发展	51,600	277,608.00	0.08
314	002373	千方科技	24,800	275,776.00	0.08
315	000681	视觉中国	11,800	275,176.00	0.08
316	600801	华新水泥	16,400	274,208.00	0.08
317	000729	燕京啤酒	48,600	274,104.00	0.08
318	600739	辽宁成大	26,200	274,052.00	0.08
319	000960	锡业股份	28,700	273,798.00	0.08
320	000883	湖北能源	74,400	273,048.00	0.08
321	002340	格林美	71,000	272,640.00	0.08
322	002563	森马服饰	30,400	271,168.00	0.08
323	601958	金钼股份	45,800	271,136.00	0.08
324	600779	水井坊	8,500	269,195.00	0.08
325	600258	首旅酒店	16,800	268,128.00	0.08
326	600598	北大荒	31,300	267,928.00	0.08
327	002092	中泰化学	37,800	266,490.00	0.08
328	002572	索菲亚	15,900	266,325.00	0.08
329	600572	康恩贝	44,900	266,257.00	0.08
330	002773	康弘药业	7,800	265,746.00	0.08
331	600282	南钢股份	77,600	265,392.00	0.08
332	000028	国药一致	6,300	261,072.00	0.08
333	600392	盛和资源	30,260	260,538.60	0.08
334	600737	中粮糖业	35,300	259,808.00	0.08
335	000581	威孚高科	14,600	257,836.00	0.08
336	000997	新大陆	17,600	257,664.00	0.08
337	002268	卫士通	14,400	257,184.00	0.08
338	000686	东北证券	41,000	256,660.00	0.08
339	000826	启迪桑德	24,700	256,633.00	0.08
340	601718	际华集团	76,500	256,275.00	0.08
341	002078	太阳纸业	44,500	253,650.00	0.08
342	600879	航天电子	46,800	253,188.00	0.08
343	603077	和邦生物	155,900	252,558.00	0.08
344	600884	杉杉股份	19,500	251,940.00	0.08

345	002926	华西证券	30,100	251,937.00	0.08
346	002217	合力泰	53,800	251,784.00	0.08
347	002353	杰瑞股份	16,700	250,500.00	0.08
348	002583	海能达	31,400	247,746.00	0.08
349	600567	山鹰纸业	79,400	247,728.00	0.08
350	600718	东软集团	21,400	247,170.00	0.08
351	000830	鲁西化工	25,200	246,960.00	0.08
352	601880	大连港	133,100	246,235.00	0.08
353	600500	中化国际	35,900	245,556.00	0.08
354	600649	城投控股	44,400	242,868.00	0.07
355	000060	中金岭南	61,300	242,748.00	0.07
356	000559	万向钱潮	47,300	242,176.00	0.07
357	601168	西部矿业	41,500	241,530.00	0.07
358	601000	唐山港	101,300	241,094.00	0.07
359	600582	天地科技	70,100	239,742.00	0.07
360	002385	大北农	74,800	239,360.00	0.07
361	000066	中国长城	50,400	238,896.00	0.07
362	600643	爱建集团	28,100	238,569.00	0.07
363	600521	华海药业	21,500	237,790.00	0.07
364	600079	人福医药	23,400	237,276.00	0.07
365	600056	中国医药	18,800	236,316.00	0.07
366	002152	广电运通	42,100	236,181.00	0.07
367	600863	内蒙华电	102,100	235,851.00	0.07
368	000738	航发控制	19,500	235,170.00	0.07
369	601966	玲珑轮胎	17,200	234,780.00	0.07
370	600827	百联股份	27,700	234,065.00	0.07
371	002074	国轩高科	19,900	230,044.00	0.07
372	002221	东华能源	28,500	229,710.00	0.07
373	000039	中集集团	21,700	229,586.00	0.07
374	000937	冀中能源	60,800	229,216.00	0.07
375	601801	皖新传媒	34,300	229,124.00	0.07
376	600380	健康元	34,108	227,500.36	0.07
377	000839	中信国安	67,380	227,070.60	0.07
378	603883	老百姓	4,800	226,608.00	0.07
379	600584	长电科技	27,500	226,600.00	0.07
380	600873	梅花生物	53,600	226,192.00	0.07
381	600777	新潮能源	116,600	222,706.00	0.07
382	600648	外高桥	16,200	222,588.00	0.07
383	002019	亿帆医药	20,700	221,490.00	0.07

384	600062	华润双鹤	18,040	218,103.60	0.07
385	002424	贵州百灵	24,900	217,875.00	0.07
386	002603	以岭药业	20,700	216,522.00	0.07
387	000887	中鼎股份	21,200	214,544.00	0.07
388	600348	阳泉煤业	41,800	210,672.00	0.06
389	600026	中远海能	47,200	209,568.00	0.06
390	002701	奥瑞金	41,200	208,472.00	0.06
391	000598	兴蓉环境	51,600	207,948.00	0.06
392	002745	木林森	18,300	206,607.00	0.06
393	600717	天津港	29,200	206,444.00	0.06
394	600260	凯乐科技	12,100	205,337.00	0.06
395	600037	歌华有线	23,800	204,442.00	0.06
396	600835	上海机电	14,000	203,700.00	0.06
397	600409	三友化工	35,500	203,060.00	0.06
398	000513	丽珠集团	8,060	202,709.00	0.06
399	600754	锦江股份	9,300	198,090.00	0.06
400	600486	扬农化工	5,200	195,832.00	0.06
401	600291	西水股份	19,000	195,510.00	0.06
402	600787	中储股份	38,600	193,000.00	0.06
403	600060	海信电器	22,000	190,960.00	0.06
404	600460	士兰微	22,700	184,324.00	0.06
405	002183	怡亚通	36,700	183,867.00	0.06
406	002589	瑞康医药	26,300	183,311.00	0.06
407	600317	营口港	74,600	168,596.00	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.02
2	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.02

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	600519	贵州茅台	15,503,644.82	4.74
2	601318	中国平安	10,680,920.67	3.27
3	600036	招商银行	9,287,092.58	2.84
4	000333	美的集团	8,629,377.38	2.64
5	002415	海康威视	8,608,438.06	2.63
6	000858	五粮液	7,357,210.42	2.25
7	000002	万科A	6,593,600.40	2.02
8	002304	洋河股份	5,359,296.42	1.64
9	601166	兴业银行	4,954,750.99	1.52
10	601398	工商银行	4,754,773.00	1.45
11	600276	恒瑞医药	4,449,630.53	1.36
12	000001	平安银行	4,366,114.00	1.34
13	600000	浦发银行	4,280,353.11	1.31
14	600104	上汽集团	4,254,179.00	1.30
15	601288	农业银行	4,123,452.00	1.26
16	600900	长江电力	4,053,556.00	1.24
17	601668	中国建筑	3,801,795.00	1.16
18	000651	格力电器	3,631,223.42	1.11
19	601328	交通银行	3,573,608.00	1.09
20	001979	招商蛇口	3,513,933.60	1.08

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	002415	海康威视	2,568,262.00	0.79
2	000333	美的集团	2,445,522.00	0.75
3	000002	万科A	2,109,294.00	0.65
4	000858	五粮液	2,006,986.85	0.61
5	600519	贵州茅台	1,696,067.00	0.52
6	002304	洋河股份	1,615,899.25	0.49
7	000001	平安银行	1,465,679.00	0.45
8	000651	格力电器	1,145,495.00	0.35
9	001979	招商蛇口	1,063,034.00	0.33
10	002024	苏宁易购	1,050,349.00	0.32

11	002027	分众传媒	987,128.00	0.30
12	000725	京东方 A	965,491.00	0.30
13	601318	中国平安	917,372.40	0.28
14	002594	比亚迪	845,314.24	0.26
15	000166	申万宏源	731,942.00	0.22
16	002142	宁波银行	729,749.83	0.22
17	000776	广发证券	707,849.00	0.22
18	600036	招商银行	701,494.00	0.21
19	002475	立讯精密	689,141.00	0.21
20	000596	古井贡酒	633,136.00	0.19

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	414,662,054.51
卖出股票收入（成交）总额	77,845,766.58

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

本基金本报告期末无债券投资情况。

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

本基金本报告期末无债券投资情况。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细

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

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

本基金本报告期末未持有权证。

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

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

本组合投资的前十名证券之一浦发银行，于 2018 年 1 月 18 日，银监会四川监管局对成都分行作出行政处罚决定，对成都分行内控管理严重失效，授信管理违规，违规办理信贷业务等严重违反审慎经营规则的违规行为依法查处，执行罚款 46,175 万元人民币。此外，对成都分行原行长、2 名副行长、1 名部门负责人和 1 名支行行长分别给予禁止终身从事银行业工作、取消其高级管理

人员任职资格、警告及罚款。于 2018 年 2 月 12 日被中国银保监会处罚，主要违法违规事实包括：

- （一）内控管理严重违反审慎经营规则；
- （二）通过资管计划投资分行协议存款，虚增一般存款；
- （三）通过基础资产在理财产品之间的非公允交易进行收益调节；
- （四）理财资金投资非标准化债权资产比例超监管要求；
- （五）提供不实说明材料、不配合调查取证；
- （六）以贷转存，虚增存贷款；
- （七）票据承兑、贴现业务贸易背景审查不严；
- （八）国内信用证业务贸易背景审查不严；
- （九）贷款管理严重缺失，导致大额不良贷款；
- （十）违规通过同业投资转存款方式，虚增存款；
- （十一）票据资管业务在总行审批驳回后仍继续办理；
- （十二）对代理收付资金的信托计划提供保本承诺；
- （十三）以存放同业业务名义开办委托定向投资业务，并少计风险资产；
- （十四）投资多款同业理财产品未尽审查，涉及金额较大；
- （十五）修改总行理财合同标准文本，导致理财资金实际投向与合同约定不符；
- （十六）为非保本理财产品出具保本承诺函；
- （十七）向关系人发放信用贷款；
- （十八）向客户收取服务费，但未提供实质性服务，明显质价不符；
- （十九）收费超过服务价格目录，向客户转嫁成本。

中国银保监会决定罚款浦发银行 5845 万元，没收违法所得 10.927 万元，罚没合计 5855.927 万元。于 2018 年 7 月 26 日因未按照规定履行客户身份识别义务、未按照规定保存客户身份资料和交易记录、未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告、与身份不明的客户进行交易，受到中国人民银行处罚（银反洗罚决字〔2018〕3 号）。

本组合投资的前十名证券之一招商银行，于 2018 年 2 月 12 日被中国银监会处罚，主要违法违规事实包括：

- （一）内控管理严重违反审慎经营规则；
- （二）违规批量转让以个人为借款主体的不良贷款；
- （三）同业投资业务违规接受第三方金融机构信用担保；
- （四）销售同业非保本理财产品时违规承诺保本；
- （五）违规将票据贴现资金直接转回出票人账户；
- （六）为同业投资业务违规提供第三方金融机构信用担保；
- （七）未将房地产企业贷款计入房地产开发贷款科目；
- （八）高管人员在获得任职资格核准前履职；
- （九）未严格审查贸易背景真实性办理银行承兑业务；
- （十）未严格审查贸易背景真实性开立信用证；
- （十一）违规签订保本合同销售同业非保本理财产品；
- （十二）非真实转让信贷资产；
- （十三）违规向典当行发放贷款；
- （十四）违规向关系人发放信用贷款。

中国银监会决定罚款招商银行 6570 万元，没收违法所得 3.024 万元，罚没合计 6573.024 万元。

本组合投资的前十名证券之一兴业银行，于 2018 年 4 月 19 日被银保监处罚，主要违法违规事实包括：

- （一）重大关联交易未按规定审查审批且未向监管部门报告；
- （二）非真实转让信贷资产；
- （三）无授信额度或超授信额度办理同业业务；
- （四）内控管理严重违反审慎经营规则，多家分支机构买入返售业务项下基础资产不合规；
- （五）同业投资接受隐性的第三方金融机构信用担保；
- （六）债券卖出回购业务违规出表；
- （七）个人理财资金违规投资；
- （八）提供日期倒签的材料；
- （九）部分非现场监管统计数据与事实不符；
- （十）个别董事未经任职资格核准即履职；
- （十一）

变相批量转让个人贷款；（十二）向四证不全的房地产项目提供融资。中国银行保险监督管理委员会决定罚款兴业银行 5870 万元。

对上述股票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分股的权重进行配置，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的、或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的证券。

8.12.2

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

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	103,049.74
2	应收证券清算款	74,068.99
3	应收股利	-
4	应收利息	440.73
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	68,035.50
9	合计	245,594.96

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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

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。

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	601860	紫金银行	50,145.80	0.02	新股未上市

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 本基金的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
2,469	156,475.38	8,683,105.00	2.25%	171,494,301.00	44.39%

9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金	206,160,298.00	53.36%

9.3 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	广发证券股份有限公司	5,965,647.00	1.54%
2	王飞	3,011,000.00	0.78%
3	李冰	2,056,900.00	0.53%
4	何建华	2,020,000.00	0.52%
5	袁占欣	2,000,000.00	0.52%
6	丛阳	2,000,000.00	0.52%
7	吴航	2,000,000.00	0.52%
8	高淑兰	2,000,000.00	0.52%
9	石进河	1,881,600.00	0.49%
10	和卫东	1,744,300.00	0.45%
11	中国工商银行股份有限公司-平安大 华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式 指数证券投资	206,160,298.00	53.36%

9.4 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	228,500.00	0.0591%

9.5 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的情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 6 月 15 日）基金份额总额	323,337,704.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	225,000,000.00
减:基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	162,000,000.00
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	386,337,704.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金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

本报告期内，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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金合同生效，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 60,000.00 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、本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金	

			成交总额的比例		总量的比例	
广发证券	1	260,521,964.63	52.90%	185,317.27	52.90%	-
中泰证券	2	121,200,085.65	24.61%	86,211.16	24.61%	-
平安证券	2	110,785,770.81	22.49%	78,802.30	22.49%	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-

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、本基金本报告期合同生效，上述租用席位均为本期新增所用。其中招商证券的一个席位作为申赎本基金的专用席位。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	2,002.40	100.00%	15,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-

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	关于平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 6 月 16 日
2	关于平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 7 月 17 日
3	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 7 月 17 日
4	关于新增平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金申赎代办券商的公告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 7 月 23 日
5	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 3 季度报告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 10 月 26 日
6	关于平安大华基金管理有限公司注册资本、股权及法定名称变更事宜的公告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 11 月 2 日
7	关于平安基金管理有限公司旗下基金更名事宜的公告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 11 月 28 日
8	关于子公司深圳平安汇通财富管理有限公司增加注册资本的公告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 11 月 29 日
9	关于平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代办券商的公告	公司网站、中国证券报、证券日报	2018 年 11 月 30 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	2018/07/27--2018/12/31	-	387,068,298.00	180,908,000.00	206,160,298.00	53.36%

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 5000 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。

“申购份额”包含买入份额，“赎回份额”包含卖出份额。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、自 2018 年 10 月 25 日起，本基金管理人法定名称由“平安大华基金管理有限公司”变更为“平安基金管理有限公司”。为保护投资者利益，避免对投资者造成混淆和误导，本基金名称由“平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金”变更为“平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金”。

2、经本基金管理人 2017 年第六次临时股东会审议通过，并经中国证券监督管理委员会《关于核准平安大华基金管理有限公司变更股权的批复》（证监许可【2018】1595 号），公司新增注册资本 10 亿元人民币。本次增资完成后，本公司注册资本由 3 亿元人民币增加至 13 亿元人民币。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同；
- 3、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金托管协议；
- 4、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书；
- 5、中国证监会批准设立平安基金管理有限公司的文件；
- 6、报告期内在选定报刊上披露的各项公告。

13.2 存放地点

- 1、深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层
- 2、基金托管人住所

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8：30-11：30，13：00-17：00。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件；

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.fund.pingan.com>

平安基金管理有限公司

2019 年 3 月 27 日