

平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数  
证券投资基金  
2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 23 日

## § 1 重要提示

### 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。本半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 8 月 22 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

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 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

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	215,337,704.00 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	funds@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798

**2.4 信息披露方式**

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

### § 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	10,358,438.89
本期利润	76,232,445.93
加权平均基金份额本期利润	0.2868
本期基金份额净值增长率	25.80%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0282
期末基金资产净值	229,194,430.54
期末基金份额净值	1.0643

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；

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

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

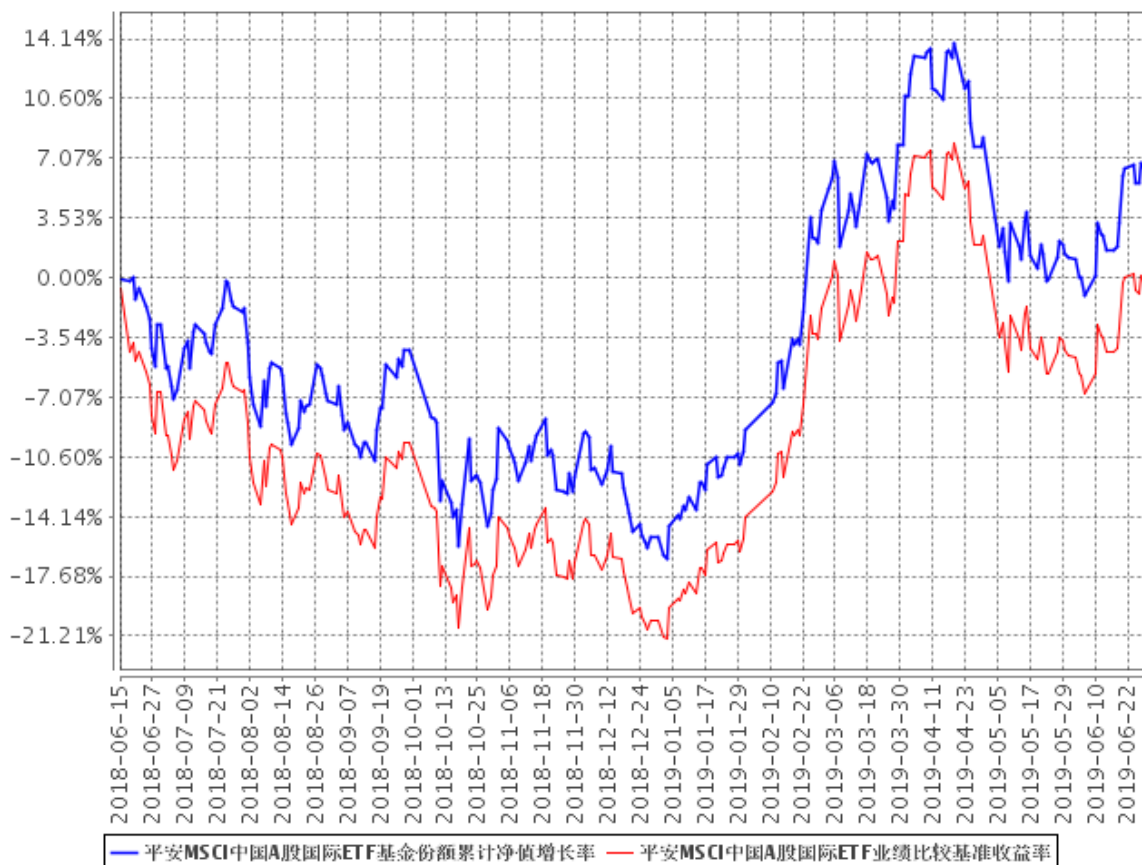
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.19%	1.15%	4.54%	1.16%	0.65%	-0.01%
过去三个月	-1.37%	1.50%	-2.36%	1.51%	0.99%	-0.01%
过去六个月	25.80%	1.51%	25.08%	1.52%	0.72%	-0.01%
过去一年	9.47%	1.50%	7.03%	1.52%	2.44%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.43%	1.49%	-0.26%	1.53%	6.69%	-0.04%

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，截至报告期末已满一年；
- 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。

## § 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，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股份 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股份 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股份 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 2019 年 6 月 30 日，平安基金共管理 83 只公募基金，公募基金管理总规模 2877 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 ETF 指数中心指数投资总监。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
钱晶	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	2019 年 2 月 28 日	-	8	钱晶先生，美国纽约大学理工学院硕士。曾先后担任国信证券股份有限公司量化分析师、华安基金管理有限公司基金经理。2017 年 10 月加入平安基金管理有限公司，任资产配置事业部 ETF 指数部投资经理。现任平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、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 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 股国际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 10 月 16 日	-	6	刘洁倩，女，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，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、平安创业板交易型



					开放式指数证券投资基金的基金经理助理。
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	2019 年 4 月 11 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》、《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。

公司每季度对旗下各组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析，对本报告期内，两两组合间单日、3日、5日时间窗口内同向交易买入溢价率均值、卖出溢价率、交易占优比等因素进行了综合分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

### 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 MSCI 中国 A 股国际指数的被动型产品，基金在投资管理上，继续采取完全复制的管理办法跟踪指数，利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

报告期内，本基金的日均偏离度为 0.005%，年化跟踪误差 0.46%，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 1.0643 元，份额累计净值为 1.0643 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.80%，业绩比较基准收益率为 25.08%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

年初以来，在较为宽松的资金面和中美经贸关系缓和的背景下，市场风险偏好持续改善，叠加外资入场，推动市场估值水平持续修复，并走出了一轮强势的上涨行情。但是，4月中旬以来，中美经贸关系骤然紧张，导致市场风险偏好迅速下降，股票市场整体表现也相应调整。展望下半

年，国内经济增长动能趋弱，企业盈利情况大幅改善的概率不大，但长期来看，消费与产业升级的趋势依然具有较高的确定性。

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。

#### 4.7 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

本基金本报告期末出现连续 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 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。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未进行利润分配。

### 5.3 托管人对本半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 2019 年半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 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 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,568,423.43	1,719,634.41
结算备付金		254,457.59	121,725.98
存出保证金		25,414.20	103,049.74
交易性金融资产	6.4.7.2	224,487,960.60	325,323,162.46
其中：股票投资		224,487,960.60	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	74,068.99
应收利息	6.4.7.5	885.66	440.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	193,684.37	68,035.50
资产总计		229,530,825.85	327,410,117.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2018 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
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		91,868.38	144,990.35
应付托管费		18,373.66	28,998.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	50,745.42	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	6.4.7.8	175,407.85	348,761.81
负债合计		336,395.31	573,966.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	215,337,704.00	386,337,704.00
未分配利润	6.4.7.10	13,856,726.54	-59,501,552.41
所有者权益合计		229,194,430.54	326,836,151.59
负债和所有者权益总计		229,530,825.85	327,410,117.81

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0643 元，累计份额净值 1.0643 元，基金份额总额 215,337,704.00 份。

## 6.2 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 6 月 15 日(基金 合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		77,553,605.23	-8,668,375.94
1.利息收入		11,181.88	129,649.70
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,122.15	117,001.00
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		59.73	12,648.70
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,613,112.37	759,278.33
其中：股票投资收益	6.4.7.12	9,461,432.94	-9,971.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,151,679.43	769,249.36
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	65,874,007.04	-9,557,303.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	55,303.94	-
<b>减：二、费用</b>		1,321,159.30	335,396.20
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	657,276.12	65,556.26
2. 托管费	6.4.10.2.2	131,455.18	13,111.27
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	210,710.15	237,773.03
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	6.4.7.20	321,717.85	18,955.64
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		76,232,445.93	-9,003,772.14
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		76,232,445.93	-9,003,772.14

### 6.3 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	386,337,704.00	-59,501,552.41	326,836,151.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	76,232,445.93	76,232,445.93
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）	-171,000,000.00	-2,874,166.98	-173,874,166.98
其中：1. 基金申购款	27,000,000.00	517,541.75	27,517,541.75
2. 基金赎回款	-198,000,000.00	-3,391,708.73	-201,391,708.73
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）	215,337,704.00	13,856,726.54	229,194,430.54
项目	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年6月30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）	-	-9,003,772.14	-9,003,772.14
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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
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）	323,337,704.00	-9,003,772.14	314,333,931.86

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：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 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。

## 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 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于 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期间所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

## 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 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[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。

## 6.4.7 关联方关系

### 6.4.7.1 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。

### 6.4.7.2 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	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	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
平安银行股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安证券股份有限公司	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 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至 2018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
平安证券股份有限公司	67,708,976.45	47.51%	-	-

#### 6.4.8.1.2 债券交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.8.1.3 债券回购交易

本基金于本期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

#### 6.4.8.1.4 权证交易

本基金于本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。

#### 6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019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
平安证券股份有限公司	48,191.96	47.51%	11,096.49	21.87%

关联方名称	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018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
平安证券股份有限公	-	-	-	-

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。

### 6.4.8.2 关联方报酬

#### 6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付 的管理费	657,276.12	65,556.26
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。

#### 6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6 月30日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日) 至2018年6月30日
当期发生的基金应支付 的托管费	131,455.18	13,111.27

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。

#### 6.4.8.2.3 销售服务费

无

**6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金于本期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况****6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无

**6.4.8.4.2 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 2019年6月30日		上年度末 2018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 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	169,975,154.00	78.9342%	206,160,298.00	53.3627%

**6.4.8.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至 2018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-活期存款	4,568,423.43	10,283.40	3,558,081.76	49,186.13

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。

**6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金于本期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.8.7 其他关联交易事项的说明**

(1)于2019年6月30日，本基金持有475,300股工商银行的A股普通股，成本总额为人民币2,663,761.90元，估值总额为人民币2,799,517.00元，占基金资产净值的比例为1.22%。

(2) 于 2019 年 6 月 30 日, 本基金持有 95,500 股中国平安的 A 股普通股, 成本总额为人民币 6,106,529.30 元, 估值总额为人民币 8,462,255.00 元, 占基金资产净值的比例为 3.69%。

## 6.4.9 期末 (2019 年 6 月 30 日) 本基金持有的流通受限证券

### 6.4.9.1 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

6.4.9.1.1 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
601236	红塔证券	2019年6月26日	2019年7月5日	新股未上市	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-
300788	中信出版	2019年6月27日	2019年7月5日	新股未上市	14.85	14.85	1,556	23,106.60	23,106.60	-

### 6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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。

#### 6.4.9.3.2 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。

## 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

### 6.4.10.1 承诺事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的承诺事项。

### 6.4.10.2 其他事项

截至资产负债表日, 本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	224,487,960.60	97.80
	其中：股票	224,487,960.60	97.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	4,822,881.02	2.10
8	其他各项资产	219,984.23	0.10
9	合计	229,530,825.85	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 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（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,966,927.40	1.29
B	采矿业	8,077,264.00	3.52
C	制造业	97,293,074.34	42.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,290,857.00	2.74
E	建筑业	5,711,289.00	2.49
F	批发和零售业	4,849,163.00	2.12
G	交通运输、仓储和邮政业	7,075,903.00	3.09
H	住宿和餐饮业	270,436.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,951,701.59	4.78
J	金融业	62,528,351.40	27.28
K	房地产业	11,172,594.20	4.87
L	租赁和商务服务业	2,870,726.25	1.25



M	科学研究和技术服务业	199,640.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	365,116.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,528,684.40	0.67
R	文化、体育和娱乐业	1,409,679.00	0.62
S	综合	332,617.00	0.15
	合计	223,894,023.58	97.69

### 7.2.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采掘业	134,889.35	0.06
C	制造业	362,467.37	0.16
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	39,603.76	0.02
J	金融业	33,869.94	0.01
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	23,106.60	0.01
S	综合	-	-
	合计	593,937.02	0.26

### 7.2.3 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。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 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前十名股票投资明细

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	11,000	10,824,000.00	4.72
2	601318	中国平安	95,500	8,462,255.00	3.69
3	600036	招商银行	181,900	6,544,762.00	2.86
4	000858	五粮液	34,200	4,033,890.00	1.76
5	601166	兴业银行	183,200	3,350,728.00	1.46
6	600000	浦发银行	258,800	3,022,784.00	1.32
7	601398	工商银行	475,300	2,799,517.00	1.22
8	600276	恒瑞医药	38,956	2,571,096.00	1.12
9	000002	万科A	85,800	2,386,098.00	1.04
10	601288	农业银行	657,100	2,365,560.00	1.03

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于管理人网站的半年度报告正文。

#### 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前五名股票投资明细

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	600968	海油发展	37,997	134,889.35	0.06
2	300782	卓胜微	743	80,927.56	0.04
3	300775	三角防务	2,164	63,621.60	0.03
4	603915	国茂股份	2,523	58,710.21	0.03
5	601698	中国卫通	10,103	39,603.76	0.02
6	603217	元利科技	584	39,268.16	0.02
7	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.01
8	603863	松炆资源	1,451	33,489.08	0.01
9	300594	朗进科技	721	31,803.31	0.01
10	300780	德恩精工	935	27,676.00	0.01

## 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	300498	温氏股份	1,824,866.96	0.56
2	600519	贵州茅台	1,752,453.00	0.54
3	300015	爱尔眼科	791,071.00	0.24
4	300059	东方财富	766,719.40	0.23
5	601600	中国铝业	668,033.00	0.20
6	600061	国投资本	630,739.00	0.19
7	300760	迈瑞医疗	550,936.00	0.17
8	300122	智飞生物	496,121.82	0.15
9	000858	五粮液	479,351.00	0.15
10	002415	海康威视	472,838.00	0.14
11	300750	宁德时代	462,054.00	0.14
12	300033	同花顺	450,245.00	0.14
13	002916	深南电路	439,577.00	0.13
14	603833	欧派家居	414,115.00	0.13
15	002157	正邦科技	412,865.00	0.13
16	000002	万科A	393,953.00	0.12
17	300003	乐普医疗	389,213.00	0.12
18	601318	中国平安	382,594.00	0.12
19	000596	古井贡酒	371,692.00	0.11
20	300124	汇川技术	346,153.00	0.11

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。

### 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	000333	美的集团	4,237,400.00	1.30
2	002415	海康威视	3,108,360.91	0.95
3	000858	五粮液	3,025,901.63	0.93

4	000002	万 科 A	2,771,531.72	0.85
5	000001	平安银行	2,125,632.17	0.65
6	002304	洋河股份	1,701,891.00	0.52
7	600519	贵州茅台	1,438,140.00	0.44
8	000651	格力电器	1,423,999.00	0.44
9	001979	招商蛇口	1,414,738.92	0.43
10	000725	京东方 A	1,320,792.00	0.40
11	002024	苏宁易购	1,154,984.00	0.35
12	002714	牧原股份	1,043,855.25	0.32
13	002142	宁波银行	1,029,017.00	0.31
14	000063	中兴通讯	1,022,568.95	0.31
15	000166	申万宏源	1,012,843.52	0.31
16	601318	中国平安	997,589.00	0.31
17	002594	比亚迪	964,339.00	0.30
18	000776	广发证券	945,437.00	0.29
19	002475	立讯精密	912,156.00	0.28
20	600036	招商银行	894,235.00	0.27

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。

#### 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	46,370,044.52
卖出股票收入（成交）总额	96,934,957.36

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。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 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。

## 7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无股指期货投资情况。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

## 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

本基金本报告期末无国债期货投资情况。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 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。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1

本组合投资的前十名证券之一浦发银行，于 2018 年 7 月 26 日，中国人民银行针对上海浦东发展银行股份有限公司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的违法违规事实，罚款人民币 170 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。

## 7.12.2

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股票库之外的股票。

## 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	25,414.20
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	885.66
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	193,684.37
8	其他	-
9	合计	219,984.23

## 7.12.4 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。

## 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

本基金本报告期末前十名股票中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**

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况

#### **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

#### 8.1.1 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
927	232, 295. 26	7, 079, 759. 00	3. 29%	38, 282, 791. 00	17. 78%

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
平安 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	169, 975, 154. 00	78. 93%

### 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	中国国际金融股份有限公司	3, 460, 500. 00	1. 61%
2	广发证券股份有限公司	2, 925, 013. 00	1. 36%
3	张玉琴	1, 365, 724. 00	0. 63%
4	吴愚	1, 090, 000. 00	0. 51%
5	李莉	1, 000, 000. 00	0. 46%
6	徐思申	1, 000, 000. 00	0. 46%
7	王钦军	1, 000, 000. 00	0. 46%
8	韩立宾	898, 800. 00	0. 42%
9	肖志辉	796, 500. 00	0. 37%
10	王剑博	700, 000. 00	0. 33%
11	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	169, 975, 154. 00	78. 93%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

## § 9 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
本报告期期初基金份额总额	386,337,704.00
本报告期期间基金总申购份额	27,000,000.00
减：本报告期期间基金总赎回份额	198,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	215,337,704.00

## § 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

1、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

2、经平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）2019 年第三次股东会议审议通过，由薛世峰先生接替李兆良先生任职公司的独立董事，任职日期为 2019 年 6 月 7 日。

### 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，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 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

本报告期内，公司收到监管机构对我司采取责令改正措施的决定、对相关责任人出具警示函的决定。公司高度重视，制定并实施相关整改措施，及时向监管机构提交整改报告。报告期内，公司已完成整改。

除上述情况外，本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 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	股票交易		应支付该券商的佣金	
		成交金额	占当期股票	佣金	占当期佣金

	数量		成交总额的比 例		总量的比例	备注
平安证券	2	67,708,976.45	47.51%	48,161.96	47.51%	-
东方证券	2	43,134,938.95	30.27%	30,681.46	30.27%	-
广发证券	1	18,615,179.95	13.06%	13,241.31	13.06%	-
中泰证券	2	11,992,107.19	8.42%	8,529.96	8.42%	-
招商证券	3	1,051,482.00	0.74%	747.95	0.74%	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	新增 2 个

1、基金交易单元的选择标准如下：

- (1) 研究实力
- (2) 业务服务水平
- (3) 综合类研究服务对投资业绩贡献度
- (4) 专题类服务

2、本基金管理人负责根据上述选择标准，考察后与确定选用交易单元的券商签订交易单元租用协议，其中招商证券的一个席位作为申赎本基金的专用席位。

### 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
平安证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	1,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

## § 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
联接基金	1	2019/01/01--2019/06/30	206,160,298.00	61,177,856.00	97,363,000.00	169,975,154.00	78.93%

#### 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。

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日