

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

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。

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 主要财务指标和基金净值表现	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.....	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表.....	16

6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
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.....	56
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.....	56
7.8 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.....	56
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.....	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
§8 基金份额持有人信息.....	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	59
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	62
10.1 基金份额持有人大会决议.....	62
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.....	62
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62

10.8 其他重大事件.....	64
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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	65
备查文件目录.....	66
11.2 备查文件目录.....	66
11.3 存放地点.....	66
11.4 查阅方式.....	66

§ 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	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	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.fund.pingan.com
基金半年度报告备置地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(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
本期加权平均净值利润率	28.92%
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)
期末可供分配利润	6,077,024.32
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
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	6.43%

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%

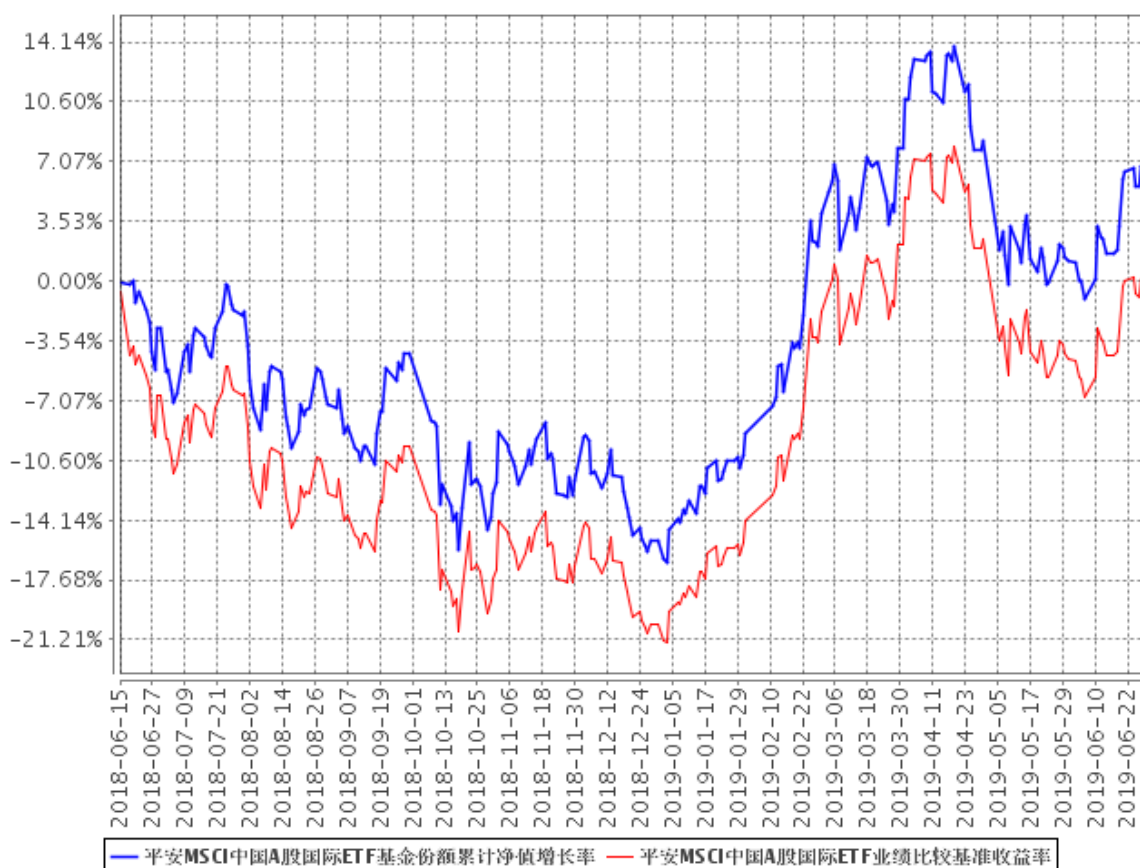
注：1、MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)收益率。MSCI A 股国际指

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。

3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（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
资产：			
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
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	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
所有者权益：			
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
一、收入		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	-
减：二、费用		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
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		76,232,445.93	-9,003,772.14
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		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：

罗春风

基金管理人负责人

林婉文

主管会计工作负责人

张南南

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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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	4,568,423.43
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:	4,568,423.43
-----	--------------

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	208,630,015.34	224,487,960.60	15,857,945.26
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	208,630,015.34	224,487,960.60	15,857,945.26

注：于 2019 年 6 月 30 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。

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从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	772.35
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	103.05

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	10.26
合计	885.66

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
其他应收款	-
待摊费用	193,684.37
合计	193,684.37

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	50,745.42
银行间市场应付交易费用	-
合计	50,745.42

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	-
预提费用	141,034.35
应付指数使用费	34,373.50
合计	175,407.85

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	386,337,704.00	386,337,704.00
本期申购	27,000,000.00	27,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-198,000,000.00	-198,000,000.00
- 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	215,337,704.00	215,337,704.00

6.4.7.10 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
上年度末	-7,670,574.59	-51,830,977.82	-59,501,552.41
本期利润	10,358,438.89	65,874,007.04	76,232,445.93
本期基金份额交易产生的变动数	3,389,160.02	-6,263,327.00	-2,874,166.98
其中：基金申购款	144,255.08	373,286.67	517,541.75
基金赎回款	3,244,904.94	-6,636,613.67	-3,391,708.73
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,077,024.32	7,779,702.22	13,856,726.54

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
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	637.60
其他	201.15
合计	11,122.15

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	2,257,156.39
股票投资收益——赎回差价收入	7,204,276.55
股票投资收益——申购差价收入	-
合计	9,461,432.94

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	96,934,957.36
减：卖出股票成本总额	94,677,800.97
买卖股票差价收入	2,257,156.39

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
赎回基金份额对价总额	201,391,708.73
减：现金支付赎回款总额	56,083,519.73
减：赎回股票成本总额	138,103,912.45
赎回差价收入	7,204,276.55

6.4.7.12.4 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。

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 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。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.13.3 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。

6.4.7.13.4 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。

6.4.7.13.5 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益**6.4.7.14.1 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。

6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无贵金属投资。

6.4.7.14.3 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。

6.4.7.14.4 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。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.16 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	2,151,679.43

基金投资产生的股利收益	-
合计	2,151,679.43

6.4.7.17 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	65,874,007.04
——股票投资	65,874,007.04
——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	65,874,007.04

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。

6.4.7.18 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	-
替代损益	55,303.94
合计	55,303.94

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。

6.4.7.19 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	210,710.15

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	210,710.15

6.4.7.20 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	29,752.78
信息披露费	56,733.60
登记结算费	106,315.63
上市费	29,752.78
银行汇划费	331.00
IOPV 计算费	24,795.19
指数使用费	74,036.87
合计	321,717.85

6.4.7.21 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，无须作披露的分部报告。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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%	-	-

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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司	-	-	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	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。

6.4.10.2.3 销售服务费

无

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无

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

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%

6.4.10.5 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 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。

6.4.10.6 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。

6.4.10.7 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%。

6.4.11 利润分配情况**6.4.11.1**

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	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	-

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中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。本基金管理人制订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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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。

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末本基金未持有按长期信用评级列示的债券。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 6.4.12 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 2019 年 06 月 30 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，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.2 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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的

基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。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 2019 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.02%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2019 年 6 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 228,999,407.49 元，超过经确认的当日净赎回金额。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30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	4,568,423.43	-	-	-	-	-	4,568,423.43
结算备付金	254,457.59	-	-	-	-	-	254,457.59
存出保证金	25,414.20	-	-	-	-	-	25,414.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	224,487,960.60	224,487,960.60
应收利息	-	-	-	-	-	885.66	885.66
其他资产	-	-	-	-	-	193,684.37	193,684.37
资产总计	4,848,295.22	-	-	-	-	224,682,530.63	229,530,825.85
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	91,868.38	91,868.38
应付托管费	-	-	-	-	-	18,373.66	18,373.66
应付交易费用	-	-	-	-	-	50,745.42	50,745.42
其他负债	-	-	-	-	-	175,407.85	175,407.85
应付税费	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	336,395.31	336,395.31
利率敏感度缺口	4,848,295.22	-	-	-	-	224,346,135.32	229,194,430.54
上年度末 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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券(2018 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		上年度末 2018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	224,487,960.60	97.95	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	224,487,960.60	97.95	325,323,162.46	99.54

6.4.13.4.3.2 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（2019年6月30日）	上年度末（2018年12月31日）
	业绩比较基准增加5%	11,993,852.33	17,522,085.17
	业绩比较基准减少5%	-11,993,852.33	-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。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 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所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	600900	长江电力	129,400	2,316,260.00	1.01
12	002415	海康威视	82,437	2,273,612.46	0.99
13	601668	中国建筑	370,340	2,129,455.00	0.93
14	601328	交通银行	346,000	2,117,520.00	0.92
15	000001	平安银行	151,400	2,086,292.00	0.91
16	603288	海天味业	19,800	2,079,000.00	0.91
17	600030	中信证券	86,800	2,066,708.00	0.90
18	601601	中国太保	55,400	2,022,654.00	0.88
19	600016	民生银行	312,800	1,986,280.00	0.87
20	000333	美的集团	35,121	1,821,375.06	0.79
21	600887	伊利股份	53,500	1,787,435.00	0.78
22	600104	上汽集团	68,700	1,751,850.00	0.76
23	601766	中国中车	214,500	1,735,305.00	0.76
24	600050	中国联通	273,500	1,684,760.00	0.74
25	300498	温氏股份	46,800	1,678,248.00	0.73
26	002304	洋河股份	13,300	1,616,748.00	0.71
27	601888	中国国旅	17,229	1,527,350.85	0.67
28	600585	海螺水泥	35,300	1,464,950.00	0.64
29	000651	格力电器	26,500	1,457,500.00	0.64
30	601818	光大银行	351,300	1,338,453.00	0.58
31	600048	保利地产	104,800	1,337,248.00	0.58
32	601688	华泰证券	57,600	1,285,632.00	0.56

33	600028	中国石化	224,900	1,230,203.00	0.54
34	601211	国泰君安	66,400	1,218,440.00	0.53
35	001979	招商蛇口	58,100	1,214,290.00	0.53
36	601988	中国银行	310,000	1,159,400.00	0.51
37	601229	上海银行	96,220	1,140,207.00	0.50
38	601989	中国重工	201,700	1,121,452.00	0.49
39	002142	宁波银行	45,900	1,112,616.00	0.49
40	601169	北京银行	186,500	1,102,215.00	0.48
41	600019	宝钢股份	163,600	1,063,400.00	0.46
42	601006	大秦铁路	131,000	1,059,790.00	0.46
43	000568	泸州老窖	12,900	1,042,707.00	0.45
44	000725	京东方 A	298,400	1,026,496.00	0.45
45	600837	海通证券	71,400	1,013,166.00	0.44
46	601186	中国铁建	101,400	1,008,930.00	0.44
47	601336	新华保险	18,300	1,007,049.00	0.44
48	000063	中兴通讯	30,300	985,659.00	0.43
49	601857	中国石油	142,800	982,464.00	0.43
50	002024	苏宁易购	82,000	941,360.00	0.41
51	600690	海尔智家	53,800	930,202.00	0.41
52	002475	立讯精密	36,360	901,364.40	0.39
53	600031	三一重工	68,700	898,596.00	0.39
54	600015	华夏银行	113,100	870,870.00	0.38
55	600999	招商证券	50,500	863,045.00	0.38
56	601933	永辉超市	84,500	862,745.00	0.38
57	600340	华夏幸福	26,400	859,848.00	0.38
58	300015	爱尔眼科	27,320	846,100.40	0.37
59	000166	申万宏源	165,800	830,658.00	0.36
60	002594	比亚迪	16,000	811,520.00	0.35
61	601155	新城控股	19,900	792,219.00	0.35
62	601088	中国神华	38,800	790,744.00	0.35
63	300059	东方财富	57,400	777,770.00	0.34
64	000538	云南白药	9,225	769,549.50	0.34
65	600406	国电南瑞	40,400	753,056.00	0.33
66	600919	江苏银行	101,800	739,068.00	0.32
67	601012	隆基股份	31,970	738,826.70	0.32
68	002714	牧原股份	12,260	720,765.40	0.31
69	000776	广发证券	52,300	718,602.00	0.31
70	600009	上海机场	8,500	712,130.00	0.31
71	601628	中国人寿	24,600	696,672.00	0.30

72	002027	分众传媒	129,460	684,843.40	0.30
73	601225	陕西煤业	73,500	679,140.00	0.30
74	600010	宝钢股份	401,800	679,042.00	0.30
75	600547	山东黄金	16,400	675,188.00	0.29
76	000338	潍柴动力	52,900	650,141.00	0.28
77	000876	新希望	37,200	646,164.00	0.28
78	601985	中国核电	114,300	635,508.00	0.28
79	601939	建设银行	84,600	629,424.00	0.27
80	601009	南京银行	74,800	617,848.00	0.27
81	603993	洛阳钼业	155,600	616,176.00	0.27
82	002230	科大讯飞	18,400	611,616.00	0.27
83	600436	片仔癀	5,300	610,560.00	0.27
84	000895	双汇发展	24,300	604,827.00	0.26
85	600741	华域汽车	27,800	600,480.00	0.26
86	601669	中国电建	112,300	594,067.00	0.26
87	600588	用友网络	22,000	591,360.00	0.26
88	600029	南方航空	75,800	585,176.00	0.26
89	601899	紫金矿业	152,500	574,925.00	0.25
90	300760	迈瑞医疗	3,500	571,200.00	0.25
91	600958	东方证券	52,600	561,768.00	0.25
92	600115	东方航空	86,600	542,982.00	0.24
93	600809	山西汾酒	7,600	524,780.00	0.23
94	601901	方正证券	72,700	516,897.00	0.23
95	600018	上港集团	74,900	510,818.00	0.22
96	600332	白云山	12,400	508,028.00	0.22
97	000661	长春高新	1,500	507,000.00	0.22
98	300122	智飞生物	11,700	504,270.00	0.22
99	000069	华侨城 A	72,500	503,875.00	0.22
100	600606	绿地控股	71,400	487,662.00	0.21
101	600438	通威股份	34,300	482,258.00	0.21
102	600570	恒生电子	7,040	479,776.00	0.21
103	601618	中国中冶	157,500	478,800.00	0.21
104	002736	国信证券	36,100	475,076.00	0.21
105	600383	金地集团	39,700	473,621.00	0.21
106	600886	国投电力	59,800	464,646.00	0.20
107	300033	同花顺	4,700	462,292.00	0.20
108	601600	中国铝业	115,500	452,760.00	0.20
109	600352	浙江龙盛	28,700	452,599.00	0.20
110	600893	航发动力	19,889	451,679.19	0.20

111	600196	复星医药	17,700	447,810.00	0.20
112	300750	宁德时代	6,500	447,720.00	0.20
113	600795	国电电力	173,200	439,928.00	0.19
114	601877	正泰电器	19,000	438,710.00	0.19
115	600061	国投资本	31,000	434,310.00	0.19
116	002311	海大集团	14,000	432,600.00	0.19
117	600705	中航资本	79,000	428,180.00	0.19
118	601138	工业富联	34,800	419,340.00	0.18
119	600111	北方稀土	32,000	410,880.00	0.18
120	600703	三安光电	35,900	404,952.00	0.18
121	600660	福耀玻璃	17,600	400,048.00	0.17
122	000963	华东医药	15,400	399,784.00	0.17
123	601377	兴业证券	59,100	398,334.00	0.17
124	000100	TCL 集团	119,300	397,269.00	0.17
125	601788	光大证券	34,500	393,990.00	0.17
126	000596	古井贡酒	3,300	391,083.00	0.17
127	000768	中航飞机	24,500	385,875.00	0.17
128	300142	沃森生物	13,600	385,696.00	0.17
129	002236	大华股份	26,400	383,328.00	0.17
130	000783	长江证券	48,800	381,128.00	0.17
131	600271	航天信息	16,500	380,325.00	0.17
132	002202	金风科技	30,500	379,115.00	0.17
133	002007	华兰生物	12,400	378,076.00	0.16
134	002422	科伦药业	12,700	377,571.00	0.16
135	600926	杭州银行	45,180	376,349.40	0.16
136	601727	上海电气	68,900	370,682.00	0.16
137	002001	新 和 成	18,900	364,581.00	0.16
138	601021	春秋航空	8,100	364,500.00	0.16
139	002032	苏 泊 尔	4,800	363,984.00	0.16
140	300003	乐普医疗	15,700	361,414.00	0.16
141	002146	荣盛发展	38,400	360,576.00	0.16
142	600482	中国动力	15,200	359,024.00	0.16
143	002352	顺丰控股	10,500	356,580.00	0.16
144	603899	晨光文具	8,100	356,157.00	0.16
145	600023	浙能电力	80,200	354,484.00	0.15
146	600085	同仁堂	12,100	350,900.00	0.15
147	601108	财通证券	31,600	346,968.00	0.15
148	002157	正邦科技	20,800	346,528.00	0.15
149	600674	川投能源	38,900	346,210.00	0.15

150	002044	美年健康	27,600	343,344.00	0.15
151	603589	口子窖	5,300	341,426.00	0.15
152	000157	中联重科	56,600	340,166.00	0.15
153	000703	恒逸石化	24,900	340,134.00	0.15
154	601018	宁波港	77,400	339,786.00	0.15
155	300347	泰格医药	4,400	339,240.00	0.15
156	601111	中国国航	35,200	336,864.00	0.15
157	300124	汇川技术	14,600	334,486.00	0.15
158	600004	白云机场	18,200	331,240.00	0.14
159	002410	广联达	10,000	328,900.00	0.14
160	600346	恒力石化	26,880	326,860.80	0.14
161	600297	广汇汽车	72,100	321,566.00	0.14
162	600637	东方明珠	30,390	320,310.60	0.14
163	002493	荣盛石化	25,900	312,354.00	0.14
164	600489	中金黄金	30,400	312,208.00	0.14
165	002673	西部证券	30,900	311,472.00	0.14
166	000425	徐工机械	69,300	309,078.00	0.13
167	601607	上海医药	17,000	308,550.00	0.13
168	603369	今世缘	11,000	306,790.00	0.13
169	000860	顺鑫农业	6,550	305,557.50	0.13
170	600600	青岛啤酒	6,100	304,573.00	0.13
171	002179	中航光电	9,050	302,813.00	0.13
172	600872	中炬高新	7,000	299,810.00	0.13
173	002916	深南电路	2,940	299,644.80	0.13
174	300408	三环集团	15,400	299,530.00	0.13
175	002506	协鑫集成	44,800	299,264.00	0.13
176	002271	东方雨虹	13,200	299,112.00	0.13
177	601998	中信银行	50,000	298,500.00	0.13
178	300144	宋城演艺	12,800	296,192.00	0.13
179	600176	中国巨石	31,000	295,430.00	0.13
180	600170	上海建工	78,500	295,160.00	0.13
181	300601	康泰生物	5,600	294,000.00	0.13
182	600516	方大炭素	23,691	291,162.39	0.13
183	601198	东兴证券	24,400	289,872.00	0.13
184	600362	江西铜业	18,300	288,042.00	0.13
185	600498	烽火通信	10,300	286,958.00	0.13
186	601919	中远海控	57,000	286,140.00	0.12
187	000961	中南建设	32,800	284,048.00	0.12
188	000656	金科股份	47,100	284,013.00	0.12

189	002153	石基信息	7,800	282,282.00	0.12
190	600177	雅戈尔	44,340	281,559.00	0.12
191	600183	生益科技	18,700	281,435.00	0.12
192	601838	成都银行	31,800	280,794.00	0.12
193	000709	河钢股份	93,700	280,163.00	0.12
194	603019	中科曙光	7,960	279,396.00	0.12
195	002405	四维图新	17,350	279,335.00	0.12
196	600487	亨通光电	16,660	279,221.60	0.12
197	600895	张江高科	13,600	279,072.00	0.12
198	600688	上海石化	53,900	278,124.00	0.12
199	601992	金隅集团	73,800	277,488.00	0.12
200	600867	通化东宝	18,000	277,200.00	0.12
201	002371	北方华创	4,000	277,000.00	0.12
202	601800	中国交建	24,100	272,812.00	0.12
203	000728	国元证券	29,600	271,432.00	0.12
204	601555	东吴证券	26,400	270,600.00	0.12
205	000786	北新建材	14,900	270,137.00	0.12
206	000977	浪潮信息	11,300	269,618.00	0.12
207	000066	中国长城	25,900	266,252.00	0.12
208	002601	龙麟佰利	17,900	265,457.00	0.12
209	300450	先导智能	7,800	262,080.00	0.11
210	601117	中国化学	43,500	261,870.00	0.11
211	600011	华能国际	41,900	261,037.00	0.11
212	600109	国金证券	26,600	258,552.00	0.11
213	603833	欧派家居	2,400	258,288.00	0.11
214	002050	三花智控	24,450	257,947.50	0.11
215	600875	东方电气	24,200	257,004.00	0.11
216	002466	天齐锂业	10,100	255,328.00	0.11
217	000999	华润三九	8,700	255,258.00	0.11
218	601360	三六零	11,900	254,422.00	0.11
219	002241	歌尔股份	28,600	254,254.00	0.11
220	600989	宝丰能源	21,500	253,915.00	0.11
221	600066	宇通客车	19,500	253,890.00	0.11
222	002555	三七互娱	18,700	253,385.00	0.11
223	600068	葛洲坝	40,400	251,692.00	0.11
224	300413	芒果超媒	6,100	250,405.00	0.11
225	601233	桐昆股份	16,100	249,711.00	0.11
226	000413	东旭光电	48,400	248,776.00	0.11
227	600522	中天科技	27,000	247,590.00	0.11

228	600369	西南证券	49,800	246,012.00	0.11
229	601997	贵阳银行	28,300	244,795.00	0.11
230	601100	恒立液压	7,800	244,764.00	0.11
231	600816	安信信托	48,400	244,420.00	0.11
232	002081	金螳螂	23,700	244,347.00	0.11
233	002127	南极电商	21,700	243,908.00	0.11
234	601216	君正集团	74,100	243,789.00	0.11
235	002926	华西证券	23,200	243,600.00	0.11
236	000050	深天马 A	18,100	243,264.00	0.11
237	600801	华新水泥	11,980	242,595.00	0.11
238	002372	伟星新材	13,860	241,164.00	0.11
239	600642	申能股份	40,100	241,001.00	0.11
240	002129	中环股份	24,600	240,096.00	0.10
241	600219	南山铝业	105,830	239,175.80	0.10
242	600398	海澜之家	26,300	238,541.00	0.10
243	600760	中航沈飞	8,200	238,046.00	0.10
244	600208	新湖中宝	75,800	238,012.00	0.10
245	002600	领益智造	40,100	237,793.00	0.10
246	600118	中国卫星	10,500	236,775.00	0.10
247	600089	特变电工	32,600	236,350.00	0.10
248	600188	兖州煤业	21,700	235,879.00	0.10
249	300628	亿联网络	2,200	235,554.00	0.10
250	600100	同方股份	26,000	235,300.00	0.10
251	000627	天茂集团	36,200	234,938.00	0.10
252	002049	紫光国微	5,300	233,783.00	0.10
253	600655	豫园股份	28,500	233,415.00	0.10
254	600161	天坛生物	9,236	233,209.00	0.10
255	601872	招商轮船	53,400	232,824.00	0.10
256	002460	赣锋锂业	9,900	231,957.00	0.10
257	300017	网宿科技	21,500	231,770.00	0.10
258	300014	亿纬锂能	7,600	231,496.00	0.10
259	000938	紫光股份	8,484	231,189.00	0.10
260	600298	安琪酵母	7,300	230,899.00	0.10
261	000975	银泰资源	17,500	230,825.00	0.10
262	600536	中国软件	4,300	230,781.00	0.10
263	000671	阳光城	35,600	230,688.00	0.10
264	002299	圣农发展	9,100	230,412.00	0.10
265	601238	广汽集团	21,000	229,530.00	0.10
266	600497	驰宏锌锗	45,100	229,108.00	0.10

267	000625	长安汽车	34,500	228,735.00	0.10
268	300383	光环新网	13,600	228,072.00	0.10
269	002508	老板电器	8,400	227,976.00	0.10
270	600528	中铁工业	19,700	227,929.00	0.10
271	601878	浙商证券	24,500	227,850.00	0.10
272	000630	铜陵有色	92,500	227,550.00	0.10
273	000423	东阿阿胶	5,700	226,974.00	0.10
274	600027	华电国际	60,100	226,577.00	0.10
275	300529	健帆生物	3,600	224,460.00	0.10
276	002373	千方科技	13,100	224,010.00	0.10
277	600153	建发股份	25,000	222,000.00	0.10
278	600535	天士力	13,300	220,115.00	0.10
279	002013	中航机电	31,900	219,472.00	0.10
280	002223	鱼跃医疗	8,900	219,118.00	0.10
281	600583	海油工程	39,100	218,960.00	0.10
282	600779	水井坊	4,300	218,526.00	0.10
283	002010	传化智联	28,800	216,864.00	0.09
284	600566	济川药业	7,200	216,792.00	0.09
285	300070	碧水源	27,800	216,562.00	0.09
286	002439	启明星辰	8,000	215,200.00	0.09
287	002180	纳思达	9,500	214,700.00	0.09
288	600977	中国电影	13,700	214,542.00	0.09
289	002558	巨人网络	11,800	214,406.00	0.09
290	002507	涪陵榨菜	7,000	213,500.00	0.09
291	600038	中直股份	5,200	213,304.00	0.09
292	600256	广汇能源	59,800	212,888.00	0.09
293	601099	太平洋	59,800	212,888.00	0.09
294	600426	华鲁恒升	14,300	212,498.00	0.09
295	600845	宝信软件	7,410	211,036.80	0.09
296	300136	信维通信	8,600	210,270.00	0.09
297	300024	机器人	13,800	210,174.00	0.09
298	000401	冀东水泥	11,900	209,559.00	0.09
299	601699	潞安环能	26,300	208,822.00	0.09
300	603885	吉祥航空	15,900	208,290.00	0.09
301	603986	兆易创新	2,400	208,080.00	0.09
302	600673	东阳光	26,500	208,025.00	0.09
303	600909	华安证券	31,800	207,972.00	0.09
304	000402	金融街	26,400	206,976.00	0.09
305	600155	华创阳安	15,300	205,479.00	0.09

306	002384	东山精密	14,100	205,437.00	0.09
307	600704	物产中大	37,900	205,418.00	0.09
308	600998	九州通	16,600	205,176.00	0.09
309	603799	华友钴业	9,598	204,533.38	0.09
310	600376	首开股份	22,800	203,604.00	0.09
311	300253	卫宁健康	14,300	202,774.00	0.09
312	002500	山西证券	24,900	201,690.00	0.09
313	603858	步长制药	7,820	201,521.40	0.09
314	300433	蓝思科技	28,900	201,433.00	0.09
315	002110	三钢闽光	21,600	200,880.00	0.09
316	600021	上海电力	23,100	200,508.00	0.09
317	601098	中南传媒	15,800	199,712.00	0.09
318	300676	华大基因	3,500	199,640.00	0.09
319	002624	完美世界	7,700	198,737.00	0.09
320	002195	二三四五	51,031	198,510.59	0.09
321	002385	大北农	37,400	197,846.00	0.09
322	600415	小商品城	48,000	197,760.00	0.09
323	600739	辽宁成大	13,500	196,290.00	0.09
324	600776	东方通信	8,500	195,330.00	0.09
325	002797	第一创业	30,800	195,272.00	0.09
326	002465	海格通信	20,424	194,844.96	0.09
327	002353	杰瑞股份	8,400	194,040.00	0.08
328	002399	海普瑞	9,200	193,108.00	0.08
329	600959	江苏有线	43,300	192,685.00	0.08
330	600460	士兰微	11,600	192,560.00	0.08
331	002065	东华软件	27,400	191,526.00	0.08
332	601866	中远海发	70,100	190,672.00	0.08
333	600372	中航电子	12,800	189,952.00	0.08
334	601106	中国一重	60,200	189,028.00	0.08
335	002456	欧菲光	24,000	188,160.00	0.08
336	600675	中华企业	35,980	186,736.20	0.08
337	000750	国海证券	37,100	186,613.00	0.08
338	601598	中国外运	38,900	186,331.00	0.08
339	000031	大悦城	28,800	184,896.00	0.08
340	600315	上海家化	5,900	183,785.00	0.08
341	600584	长电科技	14,200	182,470.00	0.08
342	002268	卫士通	7,400	180,930.00	0.08
343	000686	东北证券	20,500	180,605.00	0.08
344	000027	深圳能源	29,100	180,420.00	0.08

345	000732	泰禾集团	10,900	179,850.00	0.08
346	600808	马钢股份	52,700	179,707.00	0.08
347	600699	均胜电子	8,400	179,424.00	0.08
348	600549	厦门钨业	12,500	178,875.00	0.08
349	000932	华菱钢铁	37,440	178,588.80	0.08
350	601966	玲珑轮胎	10,500	178,500.00	0.08
351	000898	鞍钢股份	46,930	177,864.70	0.08
352	600008	首创股份	50,400	177,408.00	0.08
353	300296	利亚德	22,600	176,958.00	0.08
354	002563	森马服饰	15,900	175,854.00	0.08
355	300251	光线传媒	25,800	175,440.00	0.08
356	603000	人民网	9,800	174,734.00	0.08
357	600820	隧道股份	27,600	174,156.00	0.08
358	600339	中油工程	41,200	173,864.00	0.08
359	002340	格林美	36,700	172,857.00	0.08
360	002294	信立泰	7,700	172,326.00	0.08
361	600160	巨化股份	24,200	172,062.00	0.08
362	600392	盛和资源	15,460	170,987.60	0.07
363	000046	泛海控股	30,600	170,748.00	0.07
364	600598	北大荒	15,800	169,534.00	0.07
365	000983	西山煤电	27,800	168,468.00	0.07
366	601179	中国西电	45,400	167,980.00	0.07
367	000998	隆平高科	11,600	167,968.00	0.07
368	002773	康弘药业	5,100	167,892.00	0.07
369	000623	吉林敖东	10,200	167,178.00	0.07
370	600967	内蒙一机	14,878	166,633.60	0.07
371	000883	湖北能源	38,100	165,354.00	0.07
372	000960	锡业股份	14,800	165,316.00	0.07
373	000729	燕京啤酒	24,800	164,672.00	0.07
374	600466	蓝光发展	26,300	163,586.00	0.07
375	300072	三聚环保	20,600	163,358.00	0.07
376	600863	内蒙华电	51,400	161,396.00	0.07
377	601333	广深铁路	49,800	160,854.00	0.07
378	600201	生物股份	10,240	160,665.60	0.07
379	600885	宏发股份	6,600	160,380.00	0.07
380	002812	恩捷股份	3,400	158,950.00	0.07
381	601958	金钼股份	23,700	158,790.00	0.07
382	000778	新兴铸管	35,400	157,176.00	0.07
383	600737	中粮糖业	18,100	157,108.00	0.07

384	600026	中远海能	24,200	157,058.00	0.07
385	000997	新大陆	9,200	155,388.00	0.07
386	600258	首旅酒店	8,600	154,628.00	0.07
387	002078	太阳纸业	22,700	154,587.00	0.07
388	600511	国药股份	6,700	153,899.00	0.07
389	600521	华海药业	10,900	153,690.00	0.07
390	600373	中文传媒	12,200	153,232.00	0.07
391	002217	合力泰	27,500	152,075.00	0.07
392	601718	际华集团	38,700	151,317.00	0.07
393	002092	中泰化学	18,900	150,444.00	0.07
394	002572	索菲亚	8,100	150,336.00	0.07
395	600572	康恩贝	23,400	149,760.00	0.07
396	600879	航天电子	24,200	149,072.00	0.07
397	000826	启迪桑德	12,600	148,554.00	0.06
398	603077	和邦生物	77,900	148,010.00	0.06
399	600380	健康元	17,108	147,984.20	0.06
400	600486	扬农化工	2,700	147,690.00	0.06
401	600446	金证股份	7,500	147,300.00	0.06
402	000060	中金岭南	31,400	147,266.00	0.06
403	600273	嘉化能源	12,700	146,812.00	0.06
404	601880	大连港	68,600	146,118.00	0.06
405	002152	广电运通	21,300	145,905.00	0.06
406	600649	城投控股	22,400	144,928.00	0.06
407	600648	外高桥	6,900	144,762.00	0.06
408	000559	万向钱潮	24,200	144,716.00	0.06
409	601000	唐山港	52,400	144,100.00	0.06
410	000039	中集集团	13,440	143,539.20	0.06
411	000830	鲁西化工	13,000	141,440.00	0.06
412	002038	双鹭药业	6,000	141,360.00	0.06
413	002085	万丰奥威	19,300	140,504.00	0.06
414	600782	新钢股份	28,100	140,500.00	0.06
415	603883	老百姓	2,400	140,352.00	0.06
416	000839	中信国安	34,680	139,413.60	0.06
417	600827	百联股份	14,200	139,302.00	0.06
418	600718	东软集团	10,800	138,456.00	0.06
419	600500	中化国际	18,400	137,448.00	0.06
420	000581	威孚高科	7,400	137,344.00	0.06
421	000503	国新健康	8,000	137,280.00	0.06
422	600643	爱建集团	14,300	136,994.00	0.06

423	600567	山鹰纸业	40,600	136,822.00	0.06
424	000738	航发控制	10,200	136,680.00	0.06
425	600282	南钢股份	39,000	136,500.00	0.06
426	002583	海能达	16,100	135,079.00	0.06
427	000513	丽珠集团	4,060	134,913.80	0.06
428	601168	西部矿业	21,100	134,618.00	0.06
429	000028	国药一致	3,200	133,856.00	0.06
430	002174	游族网络	7,900	133,352.00	0.06
431	002124	天邦股份	10,200	133,008.00	0.06
432	002074	国轩高科	10,100	132,411.00	0.06
433	600873	梅花生物	27,600	132,204.00	0.06
434	002019	亿帆医药	10,700	131,075.00	0.06
435	600056	中国医药	9,500	128,155.00	0.06
436	002221	东华能源	14,700	126,567.00	0.06
437	600037	歌华有线	12,300	126,075.00	0.06
438	600079	人福医药	12,000	126,000.00	0.05
439	600260	凯乐科技	6,300	125,874.00	0.05
440	600582	天地科技	36,300	125,235.00	0.05
441	600777	新潮能源	59,900	124,592.00	0.05
442	600348	阳泉煤业	21,400	124,334.00	0.05
443	002424	贵州百灵	12,400	122,512.00	0.05
444	002603	以岭药业	10,500	121,590.00	0.05
445	000681	视觉中国	6,200	120,156.00	0.05
446	000598	兴蓉环境	26,400	120,120.00	0.05
447	000990	诚志股份	7,300	119,793.00	0.05
448	000937	冀中能源	31,000	119,660.00	0.05
449	600835	上海机电	7,200	119,520.00	0.05
450	600277	亿利洁能	24,200	117,854.00	0.05
451	600062	华润双鹤	9,240	116,516.40	0.05
452	600754	锦江股份	4,700	115,808.00	0.05
453	002640	跨境通	13,700	114,121.00	0.05
454	600717	天津港	17,700	113,634.00	0.05
455	002745	木林森	9,400	110,168.00	0.05
456	600787	中储股份	19,200	110,016.00	0.05
457	600884	杉杉股份	10,000	106,500.00	0.05
458	002470	金正大	29,200	106,288.00	0.05
459	000887	中鼎股份	10,700	102,613.00	0.04
460	600409	三友化工	18,100	102,446.00	0.04
461	600291	西水股份	9,600	96,576.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	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
11	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.01
12	300788	中信出版	1,556	23,106.60	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。

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	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月3日
2	关于不法分子冒用“花生宝”名义开展非法金融业务的严正声明	中国证监会指定报刊及网站	2019年1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 2018 年第四季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月19日
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（2018 年第 1 期）以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月26日
5	平安基金管理有限公司关于直销账户名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月12日
6	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变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月2日
7	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2018 年年度报告以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年3月27日
8	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第一季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月19日
9	关于旗下部分基金新增中国国际金融股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年5月10日
10	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定网站	2019年6月18日
11	关于旗下基金新增中国银河证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年6月24日
12	平安基金管理有限公司 2019 年 6 月 30 日基金净值披露公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年6月30日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
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							
<p>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。</p>							

备查文件目录

11.2 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立平安 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。

11.3 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

11.4 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 8 月 23 日