

# 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 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 联接	
场内简称	-	
基金主代码	005868	
前端交易代码	-	
后端交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 6 月 21 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	174,508,765.89 份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	-	
上市日期	-	
下属分级基金的基金简称:	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 A	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 C
下属分级基金场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	005868	005869
下属分级基金的前端交易代码	-	-
下属分级基金的后端交易代码	-	-
报告期末下属分级基金的份额总额	110,863,188.94 份	63,645,576.95 份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

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
基金主代码	512360
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
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 7 月 20 日
基金管理人名称	平安基金管理有限公司
基金托管人名称	中国工商银行股份有限公司

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求与业绩比较基准相似的回报。	
投资策略	本基金以目标 ETF 作为其主要投资标的，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金并不参与目标 ETF 的管理。主要以一级市场申购的方式投资于目标 ETF，获取基金份额净值上涨带来的收益；在目标 ETF 基金份额二级市场交易流动性较好的情况下，也可以通过二级市场买卖目标 ETF 的基金份额。在正常市场情况下，本基金力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。	
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率（税后）×5%	
风险收益特征	本基金的目标 ETF 为股票型基金，其长期平均风险和预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 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证券市场相似的风险收益特征。	
	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 A	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 C
下属分级基金的风险收益特征	-	-

### 2.2.1 目标基金产品说明

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

## 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

基金级别	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 A	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 C
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)	报告期(2019 年 1 月 1 日 - 2019 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,188,556.28	1,292,071.99
本期利润	24,721,745.17	17,684,691.24
加权平均基金份额本期利润	0.2254	0.2481
本期基金份额净值增长率	24.42%	24.27%
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	0.0145	0.0127
期末基金资产净值	122,299,930.78	70,086,992.03
期末基金份额净值	1.1032	1.1012

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

#### 3.3 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

平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 A

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	4.84%	1.08%	4.32%	1.10%	0.52%	-0.02%

过去三个月	-1.26%	1.41%	-2.21%	1.43%	0.95%	-0.02%
过去六个月	24.42%	1.43%	23.78%	1.45%	0.64%	-0.02%
过去一年	10.28%	1.34%	6.83%	1.44%	3.45%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	10.32%	1.32%	3.67%	1.44%	6.65%	-0.12%

平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 C

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	4.82%	1.08%	4.32%	1.10%	0.50%	-0.02%
过去三个月	-1.32%	1.41%	-2.21%	1.43%	0.89%	-0.02%
过去六个月	24.27%	1.43%	23.78%	1.45%	0.49%	-0.02%
过去一年	10.08%	1.34%	6.83%	1.44%	3.25%	-0.10%
自基金合同 生效起至今	10.12%	1.32%	3.67%	1.44%	6.45%	-0.12%

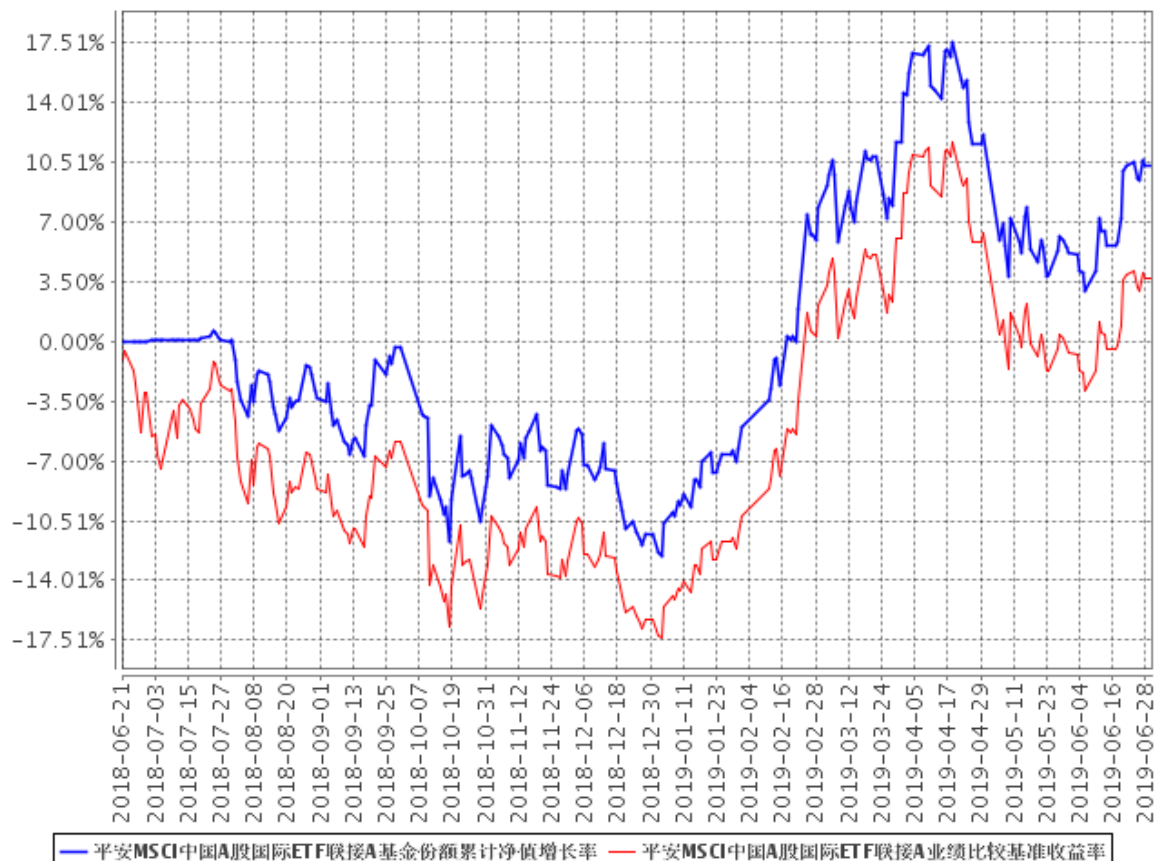
注：1、MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)收益率\*95%+银行人民币活期存款利率(税后)\*5%。本基金投资于目标 ETF 的比例不低于基金资产净值的 90%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%。业绩比较基准与投资比例相符。

2、本基金对业绩比较基准采用每日再平衡的计算方法。

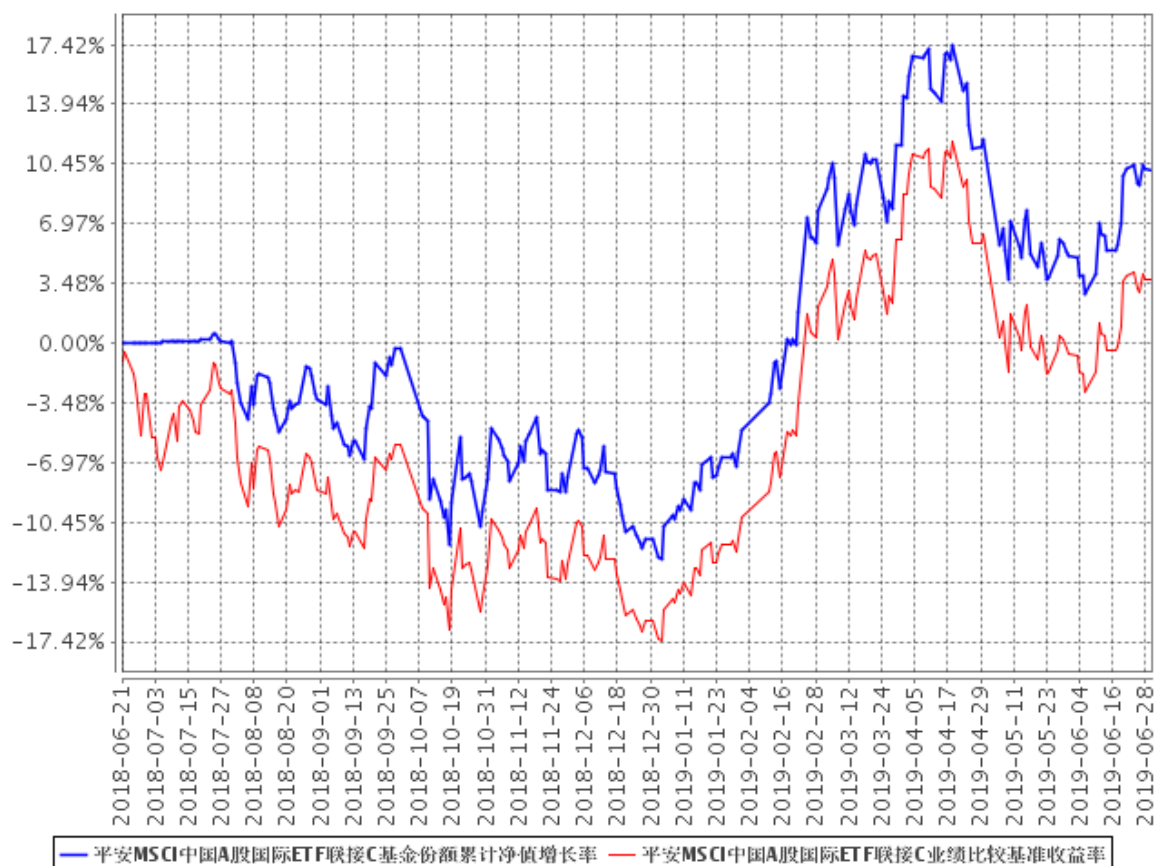


### 3.3.1 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

平安MSCI中国A股国际ETF联接A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



平安MSCI中国A股国际ETF联接C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 21 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联接基金经理；资产配置事业部	2018 年 6 月 21 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

	ETF 指数中心 指数投资总监；			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联接基金的基金经理	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联接基金的基金经理（助理）	2018 年 10 月 16 日	-	6	刘洁倩，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联接基金的基金经理（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，任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究员。曾担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 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的基金经理助理。

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联接基金基金合同》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

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 来实现对业绩比较基准的紧密跟踪，也可以通过买入标的指数成份股来跟踪标的指数。基金在投资管理上，我们利用量化科技系统进行精细化组合管理，高度重视绩效归因在组合管理中的反馈作用，勤勉尽责，严格控制跟踪偏离度和跟踪误差。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2019 年 6 月 30 日，本基金 A 份额净值为 1.1032 元，份额累计净值为 1.1032 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 24.42%，同期业绩基准增长率为 23.78%。本基金 C 份额净值为 1.1012 元，份额累计净值为 1.1012 元。报告期内，本基金份额净值增长率为 24.27%，同期业绩基准增长率为 23.78%。

#### 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，我们将继续通过投资于目标 ETF，实现紧密跟踪标的指数的投资目标，追求与业绩比较基准相似的回报。

#### 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 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联接基金的托管过程中,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证券投资基金联接基金的管理人——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证券投资基金联接基金的投资运作、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证券投资基金联接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证券投资基金联接基金 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联接基金

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	10,467,728.06	9,880,079.63
结算备付金		50,461.76	37,086.69
存出保证金		20,981.23	42,615.09
交易性金融资产	6.4.7.2	181,830,858.50	174,411,612.11
其中：股票投资		900,532.00	-
基金投资		180,904,556.40	174,411,612.11
债券投资		25,770.10	-
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		-	4,640,661.11
应收利息	6.4.7.5	1,988.72	2,037.04
应收股利		-	-
应收申购款		423,861.79	23,978.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		192,795,880.06	189,038,069.75
<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		-	-
应付赎回款		301,954.09	5,292,913.32
应付管理人报酬		4,635.06	4,245.40
应付托管费		927.01	849.08
应付销售服务费		5,720.84	7,070.15
应付交易费用	6.4.7.7	10,822.90	-
应交税费		0.34	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	84,897.01	161,910.12
负债合计		408,957.25	5,466,988.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	174,508,765.89	207,089,577.34
未分配利润	6.4.7.10	17,878,156.92	-23,518,495.66
所有者权益合计		192,386,922.81	183,571,081.68
负债和所有者权益总计		192,795,880.06	189,038,069.75

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额总额 174,508,765.89 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1032 元，A 类基金份额 110,863,188.94 份；下属 C 类基金份额净值 1.1012 元，C 类基金份额 63,645,576.95 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联接基金

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 21 日(基 金合同生效日)至 2018 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		42,611,542.43	139,135.95
1.利息收入		43,068.75	139,135.95
其中：存款利息收入	6.4.7.11	43,049.63	32,757.33
债券利息收入		19.12	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	106,378.62
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,554,752.60	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	142,836.34	-
基金投资收益	6.4.7.13	3,408,049.10	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	3,867.16	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	38,925,808.14	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	87,912.94	-
<b>减：二、费用</b>		205,106.02	43,829.50
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	26,466.83	27,593.05
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,293.36	5,518.61
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	36,695.72	2,470.44
4. 交易费用	6.4.7.20	46,747.94	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,360.26	-
7. 其他费用	6.4.7.21	87,541.91	8,247.40
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		42,406,436.41	95,306.45
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		42,406,436.41	95,306.45

### 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联接基金

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）	207,089,577.34	-23,518,495.66	183,571,081.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	42,406,436.41	42,406,436.41
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）	-32,580,811.45	-1,009,783.83	-33,590,595.28
其中：1. 基金申购款	126,824,020.68	12,802,796.89	139,626,817.57
2. 基金赎回款	-159,404,832.13	-13,812,580.72	-173,217,412.85
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）	174,508,765.89	17,878,156.92	192,386,922.81
项目	上年度可比期间 2018年6月21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）	223,778,913.88	95,306.45	223,874,220.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
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）	223,778,913.88	95,306.45	223,874,220.33

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 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(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联接基金,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]517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联接基金注册的批复》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联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 223,740,013.01 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0362 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联接基金基金合同》于 2018 年 6 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 223,778,913.88 份基金份额,其中认购资金利息折合 38,900.87 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”)。

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联接基金于 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联接基金。

本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用并在赎回时根据持有期限收取赎回费用、不从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用但在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金为平安 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“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对 MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A



International Index) 紧密跟踪的被动指数基金, 本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪, 力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.35%, 年跟踪误差不超过 4%。

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联接基金合同》的有关规定, 本基金的投资范围为目标 ETF 基金份额、MSCI 中国 A 股国际指数成份股和备选成份股, 本基金可少量投资于非成份股 (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 (包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款 (包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及经中国证监会允许基金投资的其他金融工具, 但需符合中国证监会的相关规定。本基金可以再履行适当程序后, 参与融资和转融通证券出借业务。本基金业绩比较基准为 MSCI 中国 A 股国际指数收益率  $\times 95\%$  + 银行人民币活期存款利率 (税后)  $\times 5\%$ 。

#### 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联接基金基金合同》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 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
	2019 年 6 月 30 日
活期存款	10,467,728.06
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	10,467,728.06

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	896,456.00	900,532.00	4,076.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	25,998.88	25,770.10	-228.78
	银行间市场	-	-	-
	合计	25,998.88	25,770.10	-228.78
资产支持证券		-	-	-
基金		164,896,472.78	180,904,556.40	16,008,083.62
其他		-	-	-
合计		165,818,927.66	181,830,858.50	16,011,930.84

注：基金投资均为本基金持有的目标 ETF 的份额，按估值日目标 ETF 的份额净值确定公允价值。

本基金可采用股票组合申赎的方式或证券二级市场交易的方式进行目标 ETF 份额的买卖。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	1,938.89
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	20.43
应收债券利息	20.94
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	8.46
合计	1,988.72

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	10,822.90
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,822.90

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	65.22
预提费用	84,831.79
合计	84,897.01

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 A	
项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日

	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,794,675.92	115,794,675.92
本期申购	77,479,427.78	77,479,427.78
本期赎回(以“-”号填列)	-82,410,914.76	-82,410,914.76
- 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	110,863,188.94	110,863,188.94

金额单位：人民币元

平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 C		
项目	本期	
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	91,294,901.42	91,294,901.42
本期申购	49,344,592.90	49,344,592.90
本期赎回(以“-”号填列)	-76,993,917.37	-76,993,917.37
- 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	63,645,576.95	63,645,576.95

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	-789,453.48	-12,327,938.46	-13,117,391.94
本期利润	2,188,556.28	22,533,188.89	24,721,745.17
本期基金份额交易产生的变动数	213,434.45	-381,045.84	-167,611.39
其中：基金申购款	520,306.67	7,855,043.29	8,375,349.96
基金赎回款	-306,872.22	-8,236,089.13	-8,542,961.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,612,537.25	9,824,204.59	11,436,741.84

单位：人民币元

平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-685,495.03	-9,715,608.69	-10,401,103.72
本期利润	1,292,071.99	16,392,619.25	17,684,691.24
本期基金份额交易产生的变动数	203,568.49	-1,045,740.93	-842,172.44
其中：基金申购款	221,642.78	4,205,804.15	4,427,446.93
基金赎回款	-18,074.29	-5,251,545.08	-5,269,619.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	810,145.45	5,631,269.63	6,441,415.08

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	42,503.71
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	326.55

其他	219.37
合计	43,049.63

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	66,795.13
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	76,041.21
合计	142,836.34

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,590,524.03
减：卖出股票成本总额	19,523,728.90
买卖股票差价收入	66,795.13

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

本报告期内无股票投资产生的赎回差价收入。

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
申购基金份额总额	12,603,900.00



减：现金支付申购款总额	3,676,339.95
减：申购股票成本总额	8,851,518.84
申购差价收入	76,041.21

### 6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	62,244,929.21
减：卖出/赎回基金成本总额	58,836,880.11
基金投资收益	3,408,049.10

### 6.4.7.14 债券投资收益

#### 6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.14.3 债券投资收益——赎回差价收入

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。

#### 6.4.7.14.4 债券投资收益——申购差价收入

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。

#### 6.4.7.14.5 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.15 贵金属投资收益

#### 6.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资。

#### 6.4.7.15.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.15.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.15.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资。

**6.4.7.16 衍生工具收益****6.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期内无衍生工具收益。

**6.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,867.16
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,867.16

**6.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	38,925,808.14
——股票投资	4,076.00
——债券投资	-228.78
——基金投资	38,921,960.92
——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	38,925,808.14

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	87,858.96
转换费收入 A 类 005868	53.98
合计	87,912.94

注：

1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，对持有期限少于 7 日的投资者收取的赎回费用将全额计入基金财产，对持有期限不少于 7 日的投资者收取的赎回费用不低于 25% 的部分归基金财产。
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费按注 1 中约定的比例计入基金财产。

#### 6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	43,861.19
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	2,886.75
其中：申购费	206.52

赎回费	418.77
其他	2,261.46
合计	46,747.94

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
审计费用	25,787.07
信息披露费	59,044.72
银行费用	2,710.12
合计	87,541.91

#### 6.4.7.22 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 关联方关系

##### 6.4.8.1 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。

##### 6.4.8.2 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、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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

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
上海陆金所基金销售有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
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
中国平安人寿保险股份有限公司	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司、基金销售机构
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、基金销售机构

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。

## 6.4.9 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.9.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.9.1.1 股票交易

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股票交易。

#### 6.4.9.1.2 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。

#### 6.4.9.1.3 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。

#### 6.4.9.1.4 基金交易

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基金交易。

#### 6.4.9.1.5 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。

#### 6.4.9.1.6 应支付关联方的佣金

本基金于本期及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

## 6.4.9.2 关联方报酬

### 6.4.9.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 6 月 21 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	26,466.83	27,593.05
其中：支付销售机构的客户维护费	183,447.33	-

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扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产（若为负数，则取零）的 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 =  $\text{Max}(\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产}, 0) \times 0.50\% / \text{当年天数}$ 。

### 6.4.9.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	2018 年 6 月 21 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	5,293.36	5,518.61

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扣除前一日所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产（若为负数，则取零）的 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 =  $\text{Max}(\text{前一日基金资产净值} - \text{前一日所持有目标 ETF 基金份额部分基金资产}, 0) \times 0.1\% / \text{当年天数}$ 。

## 6.4.9.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	平安 MSCI 中国 A 股 国际 ETF 联接 A	平安 MSCI 中国 A 股 国际 ETF 联接 C	合计
平安银行股份有限公司	-	3,085.35	3,085.35
平安基金管理有限公司	-	2,706.85	2,706.85
中国平安人寿保险股份 有限公司	-	217.13	217.13
上海陆金所基金销售有 限公司	-	29,432.79	29,432.79
中国工商银行股份有限 公司	-	479.12	479.12
合计	-	35,921.24	35,921.24
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 6 月 21 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销售服务费		
	平安 MSCI 中国 A 股 国际 ETF 联接 A	平安 MSCI 中国 A 股 国际 ETF 联接 C	合计
合计	-	-	-

支付基金销售机构的销售服务费按 C 类基金份额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，按月支付给平安基金管理有限公司，再由平安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日 C 类基金份额销售服务费 = 前一日 C 类基金份额基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

## 6.4.9.3 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。

#### 6.4.9.4 各关联方投资本基金的情况

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

无

##### 6.4.10.4.2 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

无

#### 6.4.9.5 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 21 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	10,467,728.06	42,503.71	123,792,430.56

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。

#### 6.4.9.6 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。

#### 6.4.9.7 其他关联交易事项的说明

(1) 于本报告期末，本基金持有 169,975,154 份目标 ETF 基金份额，占其总份额比例的 78.93%。

(2) 于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 6,800 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 39,644.00 元，估值总额为人民币 40,052.00 元，占基金资产净值的比例为 0.02%。

(3) 于 2019 年 6 月 30 日，本基金持有 1,400 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 121,282.00 元，估值总额为人民币 124,054.00 元，占基金资产净值的比例为 0.06%。

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

##### 6.4.10.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.10.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。



### **6.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.10.3.1 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。

#### **6.4.10.3.2 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。

### **6.4.11 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

#### **6.4.11.1 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。

#### **6.4.11.2 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	900,532.00	0.47
	其中：股票	900,532.00	0.47
2	基金投资	180,904,556.40	93.83
3	固定收益投资	25,770.10	0.01
	其中：债券	25,770.10	0.01
	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	10,518,189.82	5.46
8	其他各项资产	446,831.74	0.23
9	合计	192,795,880.06	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末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	采矿业	-	-
C	制造业	337,943.00	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,220.00	0.02

E	建筑业	30,475.00	0.02
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	499,686.00	0.26
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	208.00	0.00
	合计	900,532.00	0.47

### 7.2.2 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	200	196,800.00	0.10
2	601318	中国平安	1,400	124,054.00	0.06
3	600036	招商银行	2,600	93,548.00	0.05
4	601166	兴业银行	2,600	47,554.00	0.02

5	600000	浦发银行	3,700	43,216.00	0.02
6	601398	工商银行	6,800	40,052.00	0.02
7	600276	恒瑞医药	600	39,600.00	0.02
8	601288	农业银行	9,300	33,480.00	0.02
9	600900	长江电力	1,800	32,220.00	0.02
10	603288	海天味业	300	31,500.00	0.02

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。

## 7.4 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	600519	贵州茅台	683,932.00	0.37
2	601318	中国平安	452,145.81	0.25
3	600036	招商银行	365,816.00	0.20
4	601166	兴业银行	251,396.00	0.14
5	600000	浦发银行	224,641.00	0.12
6	601398	工商银行	202,300.00	0.11
7	601288	农业银行	184,379.00	0.10
8	600276	恒瑞医药	182,814.00	0.10
9	601668	中国建筑	166,470.00	0.09
10	600900	长江电力	163,228.00	0.09
11	601328	交通银行	161,639.00	0.09
12	600016	民生银行	149,600.00	0.08
13	601601	中国太保	147,525.28	0.08
14	600030	中信证券	143,505.00	0.08
15	600104	上汽集团	140,098.00	0.08

16	600050	中国联通	133,017.00	0.07
17	603288	海天味业	129,416.00	0.07
18	601766	中国中车	122,790.00	0.07
19	601988	中国银行	117,875.00	0.06
20	600887	伊利股份	115,202.00	0.06

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	600519	贵州茅台	1,135,920.00	0.62
2	601318	中国平安	800,209.00	0.44
3	600036	招商银行	652,890.00	0.36
4	601166	兴业银行	415,740.00	0.23
5	600000	浦发银行	367,020.00	0.20
6	601398	工商银行	329,230.00	0.18
7	601288	农业银行	301,199.00	0.16
8	600276	恒瑞医药	299,764.00	0.16
9	601668	中国建筑	282,378.00	0.15
10	600900	长江电力	268,780.00	0.15
11	601328	交通银行	268,604.00	0.15
12	600030	中信证券	256,241.00	0.14
13	600050	中国联通	255,948.00	0.14
14	600016	民生银行	247,968.00	0.14
15	601601	中国太保	242,065.00	0.13
16	600104	上汽集团	235,241.00	0.13
17	601766	中国中车	231,168.00	0.13

18	601988	中国银行	220,434.00	0.12
19	600048	保利地产	199,843.00	0.11
20	601818	光大银行	199,028.00	0.11

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	10,746,630.74
卖出股票收入（成交）总额	19,590,524.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	25,770.10	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	25,770.10	0.01

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	132017	19 新钢 EB	250	24,825.00	0.01
2	110058	永鼎转债	10	945.10	0.00

**7.7 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。

**7.8 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。

**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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细**

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	MSCI 国际	股票型	交易型开放式	平安基金管理有限公司	180,904,556.40	94.03

## **7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **7.11.1 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。

### **7.11.2 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。

## **7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **7.12.1 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。

### **7.12.2 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。

### **7.12.3 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。

## **7.13 投资组合报告附注**

### **7.13.1**

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：本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

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。

### **7.13.2**

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。



**7.13.3 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	20,981.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,988.72
5	应收申购款	423,861.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	446,831.74

**7.13.4 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。

**7.13.5 期末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。

**7.13.6 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

份额 级别	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
平 安 MSCI 中国 A 股 国 际 ETF 联接 A	2,455	45,158.12	0.00	0.00%	110,863,188.94	100.00%
平 安 MSCI 中国 A 股 国 际 ETF 联接 C	2,622	24,273.68	0.00	0.00%	63,645,576.95	100.00%
合计	5,000	34,901.75	0.00	0.00%	174,508,765.89	100.00%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	平安 MSCI 中国 A 股 国际 ETF	12,161.33	0.0110%

	联接 A		
	平安 MSCI 中国 A 股 国际 ETF 联接 C	147,951.34	0.2325%
	合计	160,112.67	0.0918%

上述机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 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	份额级别	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	平安 MSCI 中国 A 股国 际 ETF 联接 A	0
	平安 MSCI 中国 A 股国 际 ETF 联接 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	平安 MSCI 中国 A 股国 际 ETF 联接 A	0
	平安 MSCI 中国 A 股国 际 ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 A	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接 C
基金合同生效日（2018 年 6 月 21 日）基金份 额总额	123,602,113.02	100,176,800.86
本报告期期初基金份额总额	115,794,675.92	91,294,901.42
本报告期期间基金总申购份额	77,479,427.78	49,344,592.90
减：本报告期期间基金总赎回份额	82,410,914.76	76,993,917.37
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	110,863,188.94	63,645,576.95

## § 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	29,008,322.77	95.62%	20,633.75	95.62%	-
东方证券	2	1,328,832.00	4.38%	945.14	4.38%	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
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

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中泰证券	-	-	-	-	-	-	49,199,104.01	97.90%
东方证券	-	-	-	-	-	-	1,057,153.60	2.10%
爱建证券	-	-	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-

平安基金管理有限公司

2019 年 8 月 23 日