

# 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 2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 27 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 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 其他指标.....	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	10
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	16
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.....	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	18
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>19</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	19
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.....	19
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	19
<b>§6 审计报告</b> .....	<b>20</b>

6.1 审计报告基本信息.....	20
6.2 审计报告的基本内容.....	20
<b>§7 年度财务报表.....</b>	<b>23</b>
7.1 资产负债表.....	23
7.2 利润表.....	24
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	25
7.4 报表附注.....	26
<b>§8 投资组合报告.....</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	53
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	53
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	57
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	57
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
8.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>60</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	60
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
9.4 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
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>61</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>62</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62

11.4 基金投资策略的改变 .....	62
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	62
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	62
11.8 其他重大事件 .....	65
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>68</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	68
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>69</b>
13.1 备查文件目录.....	69
13.2 存放地点.....	69
13.3 查阅方式.....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	平安恒生中国企业 ETF
场内简称	恒生国企
基金主代码	159960
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 9 月 21 日
基金管理人	平安基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	538,573,960.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2018 年 10 月 22 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
业绩比较基准	恒生中国企业指数（经汇率调整）收益率
风险收益特征	本基金属股票指数基金，预期风险与收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金主要通过港股通投资于香港证券市场中具有良好流动性的金融工具。除了需要承担与境内证券投资基金类似的市场波动风险等一般投资风险之外，本基金还面临港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险等。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	许俊
	联系电话	0755-22626828	010-66594319
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		400-800-4800	95566
传真		0755-23997878	010-66594942
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 1 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 1 号
邮政编码		518048	100818
法定代表人		罗春风	刘连舸

### 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>
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2019 年	2018 年 9 月 21 日 (基金合同生效日) - 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	9,980,223.30	-3,460,851.34
本期利润	77,145,929.24	-38,988,415.89
加权平均基金份额本期利润	0.1517	-0.0769
本期加权平均净值利润率	15.06%	-7.94%
本期基金份额净值增长率	16.25%	-7.70%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	7,046,576.72	-38,767,277.56
期末可供分配基金份额利润	0.0131	-0.0770
期末基金资产净值	577,869,254.44	464,806,682.44
期末基金份额净值	1.0730	0.9230
3.1.3 累计期末指标	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	7.30%	-7.70%

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

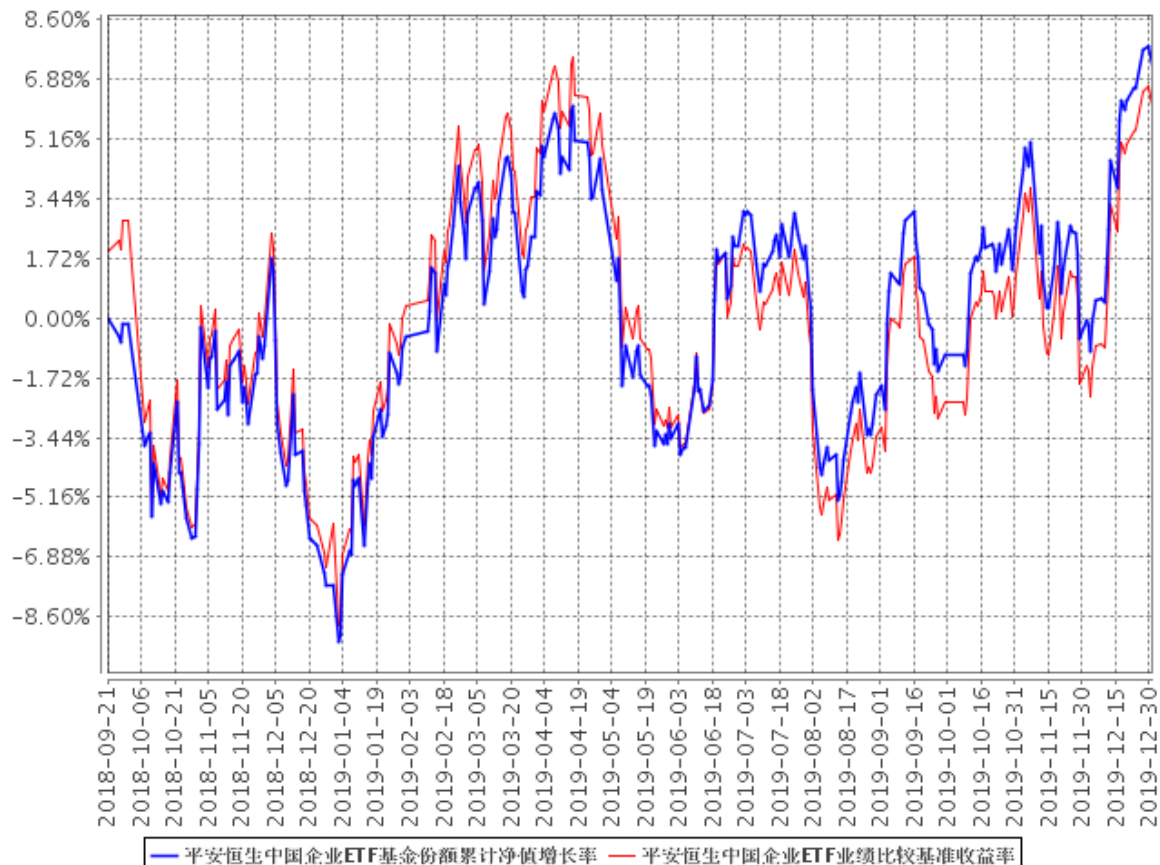
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	8.43%	0.93%	8.72%	0.95%	-0.29%	-0.02%
过去六个月	5.12%	0.89%	4.51%	0.90%	0.61%	-0.01%
过去一年	16.25%	0.95%	12.77%	0.99%	3.48%	-0.04%
自基金合同生效起至今	7.30%	1.02%	6.09%	1.11%	1.21%	-0.09%



### 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

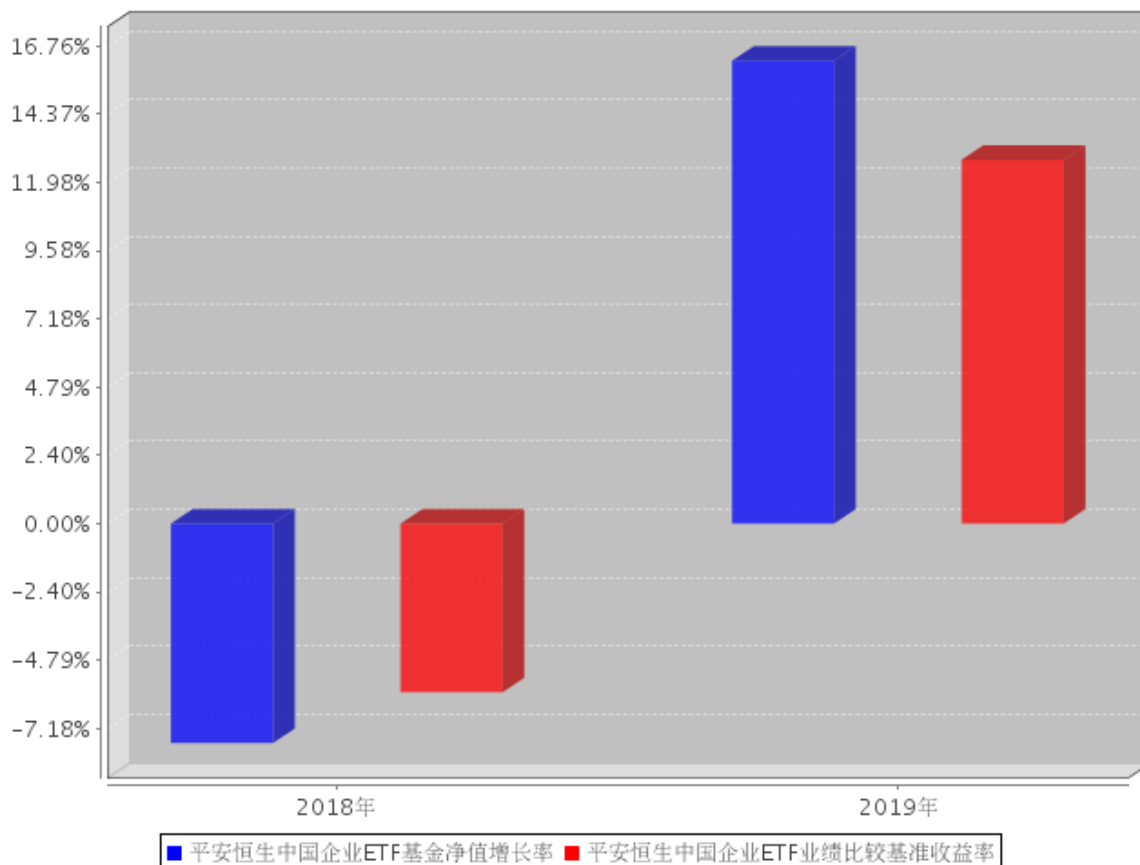
平安恒生中国企业ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2018 年 09 月 21 日正式生效；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

平安恒生中国企业ETF自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



1. 本基金合同于 2018 年 09 月 21 日正式生效。
2. 2018 年是合同生效当年，按实际续存期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金合同于 2018 年 9 月 21 日生效，自基金合同生效日至本报告期末未进行利润分配。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 68.19%；大华资产管理有限公司，持有股权 17.51%；三亚盈湾旅业有限公司，持有股权 14.3%。平安基金秉承“规范、诚信、专业、创新”企业管理理念，致力于通过持续稳定的投资业绩，不断丰富客户服务手段及服务内容，为投资人提供多样化的基金产品和高品质的理财服务，从而实现“以专业承载信赖”的品牌承诺，成为深得投资人信赖的基金管理公司。截至 2019 年 12 月 31 日，平安基金共管理 98 只公募基金，资产管理总规模约为 3494 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		
施旭	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	2018 年 9 月 21 日	2019 年 11 月 1 日	10	施旭先生，哥伦比亚大学金融数学硕士。曾任职于西部证券、Mockingbird Capital Management、EquaMetrics Inc、国信证券，2015 年加入平安基金管理有限公司，任衍生品投资中心量化研究员，曾担任平安深证 300 指数增强型证券投资基金、平安鑫享混合型证券投资基金、平安鑫安混合型证券投资基金、平安中证沪港深高股息精选指数型证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安量化先锋混合型发起式证券投资基金、平安量化精选混合型发起式证券投资基金、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、平安安享灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
钱晶	平安港股	2018 年 11 月	-	8	钱晶先生，美国纽约大学理

	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	6 日			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、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
刘帆	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	2019 年 12 月 12 日	-	3	刘帆，女，南开大学硕士。2016 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、平安中证 500 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、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、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、

					平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。
董俊玲	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	2019 年 7 月 22 日	-	2	董俊玲, 女, 同济大学硕士。曾担任鹏华基金管理有限公司 FOF 研究员。2019 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、平安中证 500 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、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、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安

					中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理。
刘洁倩	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）	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，曾任资产配置事业部ETF指数投资中心指数研究员、平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。现任平安中证粤港澳大湾区发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，同时担任平安沪深300交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深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、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数证券投资基金、平安中证5-10年期国债活跃券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。
万纯	平安港股	2018年10月	2019年4月	6	万纯，男，北京大学硕士，

	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）	16 日	11 日	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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》和《公开募集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合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本报告期内，根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本基金管理人严格遵守《平安基金管理有限公司公平交易管理制度》、《平安基金管理有限公司异常交易监控及报告制度》，严格执行法律法规及制度要求，从以下五个方面对交易行为进行严格控制：一是搭建平等的投资信息平台，合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策等方面享有公平的机会。二是制定公平交易规则，建立科学的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。三是加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，通过对投资交易行为的监控、分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。四是明确报告制度和路线，根据法规及公司内部要求，分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的投资业绩进行分析、评估，形成分析报告，由投资组合经理、督察长、总经理签署后，妥善保存备查，如果发现涉嫌违背公平交易原则的行为，及时向公司管理层汇报并采取相关控制和改进措施。五是建立投资组合投资信息的管理及保密制度，不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

作为一只投资于恒生中国企业指数的被动型产品，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。

#### 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 1.0730 元；本报告期基金份额净值增长率为 16.25%，业绩比较基准收益率为 12.77%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年，外部方面，中美贸易摩擦虽然仍有一定不确定性，但是边际影响下降。海外资金配置 A 股的比例仍然还有提升空间，预计外资将继续流入。国内方面，经济增长会面临一定压力，经济转型进程或将加速，从而提高长期潜在增长率显得尤为必要。货币政策方面，预计将继续偏向宽松，财政政策方面，预计会加大逆周期调节力度。综上考虑，我们对 2020 年权益资产的前景保持谨慎乐观。

作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金份额持有人利益出发，严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，在进一步梳理完善内部控制制度和业务流程的同时，确保各项法规和管理制度的落实。公司法律合规监察部按照规定的权限和程序，通过合规评审、合规检视等各项合规管理措施以及实时监控、定期检查、专项检查等方法，对基金的投资运作、基金销售、基金运营、客户服务和信息披露等进行了重点监控与稽核，发现问题及时提出改进建议，并督促相关部门进行整改，同时定期向董事会和公司管理层出具监察稽核报告。公司重视对员工的合规培训，开展了多次培训活动，加强对员工行为的管理，增强员工合规意识。公司还通过网站、邮件等多种形式进行了投资者教育工作。报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，基金合同得到严格履行，有效保障了基金份额持有人利益。本基金管理人将继续以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人严格按照企业会计准则、《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的资产按照公允价值进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方

法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中央国债登记结算有限责任公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本基金本报告期内未出现连续 20 个工作日基金份额持有人数量不满 200 人、基金资产净值低于 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在对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（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 24417 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安恒生中国企业 ETF 基金 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。  按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安恒生中国企业 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	平安恒生中国企业 ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

	<p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估平安恒生中国企业 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算平安恒生中国企业 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安恒生中国企业 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对平安恒生中国企业 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论</p>

	<p>基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安恒生中国企业 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	曹翠丽   邓昭君
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2020 年 4 月 23 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：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

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	16,368,200.01	12,362,620.90
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	562,707,097.20	452,982,103.67
其中：股票投资		562,707,097.20	452,982,103.67
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	3,106.51	3,519.07
应收股利		83,284.30	2,498.64
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		579,161,688.02	465,350,742.28
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		593,497.25	99.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		235,730.49	204,790.05
应付托管费		47,146.09	40,958.01
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	30,587.39	132,727.40
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	385,472.36	165,484.98
负债合计		1,292,433.58	544,059.84
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	538,573,960.00	503,573,960.00
未分配利润	7.4.7.10	39,295,294.44	-38,767,277.56
所有者权益合计		577,869,254.44	464,806,682.44
负债和所有者权益总计		579,161,688.02	465,350,742.28

报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0730 元，基金份额总额 538,573,960.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2018 年 9 月 21 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		81,259,922.68	-36,909,315.00
1.利息收入		107,093.52	316,809.02
其中：存款利息收入	7.4.7.11	107,093.52	205,944.38
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		-	110,864.64
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,227,359.17	-1,674,447.17
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-130,952.39	-1,744,976.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	14,358,311.56	70,529.10
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	67,165,705.94	-35,527,564.55
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-240,235.95	-24,112.30



<b>减：二、费用</b>		4,113,993.44	2,079,100.89
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,558,586.86	681,061.81
2. 托管费	7.4.10.2.2	511,717.35	136,212.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	564,150.03	1,050,421.74
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	479,539.20	211,404.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		77,145,929.24	-38,988,415.89
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		77,145,929.24	-38,988,415.89

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2019年1月1日至2019年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	503,573,960.00	-38,767,277.56	464,806,682.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	77,145,929.24	77,145,929.24
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）	35,000,000.00	916,642.76	35,916,642.76
其中：1.基金申购款	51,000,000.00	1,076,102.21	52,076,102.21
2.基金赎回款	-16,000,000.00	-159,459.45	-16,159,459.45
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）	538,573,960.00	39,295,294.44	577,869,254.44

项目	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	510,573,960.00	-	510,573,960.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-38,988,415.89	-38,988,415.89
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)	-7,000,000.00	221,138.33	-6,778,861.67
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-7,000,000.00	221,138.33	-6,778,861.67
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)	503,573,960.00	-38,767,277.56	464,806,682.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

_____ 罗春风	_____ 林婉文	_____ 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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(原名为平安大华港股通恒生中国企业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]1280号《关于准予平安大华港股通恒生中国企业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510,407,000.00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

0568 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《平安大华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合同》于 2018 年 9 月 21 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 510,573,960.00 份,其中认购资金利息折合 166,960.00 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,基金托管人为中国银行股份有限公司(以下简称“中国银行”)。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2018]485 号文审核同意,本基金 510,573,960.00 份基金份额于 2018 年 10 月 22 日在深交所挂牌交易。本基金上市交易后,所有的基金份额均可进行交易,不存在未上市交易的基金份额。

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》,平安大华港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金于 2018 年 11 月 30 日起更名为平安港股通恒生中国企业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合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数恒生中国企业指数(经汇率调整),追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化;本基金投资于标的指数成份股、备选成份股、依法发行上市的其他港股通标的股票、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、政府支持机构债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中小企业私募债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、通知存款以及定期存款等其它银行存款)、同业存单、现金、权证、股指期货等金融衍生品和法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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%。在正常市场情况下,力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为:恒生中国企业指数(经汇率调整)收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《平安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合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 年度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 2019 年 12 月 31 日的财务状况以及 2019 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。比较财务报表的实际编制期间为 2018 年 9 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率(经汇率调整)达到 1%以上时，可进行收益分配。基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；(2) 每一基金份额享有同等分配权；(3) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率(经汇率调整)为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；(4) 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可以进行分红，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分

配；(5)本基金收益分配采取现金分红的方式；(6)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无须作说明的其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、

财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。基金通过深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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



## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
活期存款	16,368,200.01	12,362,620.90
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：	16,368,200.01	12,362,620.90

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	531,068,955.81	562,707,097.20	31,638,141.39
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	531,068,955.81	562,707,097.20	31,638,141.39
项目	上年度末 2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	488,509,668.22	452,982,103.67	-35,527,564.55
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	488,509,668.22	452,982,103.67	-35,527,564.55

注：于 2019 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零(于 2018 年 12 月 31 日：零)。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,053.20	2,491.75
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	53.31	984.67
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	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	-	42.65
合计	3,106.51	3,519.07

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本期末及上年度末均未持有其他资产。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	30,587.39	132,727.40
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	30,587.39	132,727.40

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	186,000.00	111,000.00
指数使用费	90,181.87	54,484.98
应退退补款	109,231.67	-
现金差额	58.82	-
合计	385,472.36	165,484.98

## 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	503,573,960.00	503,573,960.00
本期申购	51,000,000.00	51,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-16,000,000.00	-16,000,000.00
- 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	538,573,960.00	538,573,960.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

## 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-3,446,267.75	-35,321,009.81	-38,767,277.56
本期利润	9,980,223.30	67,165,705.94	77,145,929.24
本期基金份额交易产生的变动数	512,621.17	404,021.59	916,642.76
其中：基金申购款	610,063.04	466,039.17	1,076,102.21
基金赎回款	-97,441.87	-62,017.58	-159,459.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,046,576.72	32,248,717.72	39,295,294.44

## 7.4.7.11 存款利息收入

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12月31日	2018年9月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	92,800.24	150,175.14
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	13,035.75	28,763.31
其他	1,257.53	27,005.93
合计	107,093.52	205,944.38

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年9月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-130,952.39	-1,744,976.27
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-130,952.39	-1,744,976.27

**7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019 年12月31日	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合 同生效日)至2018年12月31日
卖出股票成交总额	137,071,166.50	43,588,387.39
减：卖出股票成本总额	137,202,118.89	45,333,363.66
买卖股票差价收入	-130,952.39	-1,744,976.27

**7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资产生的赎回差价收入。

**7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资产生的申购差价收入。

**7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资产生的出借差价收入。

**7.4.7.13 债券投资收益****7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

**7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

**7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金于本期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.14 贵金属投资收益****7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成**

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金于本期及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.15 衍生工具收益****7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金于本期及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
股票投资产生的股利收益	14,358,311.56	70,529.10
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	14,358,311.56	70,529.10

**7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	67,165,705.94	-35,527,564.55
——股票投资	67,165,705.94	-35,527,564.55
——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	67,165,705.94	-35,527,564.55

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（上年度可比期间：零）。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同 生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	-	-
替代损益	-240,235.95	-24,112.30
合计	-240,235.95	-24,112.30

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生效 日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	564,150.03	1,050,421.74
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	564,150.03	1,050,421.74

### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月 31日	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
审计费用	66,000.00	66,000.00
信息披露费	120,000.00	45,000.00
证券出借违约金	-	-
上市费	60,000.00	45,000.00
指数使用费	233,104.20	54,484.98
银行费用	435.00	520.00
其他	-	400.00
合计	479,539.20	211,404.98

### 7.4.7.21 分部报告

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

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“平安基金”)	基金管理人
中国银行	基金托管人
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司	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



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（“平安人寿”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

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。

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生效日)至 2018年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的 比例
平安证券	-	-	120,000,000.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12 月31日	上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生效日) 至2018年12月31日
----	---------------------------------	--

当期发生的基金应支付的管理费	2,558,586.86	681,061.81
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人平安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年9月21日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	511,717.35	136,212.36

注：支付基金托管人中国银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金于本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。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

无。

**7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019年12月31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
平安人寿	499,563,366.00	92.7567%	500,165,666.00	99.3232%

**7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年9月21日(基金合同生效日)至 2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	16,368,200.01	92,800.24	12,362,620.90	150,175.14

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，按银行同业利率计息。

**7.4.10.7 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。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

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

(1) 于2019年12月31日，本基金持有8,595,090股中国银行的H股普通股，成本总额为人民币25,865,410.71元，估值总额为人民币25,638,701.37元，占基金资产净值的比例为4.44%(2018年12月31日：数量：9,902,000股；成本：29,936,555.54元；市值：28,978,282.22元；占基金资产净值的比例：6.23%)。

(2) 于2019年12月31日，本基金持有604,016股中国平安的H股普通股，成本总额为人民币42,191,615.20元，估值总额为人民币49,832,128.17元，占基金资产净值的比例为8.62%(2018年12月31日：数量：696,000股；成本：47,608,612.54元；市值：41,743,219.44元；占基金

资产净值的比例：8.98%)。

#### **7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### **7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券**

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

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。

##### **7.4.12.2 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。

##### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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。

###### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

##### **7.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款

存放在本基金的托管行中国银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的债券投资

#### **7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资

#### **7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资

#### **7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的债券投资

#### **7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资

#### **7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资

### **7.4.13.3 流动性风险**

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

#### **7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析**

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入

短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于报告期末，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。

#### **7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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%。于报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。

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。

#### **7.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **7.4.13.4.1 利率风险**

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

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

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

## 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	16,368,200.01	-	-	-	16,368,200.01
交易性金融资产	-	-	-	562,707,097.20	562,707,097.20
应收利息	-	-	-	3,106.51	3,106.51
应收股利	-	-	-	83,284.30	83,284.30
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,368,200.01	-	-	562,793,488.01	579,161,688.02
负债					
应付证券清算款	-	-	-	593,497.25	593,497.25
应付管理人报酬	-	-	-	235,730.49	235,730.49
应付托管费	-	-	-	47,146.09	47,146.09
应付交易费用	-	-	-	30,587.39	30,587.39
其他负债	-	-	-	385,472.36	385,472.36
负债总计	-	-	-	1,292,433.58	1,292,433.58
利率敏感度缺口	16,368,200.01	-	-	-561,501,054.43	577,869,254.44
上年度末 2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,362,620.90	-	-	-	12,362,620.90
交易性金融资产	-	-	-	452,982,103.67	452,982,103.67
应收利息	-	-	-	3,519.07	3,519.07
应收股利	-	-	-	2,498.64	2,498.64
资产总计	12,362,620.90	-	-	452,988,121.38	465,350,742.28
负债					
应付证券清算款	-	-	-	99.40	99.40
应付管理人报酬	-	-	-	204,790.05	204,790.05
应付托管费	-	-	-	40,958.01	40,958.01
应付交易费用	-	-	-	132,727.40	132,727.40
其他负债	-	-	-	165,484.98	165,484.98
负债总计	-	-	-	544,059.84	544,059.84
利率敏感度缺口	12,362,620.90	-	-	-452,444,061.54	464,806,682.44

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2019年12月31日			
	美元 折合人 民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人 民币	合计
以外币 计价的 资产				
交易性 金融资 产	-	562,707,097.20	-	562,707,097.20
资产合 计	-	562,707,097.20	-	562,707,097.20
以外币 计价的 负债				
-	-	-	-	-
负债合 计	-	-	-	-
资产负	-	562,707,097.20	-	562,707,097.20



债表外 汇风险 敞口净 额				
	上年度末 2018 年 12 月 31 日			
项目	美元 折合人民 币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民 币	合计
以外币 计价的 资产				
交易性 金融资 产	-	452,982,103.67	-	452,982,103.67
资产合 计	-	452,982,103.67	-	452,982,103.67
以外币 计价的 负债				
-	-	-	-	-
负债合 计	-	-	-	-
资产负 债表外 汇风险 敞口净 额	-	452,982,103.67	-	452,982,103.67

#### 7.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率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12月31日）	上年度末（2018年12月31日）
	所有外币相对于人民币升值5%	28,135,354.86	22,649,105.18
	所有外币相对于人民币贬值5%	-28,135,354.86	-22,649,105.18

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票、债券及基金，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。

本基金为被动式指数基金，采用指数复制法。投资于标的指数成份股、备选成份股的资产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%。本基金按照成份股在标的指数中的基准权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整，在保持基金资产的流动性前提下，达到有效复制标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在0.35%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日		上年度末 2018年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	562,707,097.20	97.38	452,982,103.67	97.46
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	562,707,097.20	97.38	452,982,103.67	97.46

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设除汇率外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12月31日)	上年度末(2018年12月31日)
	所有外币相对于人民币升值5%	24,827,447.84	17,755,482.04
所有外币相对于人民币贬值5%	-24,827,447.84	-17,755,482.04	

本基金业绩比较基准为恒生中国企业指数收益率(经汇率调整)。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2019年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为562,707,097.20元,无属于第二或第三层次的余额(2018年12月31日:第一层次452,982,103.67元,无第二或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2019 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 基金申购款

于 2019 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 52,076,102.21 元(2018 年 9 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间：无)，均为以现金支付的申购款(2018 年 9 月 21 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间：无)。

(3) 其他

除公允价值和基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	562,707,097.20	97.16
	其中：股票	562,707,097.20	97.16
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	16,368,200.01	2.83
8	其他各项资产	86,390.81	0.01
9	合计	579,161,688.02	100.00

注：本基金本报告期末通过深港通交易机制投资的港股市值为人民币 562,707,097.20 元，占基金资产净值比例 97.38%。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末持有境内股票。

#### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末持有境内股票。

#### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例 (%)
A 基础材料	6,792,520.58	1.18
B 消费者非必需品	26,918,582.16	4.66
C 消费者常用品	14,586,867.70	2.52
D 能源	46,796,954.11	8.10
E 金融	261,411,269.54	45.24
F 医疗保健	19,017,375.18	3.29
G 工业	15,295,974.36	2.65
H 信息技术	-	-
I 电信服务	109,654,599.12	18.98
J 公用事业	20,728,880.67	3.59
K 房地产	41,504,073.78	7.18

合计	562,707,097.20	97.38
----	----------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	00700	腾讯控股	175,907	59,184,784.06	10.24
2	00939	建设银行	9,391,170	56,615,601.83	9.80
3	02318	中国平安	604,016	49,832,128.17	8.62
4	01398	工商银行	7,982,136	42,901,426.72	7.42
5	00941	中国移动	664,503	38,988,776.58	6.75
6	03988	中国银行	8,595,090	25,638,701.37	4.44
7	00883	中国海洋石油	1,932,008	22,429,277.48	3.88
8	02628	中国人寿	805,013	15,612,129.90	2.70
9	03968	招商银行	422,010	15,140,026.12	2.62
10	00386	中国石油化工股份	2,622,005	11,015,588.91	1.91
11	01918	融创中国	264,000	11,008,419.58	1.91
12	01109	华润置地	300,000	10,426,879.20	1.80
13	01288	农业银行	2,992,004	9,193,008.29	1.59
14	02007	碧桂园	820,011	9,167,177.18	1.59
15	02313	申洲国际	89,401	9,121,525.20	1.58
16	01093	石药集团	506,000	8,421,657.75	1.46
17	00175	吉利汽车	591,000	8,068,147.14	1.40
18	00857	中国石油股份	2,282,006	7,992,725.56	1.38
19	02601	中国太保	285,200	7,843,127.20	1.36
20	00788	中国铁塔	4,794,050	7,386,392.27	1.28
21	00267	中信股份	787,003	7,345,907.72	1.27
22	01177	中国生物制药	749,002	7,313,257.03	1.27
23	02020	安踏体育	117,000	7,310,236.64	1.27
24	00291	华润啤酒	176,000	6,795,028.77	1.18
25	00914	海螺水泥	133,500	6,792,520.58	1.18
26	02688	新奥能源	85,200	6,498,686.83	1.12
27	00960	龙湖集团	193,500	6,326,670.20	1.09
28	02328	中国财险	746,034	6,275,171.14	1.09
29	00384	中国燃气	225,807	5,906,383.12	1.02
30	01088	中国神华	367,500	5,359,362.16	0.93

31	01658	邮储银行	1,074,000	5,098,958.92	0.88
32	03328	交通银行	947,000	4,699,602.28	0.81
33	00270	粤海投资	318,003	4,643,229.86	0.80
34	02202	万科企业	153,600	4,574,927.62	0.79
35	00998	中信银行	1,045,012	4,371,590.97	0.76
36	00728	中国电信	1,424,000	4,094,646.21	0.71
37	00151	中国旺旺	604,002	3,938,865.20	0.68
38	01044	恒安国际	77,500	3,852,973.73	0.67
39	01988	民生银行	719,501	3,796,191.03	0.66
40	01193	华润燃气	96,000	3,680,580.86	0.64
41	06030	中信证券	209,500	3,336,699.88	0.58
42	01099	国药控股	128,800	3,282,460.40	0.57
43	00966	中国太平	175,004	3,028,701.41	0.52
44	00656	复星国际	277,001	2,818,779.02	0.49
45	06837	海通证券	332,000	2,739,044.42	0.47
46	01800	中国交通建设	479,000	2,724,649.24	0.47
47	01336	新华保险	89,500	2,685,772.39	0.46
48	01339	中国人民保险集团	897,000	2,603,387.50	0.45
49	01211	比亚迪股份	69,500	2,418,673.18	0.42
50	01766	中国中车	473,000	2,406,638.38	0.42

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 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	00700	腾讯控股	17,773,984.55	3.82
2	00941	中国移动	15,365,544.85	3.31
3	00939	建设银行	11,204,241.44	2.41
4	02007	碧桂园	8,885,464.68	1.91
5	01918	融创中国	8,090,108.51	1.74
6	00883	中国海洋石油	7,545,595.32	1.62
7	01398	工商银行	7,543,572.76	1.62

8	02318	中国平安	7,334,880.47	1.58
9	00175	吉利汽车	7,236,728.20	1.56
10	01177	中国生物制药	6,962,647.57	1.50
11	02688	新奥能源	6,034,312.68	1.30
12	00291	华润啤酒	5,764,492.20	1.24
13	02020	安踏体育	5,711,531.50	1.23
14	00960	龙湖集团	5,378,260.78	1.16
15	03988	中国银行	4,105,408.56	0.88
16	01193	华润燃气	3,726,178.40	0.80
17	00151	中国旺旺	3,486,511.81	0.75
18	00267	中信股份	3,455,599.99	0.74
19	02313	申洲国际	3,234,876.05	0.70
20	00966	中国太平	2,948,061.89	0.63

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

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	02318	中国平安	14,014,876.46	3.02
2	01398	工商银行	13,673,846.08	2.94
3	03988	中国银行	8,096,473.63	1.74
4	00941	中国移动	6,853,095.91	1.47
5	00700	腾讯控股	6,007,432.01	1.29
6	00939	建设银行	4,975,727.38	1.07
7	00386	中国石油化工股份	4,852,742.75	1.04
8	02628	中国人寿	4,225,018.86	0.91
9	03968	招商银行	4,098,096.01	0.88
10	00883	中国海洋石油	3,638,643.31	0.78
11	03323	中国建材	3,087,827.92	0.66
12	02238	广汽集团	2,853,779.10	0.61
13	00857	中国石油股份	2,839,300.75	0.61
14	01288	农业银行	2,819,060.08	0.61
15	01816	中广核电力	2,650,127.34	0.57
16	06886	HTSC	2,559,911.71	0.55
17	00489	东风集团股份	2,540,336.83	0.55
18	00390	中国中铁	2,488,658.63	0.54



19	00788	中国铁塔	2,409,336.48	0.52
20	02601	中国太保	2,311,999.23	0.50

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

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	179,761,406.48
卖出股票收入（成交）总额	137,071,166.50

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

## 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末无债券投资情况。

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末无债券投资情况。

## 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本组合投资的前十名证券之一招商银行，因未依法履行其他职责，全国银行间同业拆借中心于 2019 年 7 月 8 日依据相关法规给予内部通报批评处分决定。

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份股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

#### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

本基金投资前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	83,284.30
4	应收利息	3,106.51
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,390.81

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### **8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

#### **8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### **8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末无积极投资股票。

### **8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 本基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
624	863, 099. 29	526, 552, 566. 00	97. 77%	12, 021, 394. 00	2. 23%

### 9.2 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	中国平安人寿保险股份有限公司-分 红-个险分红	499, 563, 366. 00	92. 76%
2	工银瑞信添祥混合型养老金产品-中 国工商银行股份有限公司	22, 850, 200. 00	4. 24%
3	中国国际金融股份有限公司	2, 962, 600. 00	0. 55%
4	卢伟军	2, 599, 100. 00	0. 48%
5	招商证券股份有限公司	950, 800. 00	0. 18%
6	黄晓玲	602, 100. 00	0. 11%
7	李富	572, 300. 00	0. 11%
8	张炜	534, 400. 00	0. 10%
9	杨耀庭	462, 400. 00	0. 09%
10	李萍	382, 900. 00	0. 07%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

### 9.4 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

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2018年9月21日）基金份额总额	510,573,960.00
本报告期期初基金份额总额	503,573,960.00
本报告期基金总申购份额	51,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	538,573,960.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2019 年 5 月，陈四清先生因工作调动，辞去中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

2、2019 年 6 月，刘连舸先生任中国银行股份有限公司董事长职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

3、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。

4、2019 年 8 月 19 日，付强先生因工作调动，辞去平安基金管理有限公司副总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 66,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	2	316,832,572.98	100.00%	158,417.17	100.00%	-
中投证券	1	-	-	-	-	-
中航证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	3	-	-	-	-	新增 2 个
中泰证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
申万证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
华信证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	新增

## 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。其中东方证券的一个席位作为申赎本基金的专用席位。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
中投证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
申万证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
华信证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-



东方证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-

本基金租用的证券公司交易单元本期无其他证券投资。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年1月18日
4	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
5	关于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增加申购赎回代办券商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月22日
6	平安基金管理有限公司旗下开放式基金转换业务规则说明的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年2月27日
7	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 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	平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月19日
9	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招募说明书更新（2019年第1期）-正文	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月27日
10	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招募说明书更新（2019年第1期）摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019年4月27日
11	关于平安港股通恒生中国企业交	中国证监会指定报	2019年4月27日

	易型开放式指数证券投资基金 2019 年 4 月 29 日起暂停申购、赎回业务的公告	刊及网站	
12	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
13	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	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 6 月 18 日
14	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
15	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
16	关于子公司深圳平安大华汇通财富管理有限公司名称变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 9 日
17	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 2019 年第 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 16 日
18	关于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暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 31 日
19	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 8 月 20 日
20	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 2019 年半年度报告（摘要）	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 8 月 23 日
21	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 2019 年半年度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 8 月 23 日
22	关于旗下基金新增中信证券（山东）有限责任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 9 月 2 日
23	关于旗下基金新增西藏东方财富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 10 月 11 日
24	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招募说明书更新以及摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 10 月 19 日
25	平安基金管理有限公司关于旗下深市 ETF 调整结算模式的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 10 月 19 日
26	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 2019 年第 3 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 10 月 25 日

27	关于旗下基金新增海通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10月25日
28	关于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变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月5日
29	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招募说明书更新	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月5日
30	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招募说明书更新（摘要）	中国证监会指定报刊及网站	2019年11月5日
31	关于旗下 21 只基金根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修订相关法律文件的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月21日
32	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托管协议	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月21日
33	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招募说明书更新摘要（2019年12月）	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月21日
34	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合同	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月21日
35	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招募说明书更新（2019年12月）	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月21日
36	关于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 2019 年 12 月 24 日起暂停申购、赎回业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月24日
37	关于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 2019 年底及 2020 年非港股通交易日暂停相关交易的公告	中国证监会指定报刊及网站	2019年12月31日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/01/01--2019/12/31	500,165,666.00	0.00	602,300.00	499,563,366.00	92.76%
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>							

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准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设立的文件；
- 2、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合同；
- 3、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托管协议；
- 4、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、报告期内在指定报刊以及指定网站上披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 13.3 查阅方式

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

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

平安基金管理有限公司

2020 年 4 月 28 日