

# 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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 4 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 4 月 29 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	17
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	18
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>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	54
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	54
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.....	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	70
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.....	71
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.....	71
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.....	71
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.....	71
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	71
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	71
8.12 投资组合报告附注.....	71
<b>§9 基金份额持有人信息.....</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.3 期末上市基金前十名持有人.....	74
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	75
<b>§10 开放式基金份额变动.....</b>	<b>76</b>
<b>§11 重大事件揭示.....</b>	<b>77</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	77
11.4 基金投资策略的改变 .....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	77
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 .....	77
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	77
11.8 其他重大事件 .....	79
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>81</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 .....	81
<b>§13 备查文件目录.....</b>	<b>82</b>
13.1 备查文件目录 .....	82
13.2 存放地点 .....	82
13.3 查阅方式 .....	82

## § 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（扩位证券简称:平安 MSCI 国际 ETF）
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	158,337,704.00 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 年 7 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	MSCI 中国 A 股国际指数 (MSCI China A International Index) 收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为交易型开放式指数基金，采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	010-66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010)66105798
注册地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		518048	100140
法定代表人		罗春风	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 6 月 15 日(基金合同生效日)-2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	25,575,255.24	-8,159,797.28
本期利润	97,557,491.36	-58,175,859.06
加权平均基金份额本期利润	0.4337	-0.1543
本期加权平均净值利润率	41.88%	-16.75%
本期基金份额净值增长率	39.54%	-15.40%
3.1.2 期末数据和指标	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	17,508,924.11	-59,501,552.41
期末可供分配基金份额利润	0.1106	-0.1540
期末基金资产净值	186,923,343.00	326,836,151.59
期末基金份额净值	1.1805	0.8460
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	18.05%	-15.40%

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。

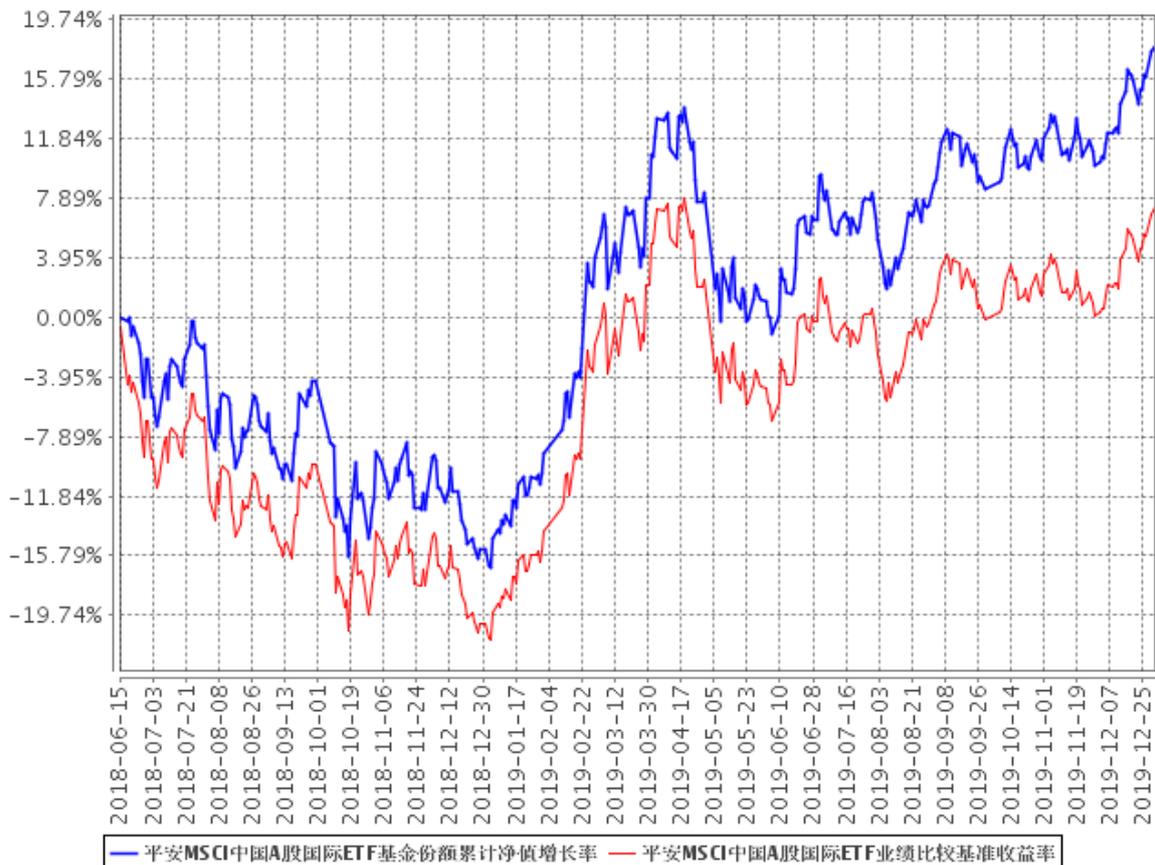
### 3.2 基金净值表现

#### 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	8.77%	0.73%	7.48%	0.73%	1.29%	0.00%
过去六个月	10.92%	0.84%	7.60%	0.85%	3.32%	-0.01%
过去一年	39.54%	1.21%	34.59%	1.23%	4.95%	-0.02%
自基金合同生效起至今	18.05%	1.31%	7.32%	1.34%	10.73%	-0.03%

### 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

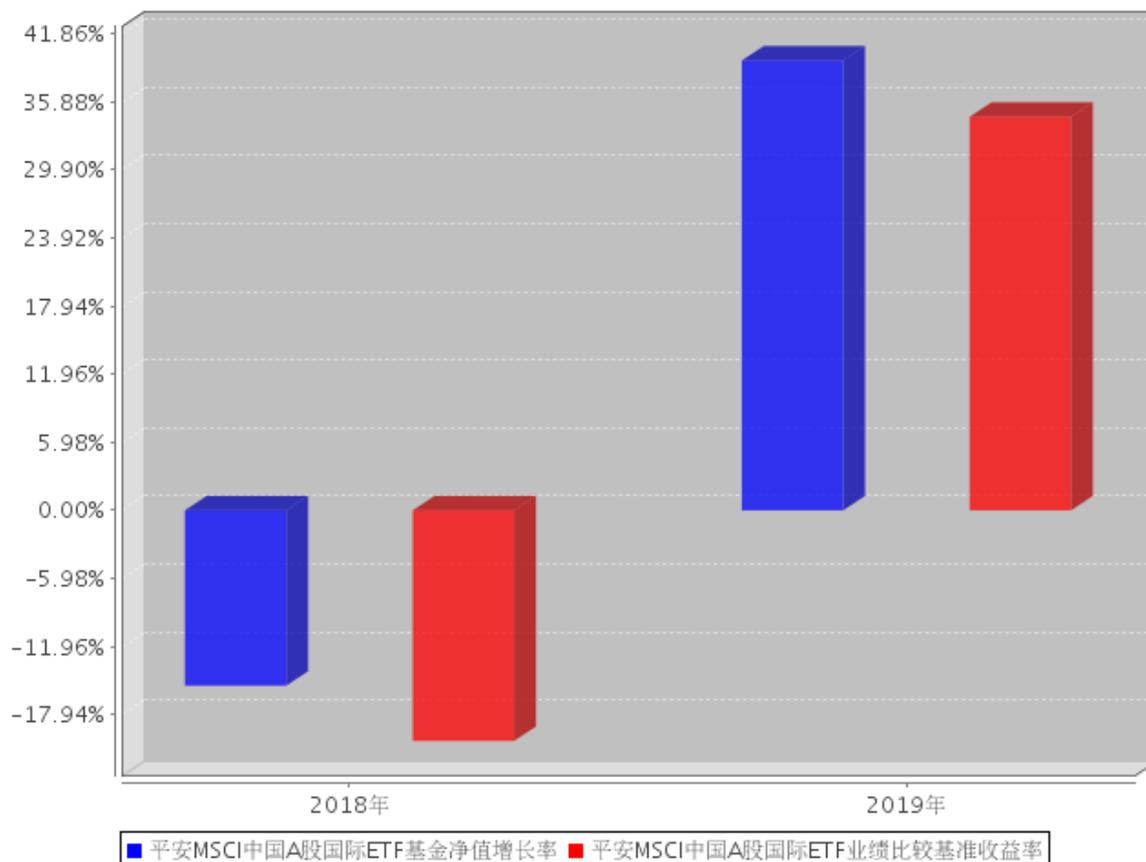
平安MSCI中国A股国际ETF基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



- 1、本基金基金合同于 2018 年 06 月 15 日正式生效；
- 2、按照本基金的基金合同规定，基金管理人应当自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的约定，截至报告期末本基金已完成建仓，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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

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



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

### 3.3 其他指标

本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 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		
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，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。
成钧	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理；资产配置事业部 ETF 指数中心指数投资总监	2018 年 6 月 15 日	-	9	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、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。
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，男，北京大学硕士，曾担任中国证券登记结算有限责任公司上海分公司基金业务经办岗。2017 年 7 月加入平安基金管理有限公司，任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究员。曾担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安 MSCI 中国 A 股低波动交易型开放式指数证券投资基金、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理助理。
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、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 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	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 MSCI	2019 年 7 月	-	2	董俊玲，女，同济大学硕士。

	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	22 日		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。
--	-------------------------------	------	--	--

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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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 0.03%，年化跟踪误差 0.83%，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 1.1805 元；本报告期基金份额净值增长率为 39.54%，业绩比较基准收益率为 34.59%。

## 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，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 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第 24378 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金 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	<p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	—
其他事项	—
其他信息	—
管理层和治理层对财务报表的责任	平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司(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

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

	<p>的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(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 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 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	4,224,783.78	1,719,634.41
结算备付金		159,486.78	121,725.98
存出保证金		13,792.45	103,049.74
交易性金融资产	7.4.7.2	184,070,263.89	325,323,162.46
其中：股票投资		184,070,263.89	325,323,162.46
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		13,215.87	74,068.99
应收利息	7.4.7.5	843.63	440.73
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	189,419.62	68,035.50
资产总计		188,671,806.02	327,410,117.81
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019 年 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		1,229,255.41	18,356.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		81,451.12	144,990.35
应付托管费		16,290.22	28,998.10
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	42,108.23	32,859.09
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	379,358.04	348,761.81
负债合计		1,748,463.02	573,966.22
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	158,337,704.00	386,337,704.00
未分配利润	7.4.7.10	28,585,639.00	-59,501,552.41
所有者权益合计		186,923,343.00	326,836,151.59
负债和所有者权益总计		188,671,806.02	327,410,117.81

注：报告截止日 2019 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1805 元，基金份额总额 158,337,704.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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 6 月 15 日(基 金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		100,062,976.61	-56,234,128.67
1.利息收入		24,844.72	154,485.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	24,784.99	138,805.70
债券利息收入		-	0.28
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		59.73	15,679.85
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		27,942,346.45	-6,553,622.65
其中：股票投资收益	7.4.7.12	23,596,916.85	-10,864,175.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	2.12
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	4,345,429.60	4,310,550.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	71,982,236.12	-50,016,061.78
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	113,549.32	181,069.93
<b>减：二、费用</b>		2,505,485.25	1,941,730.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,169,746.37	951,217.92
2. 托管费	7.4.10.2.2	233,949.23	190,243.66
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	378,556.28	471,861.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	723,233.37	328,407.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		97,557,491.36	-58,175,859.06
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		97,557,491.36	-58,175,859.06

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：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）	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）	-	97,557,491.36	97,557,491.36
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）	-228,000,000.00	-9,470,299.95	-237,470,299.95
其中：1.基金申购款	42,000,000.00	1,949,515.81	43,949,515.81
2.基金赎回款	-270,000,000.00	-11,419,815.76	-281,419,815.76
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	158,337,704.00	28,585,639.00	186,923,343.00

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 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
	金净值)		
一、期初所有者权益(基金净值)	323,337,704.00	-	323,337,704.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-58,175,859.06	-58,175,859.06
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	63,000,000.00	-1,325,693.35	61,674,306.65
其中：1. 基金申购款	225,000,000.00	-10,865,985.27	214,134,014.73
2. 基金赎回款	-162,000,000.00	9,540,291.92	-152,459,708.08
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	386,337,704.00	-59,501,552.41	326,836,151.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

                    罗春风  林婉文  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 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,其中网下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)。本基金的业绩比较基准为:MSCI 中国 A 股国际指数收益率。

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

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 MSCI 中国 A 股国际交易

型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 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 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

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

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

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

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指

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

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动

性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

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]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	4, 224, 783. 78	1, 719, 634. 41
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计：	4, 224, 783. 78	1, 719, 634. 41

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 12 月 31 日

	成本	公允价值	公允价值变动
股票	162,104,089.55	184,070,263.89	21,966,174.34
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	162,104,089.55	184,070,263.89	21,966,174.34
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	375,339,224.24	325,323,162.46	-50,016,061.78
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	375,339,224.24	325,323,162.46	-50,016,061.78

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(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均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均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

本基金本报告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	765.63	339.53
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	71.80	54.80
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	6.20	46.40
合计	843.63	440.73

## 7.4.7.6 其他资产

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
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
现金差额	189,419.62	68,035.50
合计	189,419.62	68,035.50

## 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	42,108.23	32,859.09
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	42,108.23	32,859.09

## 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	173,000.00	177,602.74
应付指数使用费	61,553.07	95,121.78
应付替代款	-	75,886.99
可退替代款	-	150.30
应退退补款	144,804.97	-
合计	379,358.04	348,761.81

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

## 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 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	386,337,704.00	386,337,704.00
本期申购	42,000,000.00	42,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-270,000,000.00	-270,000,000.00
- 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	158,337,704.00	158,337,704.00

## 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	-7,670,574.59	-51,830,977.82	-59,501,552.41
本期利润	25,575,255.24	71,982,236.12	97,557,491.36
本期基金份额交易产生的变动数	-395,756.54	-9,074,543.41	-9,470,299.95
其中：基金申购款	1,241,762.06	707,753.75	1,949,515.81

基金赎回款	-1,637,518.60	-9,782,297.16	-11,419,815.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,508,924.11	11,076,714.89	28,585,639.00

#### 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6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日
活期存款利息收入	23,234.28	64,645.63
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,178.39	5,630.98
其他	372.32	68,529.09
合计	24,784.99	138,805.70

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年6月15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	11,910,812.31	-6,336,604.93
股票投资收益——赎回差价收入	11,686,104.54	-4,527,570.38
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	23,596,916.85	-10,864,175.31

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年1月1日至2019年12月31日	2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日
卖出股票成交总额	159,950,954.47	77,845,766.58
减：卖出股票成本总额	148,040,142.16	84,182,371.51

买卖股票差价收入	11,910,812.31	-6,336,604.93
----------	---------------	---------------

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年12月31日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合 同生效日)至2018年12月31 日
赎回基金份额对价总额	281,419,815.76	152,459,708.08
减：现金支付赎回款总额	81,657,714.76	44,488,326.08
减：赎回股票成本总额	188,075,996.46	112,498,952.38
赎回差价收入	11,686,104.54	-4,527,570.38

#### 7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票申购差价收入。

#### 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收益-证券出借差价收入。

### 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

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

**7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年 12月31日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额	-	2,002.40
减:卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额	-	2,000.00
减:应收利息总额	-	0.28
买卖债券差价收入	-	2.12

**7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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。

**7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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**

本基金本报告期内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6月15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	4,345,429.60	4,310,550.54
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	4,345,429.60	4,310,550.54

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日
1. 交易性金融资产	71,982,236.12	-50,016,061.78
——股票投资	71,982,236.12	-50,016,061.78
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	71,982,236.12	-50,016,061.78

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为零（2018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6月15日(基金合同 生效日)至2018年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	113,549.32	181,069.93
合计	113,549.32	181,069.93

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

## 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31 日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效 日)至2018年12月31日
交易所市场交易费用	378,556.28	471,861.29
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	378,556.28	471,861.29

## 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6月15日(基金合同生 效日)至2018年12月31日
审计费用	53,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	95,000.00
证券出借违约金	-	-
登记结算费	300,000.00	-
上市费	60,000.00	55,000.00
银行汇划费	594.00	283.00
IOPV 计算费	50,000.00	22,602.74
指数使用费	139,639.37	95,121.78

其他	-	400.00
合计	723,233.37	328,407.52

#### 7.4.7.21 分部报告

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

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
工商银行	基金托管人
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
大华资产管理有限公司	基金管理人的股东
三亚盈湾旅业有限公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司	基金管理人的子公司
平安证券股份有限公司（“平安证券”）	基金管理人的股东的子公司、基金销售机构
中国平安保险（集团）股份有限公司	基金管理人的最终控股母公司
平安银行股份有限公司（“平安银行”）	与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日		上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至 2018年12月31日	
	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	72,302,202.38	29.41%	110,785,770.81	22.49%

#### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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。

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年1月1日至2019年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
平安证券	51,428.84	29.41%	3,266.88	7.76%
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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
平安证券	78,802.30	22.49%	12,476.07	37.97%

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

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

务等。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,169,746.37	951,217.92
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年12月31日	上年度可比期间 2018年6月15日(基金合同生效日)至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	233,949.23	190,243.66

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

无。

### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内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 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金	131,980,600.00	83.3539%	206,160,298.00	53.3627%

#### 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6月15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
工商银行	4,224,783.78	23,234.28	1,719,634.41	64,645.63

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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

(1) 于 2019 年 12 月 31 日，本基金持有 332,800 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,870,503.74 元，估值总额为人民币 1,956,864.00 元，占基金资产净值的比例为 1.05% (2018 年 12 月 31 日，本基金持有 939,600 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 5,258,707.61 元，估值总额为人民币 4,970,484.00 元，占基金资产净值的比例为 1.52%)。

(2)于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有 67,300 股中国平安的 A 股普通股,成本总额为人民币 4,553,562.06 元,估值总额为人民币 5,751,458.00 元,占基金资产净值的比例为 3.08% (2018 年 12 月 31 日,本基金持有 188,700 股中国平安的 A 股普通股,成本总额为人民币 11,632,743.68 元,估值总额为人民币 10,586,070.00 元,占基金资产净值的比例为 3.24%)。

(3)于 2019 年 12 月 31 日,本基金持有 105,900 股平安银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 1,153,341.24 元,估值总额为人民币 1,742,055.00 元,占基金资产净值的比例为 0.93% (2018 年 12 月 31 日,本基金持有 299,200 股平安银行的 A 股普通股,成本总额为人民币 2,900,330.73 元,估值总额为人民币 2,806,496.00 元,占基金资产净值的比例为 0.86%)。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末 (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

金额单位:人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002466	天齐锂业	2019 年 12 月 26 日	2020 年 1 月 3 日	配股未上市	8.75	30.18	2,280	19,950.00	68,810.40	-
688310	迈得医疗	2019 年 11 月 22 日	2020 年 6 月 3 日	新股锁定	24.79	27.12	3,276	81,212.04	88,845.12	-
688218	江苏北人	2019 年 11 月 29 日	2020 年 6 月 11 日	新股锁定	17.36	23.48	5,790	100,514.40	135,949.20	-

注: 1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》,本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的,锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2. 基金可使用以基金名义开设的股票账户,选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股,根据基金与上市公司所签订申购协议的规定,在新股上市后的约定期限内不能自由转让;基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股,从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603799	华友钴业	2019年12月31日	重大资产重组	39.39	2020年1月2日	40.43	6,698	287,703.33	263,834.22	-

注：本基金截至 2019 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险

可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### **7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

本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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

### 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、结算备付金，存出保证金等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	4,224,783.78	-	-	-	4,224,783.78
结算备付金	159,486.78	-	-	-	159,486.78
存出保证金	13,792.45	-	-	-	13,792.45
交易性金融资产	-	-	-	184,070,263.89	184,070,263.89
应收证券清算款	-	-	-	13,215.87	13,215.87
应收利息	-	-	-	843.63	843.63
其他资产	-	-	-	189,419.62	189,419.62
<b>资产总计</b>	<b>4,398,063.01</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>184,273,743.01</b>	<b>188,671,806.02</b>
<b>负债</b>					
应付证券清算款	-	-	-	1,229,255.41	1,229,255.41
应付管理人报酬	-	-	-	81,451.12	81,451.12
应付托管费	-	-	-	16,290.22	16,290.22
应付交易费用	-	-	-	42,108.23	42,108.23
其他负债	-	-	-	379,358.04	379,358.04
<b>负债总计</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>1,748,463.02</b>	<b>1,748,463.02</b>
<b>利率敏感度缺口</b>	<b>4,398,063.01</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-182,525,279.99</b>	<b>186,923,343.00</b>
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
<b>资产</b>					
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
<b>资产总计</b>	<b>1,944,410.13</b>	<b>-</b>	<b>-</b>	<b>-325,465,707.68</b>	<b>327,410,117.81</b>
<b>负债</b>					

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
应付证券清算款	-	-	-	18,356.87	18,356.87
负债总计	-	-	-	573,966.22	573,966.22
利率敏感度缺口	1,944,410.13	-	-	-324,891,741.46	326,836,151.59

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于报告期末，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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期指数成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金投资于 MSCI 中国 A 股国际指数 (MSCI China A International Index) 的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，本基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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 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	184,070,263.89	98.47	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	184,070,263.89	98.47	325,323,162.46	99.54

## 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 12 月 31 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准增加 5%	9,788,213.15	17,522,085.17
	业绩比较基准减少 5%	-9,788,213.15	-17,522,085.17

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

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于 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 183,512,824.95 元, 属于第二层次的余额为 557,438.94 元, 无属于第三层次的余额(2018 年 12 月 31 日: 第一层次 322,322,621.66 元, 第二层次 3,000,540.80 元, 无第三层次)。

(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 43,949,515.81 元(2018 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间: 214,134,014.73 元), 其中包括以股票支付的申购款 30,586,051.00 元和以现金支付的申购款 13,363,464.81 元(2018 年 6 月 15 日(基金合同生效日)至 2018 年 12 月 31 日止期间: 其中包括以股票支付的申购款 147,503,875.14 元和以现金支付的申购款 66,630,139.59 元)。

(3) 其他

除公允价值和基金申购款外, 截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	184,070,263.89	97.56
	其中：股票	184,070,263.89	97.56
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	4,384,270.56	2.32
8	其他各项资产	217,271.57	0.12
9	合计	188,671,806.02	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,436,392.40	1.30
B	采矿业	5,591,158.40	2.99
C	制造业	85,857,754.42	45.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,214,101.00	2.79
E	建筑业	4,505,322.80	2.41
F	批发和零售业	3,200,107.00	1.71
G	交通运输、仓储和邮政业	5,454,647.00	2.92
H	住宿和餐饮业	243,432.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,239,253.93	4.41
J	金融业	47,399,525.54	25.36
K	房地产业	8,475,013.00	4.53
L	租赁和商务服务业	2,225,771.15	1.19
M	科学研究和技术服务业	1,146,042.00	0.61

N	水利、环境和公共设施管理业	228,224.00	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,725,698.80	0.92
R	文化、体育和娱乐业	1,510,483.40	0.81
S	综合	276,800.00	0.15
	合计	183,729,726.84	98.29

### 8.2.2 期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	264,432.05	0.14
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	76,105.00	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	340,537.05	0.18

### 8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	7,900	9,345,700.00	5.00
2	601318	中国平安	67,300	5,751,458.00	3.08
3	600036	招商银行	128,200	4,817,756.00	2.58
4	000858	五粮液	24,100	3,205,541.00	1.71
5	601166	兴业银行	129,200	2,558,160.00	1.37
6	600900	长江电力	135,800	2,496,004.00	1.34
7	600276	恒瑞医药	27,356	2,394,197.12	1.28
8	600000	浦发银行	181,000	2,238,970.00	1.20
9	601398	工商银行	332,800	1,956,864.00	1.05
10	000002	万科A	59,900	1,927,582.00	1.03
11	002415	海康威视	57,637	1,887,035.38	1.01
12	000001	平安银行	105,900	1,742,055.00	0.93
13	601288	农业银行	459,500	1,695,555.00	0.91
14	600030	中信证券	60,700	1,535,710.00	0.82
15	603288	海天味业	13,800	1,483,638.00	0.79
16	601601	中国太保	38,800	1,468,192.00	0.79
17	601668	中国建筑	258,940	1,455,242.80	0.78
18	300750	宁德时代	13,500	1,436,400.00	0.77
19	600016	民生银行	218,900	1,381,259.00	0.74
20	601328	交通银行	242,100	1,363,023.00	0.73
21	600585	海螺水泥	24,600	1,348,080.00	0.72
22	000333	美的集团	21,421	1,247,773.25	0.67
23	000651	格力电器	18,500	1,213,230.00	0.65
24	002475	立讯精密	33,048	1,206,252.00	0.65
25	600048	保利地产	73,500	1,189,230.00	0.64
26	600887	伊利股份	37,700	1,166,438.00	0.62
27	600104	上汽集团	48,100	1,147,185.00	0.61
28	600050	中国联通	191,700	1,129,113.00	0.60
29	300498	温氏股份	32,800	1,102,080.00	0.59
30	600309	万华化学	19,300	1,084,081.00	0.58
31	601818	光大银行	245,500	1,082,655.00	0.58
32	601888	中国国旅	12,129	1,078,874.55	0.58
33	601766	中国中车	150,000	1,071,000.00	0.57

34	002304	洋河股份	9,300	1,027,650.00	0.55
35	002142	宁波银行	34,700	976,805.00	0.52
36	001979	招商蛇口	48,900	971,643.00	0.52
37	002714	牧原股份	10,760	955,380.40	0.51
38	000725	京东方 A	208,900	948,406.00	0.51
39	601688	华泰证券	45,300	920,043.00	0.49
40	600031	三一重工	51,600	879,780.00	0.47
41	601211	国泰君安	46,300	856,087.00	0.46
42	601229	上海银行	87,726	832,519.74	0.45
43	603259	药明康德	9,000	829,080.00	0.44
44	600028	中国石化	157,300	803,803.00	0.43
45	601988	中国银行	216,600	799,254.00	0.43
46	000568	泸州老窖	9,000	780,120.00	0.42
47	600837	海通证券	49,900	771,454.00	0.41
48	300015	爱尔眼科	19,020	752,431.20	0.40
49	601006	大秦铁路	91,600	752,036.00	0.40
50	000063	中兴通讯	21,200	750,268.00	0.40
51	601169	北京银行	130,400	740,672.00	0.40
52	601989	中国重工	141,300	740,412.00	0.40
53	600690	海尔智家	37,700	735,150.00	0.39
54	601186	中国铁建	71,000	719,940.00	0.39
55	000166	申万宏源	138,900	711,168.00	0.38
56	000538	云南白药	7,825	699,789.75	0.37
57	601390	中国中铁	115,000	683,100.00	0.37
58	600019	宝钢股份	114,700	658,378.00	0.35
59	300059	东方财富	41,500	654,455.00	0.35
60	600745	闻泰科技	7,000	647,500.00	0.35
61	600999	招商证券	35,300	645,637.00	0.35
62	601336	新华保险	13,000	638,950.00	0.34
63	600015	华夏银行	79,200	607,464.00	0.32
64	600406	国电南瑞	28,400	601,512.00	0.32
65	601628	中国人寿	17,200	599,764.00	0.32
66	000338	潍柴动力	37,000	587,560.00	0.31
67	601857	中国石油	100,000	583,000.00	0.31
68	600346	恒力石化	36,180	581,774.40	0.31
69	002024	苏宁易购	57,500	581,325.00	0.31
70	002027	分众传媒	90,460	566,279.60	0.30
71	601012	隆基股份	22,470	557,930.10	0.30
72	601899	紫金矿业	121,300	556,767.00	0.30

73	000776	广发证券	36,600	555,222.00	0.30
74	601155	新城控股	13,900	538,208.00	0.29
75	002594	比亚迪	11,200	533,904.00	0.29
76	600340	华夏幸福	18,400	528,080.00	0.28
77	601066	中信建投	17,200	522,880.00	0.28
78	600547	山东黄金	16,020	522,572.40	0.28
79	000876	新希望	26,000	518,700.00	0.28
80	600919	江苏银行	71,200	515,488.00	0.28
81	600741	华域汽车	19,400	504,206.00	0.27
82	603501	韦尔股份	3,500	501,900.00	0.27
83	601088	中国神华	27,200	496,400.00	0.27
84	000895	双汇发展	17,000	493,510.00	0.26
85	000661	长春高新	1,100	491,700.00	0.26
86	600809	山西汾酒	5,400	484,380.00	0.26
87	603993	洛阳钼业	109,000	475,240.00	0.25
88	603160	汇顶科技	2,300	474,490.00	0.25
89	600009	上海机场	6,000	472,500.00	0.25
90	002230	科大讯飞	13,500	465,480.00	0.25
91	601225	陕西煤业	51,400	462,086.00	0.25
92	600703	三安光电	25,100	460,836.00	0.25
93	601009	南京银行	52,400	459,548.00	0.25
94	601933	永辉超市	59,200	446,368.00	0.24
95	601138	工业富联	24,400	445,788.00	0.24
96	601901	方正证券	50,700	439,569.00	0.24
97	300760	迈瑞医疗	2,400	436,560.00	0.23
98	600588	用友网络	15,300	434,520.00	0.23
99	601939	建设银行	59,400	429,462.00	0.23
100	600436	片仔癀	3,700	406,519.00	0.22
101	600383	金地集团	27,900	404,550.00	0.22
102	300122	智飞生物	8,100	402,246.00	0.22
103	601985	中国核电	80,100	400,500.00	0.21
104	002241	歌尔股份	20,000	398,400.00	0.21
105	600958	东方证券	36,800	395,968.00	0.21
106	000069	华侨城 A	50,500	393,395.00	0.21
107	603986	兆易创新	1,900	389,291.00	0.21
108	600570	恒生电子	4,940	383,986.20	0.21
109	600886	国投电力	41,800	383,724.00	0.21
110	600029	南方航空	53,200	381,976.00	0.20
111	002600	领益智造	35,100	380,835.00	0.20

112	000100	TCL 科技	83,700	374,139.00	0.20
113	002352	顺丰控股	10,000	371,900.00	0.20
114	600010	宝钢股份	281,600	371,712.00	0.20
115	002236	大华股份	18,400	365,792.00	0.20
116	300003	乐普医疗	11,000	363,880.00	0.19
117	601877	正泰电器	13,200	353,760.00	0.19
118	002311	海大集团	9,700	349,200.00	0.19
119	300033	同花顺	3,200	349,152.00	0.19
120	002624	完美世界	7,900	348,706.00	0.19
121	600606	绿地控股	50,000	347,500.00	0.19
122	002555	三七互娱	12,900	347,397.00	0.19
123	002044	美年健康	23,140	344,554.60	0.18
124	300601	康泰生物	3,900	342,381.00	0.18
125	601669	中国电建	78,700	341,558.00	0.18
126	600115	东方航空	57,600	334,656.00	0.18
127	600196	复星医药	12,500	332,500.00	0.18
128	000938	紫光股份	10,484	331,294.40	0.18
129	600061	国投资本	21,700	328,538.00	0.18
130	002493	荣盛石化	25,900	320,901.00	0.17
131	300413	芒果超媒	9,140	319,534.40	0.17
132	002736	国信证券	25,300	317,515.00	0.17
133	601788	光大证券	24,000	314,400.00	0.17
134	600438	通威股份	23,900	313,807.00	0.17
135	000596	古井贡酒	2,300	312,616.00	0.17
136	300124	汇川技术	10,200	312,528.00	0.17
137	601872	招商轮船	37,500	309,750.00	0.17
138	300142	沃森生物	9,500	308,180.00	0.16
139	601618	中国中冶	109,900	307,720.00	0.16
140	002001	新 和 成	13,200	307,032.00	0.16
141	600332	白云山	8,600	306,246.00	0.16
142	002120	韵达股份	9,100	303,030.00	0.16
143	600018	上港集团	52,500	302,925.00	0.16
144	002007	华兰生物	8,600	302,290.00	0.16
145	300014	亿纬锂能	6,000	300,960.00	0.16
146	600893	航发动力	13,789	298,945.52	0.16
147	600660	福耀玻璃	12,400	297,476.00	0.16
148	002050	三花智控	17,150	297,209.50	0.16
149	601377	兴业证券	41,400	293,112.00	0.16
150	600183	生益科技	14,000	292,880.00	0.16

151	002466	天齐锂业	9,680	292,142.40	0.16
152	300347	泰格医药	4,600	290,490.00	0.16
153	600352	浙江龙盛	20,000	289,400.00	0.15
154	600926	杭州银行	31,580	289,272.80	0.15
155	601600	中国铝业	80,600	285,324.00	0.15
156	600795	国电电力	121,100	283,374.00	0.15
157	000066	中国长城	18,100	281,636.00	0.15
158	000768	中航飞机	17,100	280,098.00	0.15
159	300433	蓝思科技	20,200	279,164.00	0.15
160	603899	晨光文具	5,700	277,818.00	0.15
161	002916	深南电路	1,940	275,674.00	0.15
162	300144	宋城演艺	8,900	275,099.00	0.15
163	300136	信维通信	6,000	272,280.00	0.15
164	600674	川投能源	27,300	268,905.00	0.14
165	601100	恒立液压	5,400	268,650.00	0.14
166	600705	中航资本	55,200	267,720.00	0.14
167	600271	航天信息	11,500	266,455.00	0.14
168	000425	徐工机械	48,400	264,748.00	0.14
169	000786	北新建材	10,400	264,680.00	0.14
170	000157	中联重科	39,600	264,528.00	0.14
171	603799	华友钴业	6,698	263,834.22	0.14
172	002146	荣盛发展	26,800	263,444.00	0.14
173	000963	华东医药	10,800	263,304.00	0.14
174	002456	欧菲光	16,800	262,080.00	0.14
175	601990	南京证券	20,300	262,073.00	0.14
176	002179	中航光电	6,550	255,843.00	0.14
177	002202	金风科技	21,400	255,730.00	0.14
178	603369	今世缘	7,800	255,216.00	0.14
179	002371	北方华创	2,900	255,200.00	0.14
180	000656	金科股份	33,100	254,208.00	0.14
181	002032	苏泊尔	3,300	253,374.00	0.14
182	601108	财通证券	22,100	250,614.00	0.13
183	601021	春秋航空	5,700	250,173.00	0.13
184	601727	上海电气	50,200	249,996.00	0.13
185	000703	恒逸石化	17,600	244,992.00	0.13
186	600111	北方稀土	22,600	244,984.00	0.13
187	002157	正邦科技	15,100	244,620.00	0.13
188	000783	长江证券	34,000	242,760.00	0.13
189	300450	先导智能	5,400	242,676.00	0.13

190	000961	中南建设	23,000	242,650.00	0.13
191	002271	东方雨虹	9,200	242,052.00	0.13
192	000625	长安汽车	24,000	240,720.00	0.13
193	000860	顺鑫农业	4,550	239,694.00	0.13
194	601658	邮储银行	40,900	239,674.00	0.13
195	300408	三环集团	10,700	238,396.00	0.13
196	002410	广联达	7,000	237,860.00	0.13
197	000977	浪潮信息	7,900	237,790.00	0.13
198	000723	美锦能源	25,200	237,636.00	0.13
199	601111	中国国航	24,500	237,405.00	0.13
200	002460	赣锋锂业	6,800	236,844.00	0.13
201	600085	同仁堂	8,400	236,712.00	0.13
202	600176	中国巨石	21,600	235,440.00	0.13
203	002463	沪电股份	10,600	235,426.00	0.13
204	002739	万达电影	12,900	234,135.00	0.13
205	002384	东山精密	9,900	229,185.00	0.12
206	300454	深信服	2,000	228,780.00	0.12
207	600004	白云机场	12,900	225,105.00	0.12
208	601198	东兴证券	17,100	224,694.00	0.12
209	600023	浙能电力	55,800	220,968.00	0.12
210	600801	华新水泥	8,280	218,840.40	0.12
211	601607	上海医药	11,900	218,603.00	0.12
212	600362	江西铜业	12,900	218,397.00	0.12
213	002353	杰瑞股份	5,900	218,064.00	0.12
214	600584	长电科技	9,900	217,602.00	0.12
215	002180	纳思达	6,600	217,272.00	0.12
216	300628	亿联网络	3,000	217,230.00	0.12
217	601998	中信银行	35,000	215,950.00	0.12
218	600177	雅戈尔	30,940	215,651.80	0.12
219	600536	中国软件	3,000	215,070.00	0.12
220	000627	天茂集团	30,500	214,720.00	0.11
221	002153	石基信息	5,500	214,500.00	0.11
222	600600	青岛啤酒	4,200	214,200.00	0.11
223	300251	光线传媒	18,100	213,580.00	0.11
224	002673	西部证券	21,700	212,660.00	0.11
225	000671	阳光城	24,800	210,800.00	0.11
226	600482	中国动力	10,500	210,000.00	0.11
227	601919	中远海控	39,800	209,746.00	0.11
228	000050	深天马 A	12,700	206,883.00	0.11

229	002422	科伦药业	8,800	206,712.00	0.11
230	601018	宁波港	54,300	206,340.00	0.11
231	002812	恩捷股份	4,080	206,040.00	0.11
232	300782	卓胜微	500	205,185.00	0.11
233	600516	方大炭素	16,791	204,178.56	0.11
234	002129	中环股份	17,200	203,132.00	0.11
235	600583	海油工程	27,500	202,950.00	0.11
236	601838	成都银行	22,300	202,261.00	0.11
237	600208	新湖中宝	53,200	201,096.00	0.11
238	600498	烽火通信	7,300	200,385.00	0.11
239	002508	老板电器	5,900	199,479.00	0.11
240	600426	华鲁恒升	10,000	198,700.00	0.11
241	600637	东方明珠	21,190	198,338.40	0.11
242	002065	东华软件	19,200	198,144.00	0.11
243	603589	口子窖	3,600	197,676.00	0.11
244	601117	中国化学	30,400	195,776.00	0.10
245	002405	四维图新	12,150	195,615.00	0.10
246	002601	龙鳞佰利	12,700	195,453.00	0.10
247	600066	宇通客车	13,700	195,225.00	0.10
248	600763	通策医疗	1,900	194,807.00	0.10
249	600170	上海建工	55,000	194,700.00	0.10
250	002821	凯莱英	1,500	194,250.00	0.10
251	000999	华润三九	6,100	193,248.00	0.10
252	600487	亨通光电	11,860	192,843.60	0.10
253	600872	中炬高新	4,900	192,815.00	0.10
254	601360	三六零	8,200	192,782.00	0.10
255	603019	中科曙光	5,560	192,264.80	0.10
256	000728	国元证券	20,700	191,889.00	0.10
257	601878	浙商证券	17,200	191,436.00	0.10
258	601992	金隅集团	51,200	190,976.00	0.10
259	600068	葛洲坝	28,500	190,380.00	0.10
260	601997	贵阳银行	19,900	190,244.00	0.10
261	600673	东阳光	18,500	189,440.00	0.10
262	002439	启明星辰	5,600	189,280.00	0.10
263	603156	养元饮品	6,500	188,695.00	0.10
264	300383	光环新网	9,400	188,658.00	0.10
265	002049	紫光国微	3,700	188,108.00	0.10
266	300308	中际旭创	3,600	187,740.00	0.10
267	603833	欧派家居	1,600	187,200.00	0.10

268	300207	欣旺达	9,500	185,440.00	0.10
269	002506	协鑫集成	31,300	184,983.00	0.10
270	601555	东吴证券	18,500	184,815.00	0.10
271	600760	中航沈飞	5,800	183,280.00	0.10
272	600150	中国船舶	8,400	182,784.00	0.10
273	600489	中金黄金	21,400	181,472.00	0.10
274	600369	西南证券	34,900	181,131.00	0.10
275	600161	天坛生物	6,436	179,821.84	0.10
276	300529	健帆生物	2,500	179,600.00	0.10
277	002926	华西证券	16,300	179,463.00	0.10
278	002797	第一创业	21,500	178,020.00	0.10
279	600642	申能股份	30,100	174,881.00	0.09
280	600221	海航控股	100,800	174,384.00	0.09
281	600109	国金证券	18,600	172,980.00	0.09
282	601966	玲珑轮胎	7,500	171,975.00	0.09
283	600038	中直股份	3,600	171,756.00	0.09
284	600845	宝信软件	5,210	171,409.00	0.09
285	601231	环旭电子	8,900	171,147.00	0.09
286	601233	桐昆股份	11,400	170,886.00	0.09
287	601238	广汽集团	14,600	170,674.00	0.09
288	000709	河钢股份	65,800	169,764.00	0.09
289	000975	银泰黄金	12,300	167,403.00	0.09
290	002773	康弘药业	4,500	166,365.00	0.09
291	600219	南山铝业	74,230	166,275.20	0.09
292	002127	南极电商	15,200	165,832.00	0.09
293	300676	华大基因	2,400	164,880.00	0.09
294	600704	物产中大	31,400	164,850.00	0.09
295	002373	千方科技	9,100	164,164.00	0.09
296	600998	九州通	11,600	164,140.00	0.09
297	600909	华安证券	22,400	163,520.00	0.09
298	600011	华能国际	29,300	163,494.00	0.09
299	601216	君正集团	52,100	163,073.00	0.09
300	600297	广汇汽车	50,000	163,000.00	0.09
301	603517	绝味食品	3,500	162,575.00	0.09
302	603939	益丰药房	2,200	161,084.00	0.09
303	600188	兖州煤业	15,200	160,512.00	0.09
304	600100	同方股份	18,300	160,491.00	0.09
305	002690	美亚光电	4,100	160,310.00	0.09
306	601099	太平洋	42,200	159,938.00	0.09

307	300146	汤臣倍健	9,800	159,642.00	0.09
308	600867	通化东宝	12,600	159,390.00	0.09
309	600885	宏发股份	4,600	158,470.00	0.08
310	600153	建发股份	17,600	158,224.00	0.08
311	600118	中国卫星	7,400	158,138.00	0.08
312	300558	贝达药业	2,400	157,680.00	0.08
313	600528	中铁工业	13,700	157,550.00	0.08
314	002078	太阳纸业	16,000	157,440.00	0.08
315	600875	东方电气	17,100	157,149.00	0.08
316	600298	安琪酵母	5,100	156,417.00	0.08
317	600522	中天科技	18,800	156,040.00	0.08
318	600655	豫园股份	19,900	156,016.00	0.08
319	000629	攀钢钒钛	53,100	155,052.00	0.08
320	601800	中国交建	16,900	154,804.00	0.08
321	002013	中航机电	22,300	154,762.00	0.08
322	603658	安图生物	1,600	154,208.00	0.08
323	600027	华电国际	42,000	154,140.00	0.08
324	002299	圣农发展	6,400	154,112.00	0.08
325	601128	常熟银行	16,900	153,959.00	0.08
326	002465	海格通信	14,124	152,962.92	0.08
327	600089	特变电工	23,000	152,950.00	0.08
328	300012	华测检测	10,200	152,082.00	0.08
329	601799	星宇股份	1,600	151,968.00	0.08
330	000630	铜陵有色	65,100	151,683.00	0.08
331	600155	华创阳安	10,800	151,524.00	0.08
332	603885	吉祥航空	10,100	151,500.00	0.08
333	600132	重庆啤酒	2,900	150,684.00	0.08
334	600779	水井坊	2,900	150,075.00	0.08
335	600816	安信信托	33,800	150,072.00	0.08
336	002558	巨人网络	8,300	149,898.00	0.08
337	300253	卫宁健康	10,000	149,800.00	0.08
338	000402	金融街	18,400	149,408.00	0.08
339	603707	健友股份	3,600	149,328.00	0.08
340	603444	吉比特	500	149,245.00	0.08
341	300070	碧水源	19,400	147,440.00	0.08
342	002411	延安必康	9,400	146,922.00	0.08
343	600688	上海石化	37,900	146,673.00	0.08
344	603858	步长制药	7,076	145,907.12	0.08
345	000415	渤海租赁	38,300	145,540.00	0.08

346	002081	金螳螂	16,500	145,530.00	0.08
347	600895	张江高科	9,500	145,445.00	0.08
348	600739	辽宁成大	9,500	144,685.00	0.08
349	600977	中国电影	9,500	144,590.00	0.08
350	000031	大悦城	20,100	144,318.00	0.08
351	002500	山西证券	17,400	144,246.00	0.08
352	600989	宝丰能源	15,100	143,601.00	0.08
353	603882	金城医学	2,800	143,416.00	0.08
354	600535	天士力	9,300	143,406.00	0.08
355	002152	广电运通	14,900	143,189.00	0.08
356	603338	浙江鼎力	2,000	143,000.00	0.08
357	300017	网宿科技	15,000	142,950.00	0.08
358	000825	太钢不锈	34,900	142,741.00	0.08
359	002110	三钢闽光	15,200	142,272.00	0.08
360	000423	东阿阿胶	4,000	141,480.00	0.08
361	300357	我武生物	3,200	141,280.00	0.08
362	600699	均胜电子	7,880	141,052.00	0.08
363	300699	光威复材	3,100	141,050.00	0.08
364	603866	桃李面包	3,300	140,052.00	0.07
365	000750	国海证券	26,200	139,908.00	0.07
366	600521	华海药业	8,100	139,806.00	0.07
367	600398	海澜之家	18,200	139,776.00	0.07
368	002010	传化智联	20,000	139,600.00	0.07
369	000401	冀东水泥	8,200	139,482.00	0.07
370	600497	驰宏锌锗	31,600	138,408.00	0.07
371	600256	广汇能源	41,700	138,027.00	0.07
372	300285	国瓷材料	6,000	137,100.00	0.07
373	603000	人民网	6,900	136,551.00	0.07
374	600466	蓝光发展	18,500	136,345.00	0.07
375	000686	东北证券	14,500	134,850.00	0.07
376	300024	机器人	9,600	134,400.00	0.07
377	002268	卫士通	5,200	134,108.00	0.07
378	601098	中南传媒	11,200	133,728.00	0.07
379	601699	潞安环能	18,400	133,584.00	0.07
380	002387	维信诺	8,400	133,560.00	0.07
381	601958	金钼股份	16,600	132,966.00	0.07
382	600201	生物股份	7,040	131,788.80	0.07
383	002385	大北农	26,200	130,476.00	0.07
384	600415	小商品城	33,500	129,645.00	0.07

385	600021	上海电力	16,100	129,605.00	0.07
386	002372	伟星新材	9,760	128,539.20	0.07
387	002507	涪陵榨菜	4,800	128,304.00	0.07
388	600372	中航电子	9,000	128,160.00	0.07
389	002223	鱼跃医疗	6,300	128,016.00	0.07
390	002174	游族网络	5,500	127,985.00	0.07
391	600376	首开股份	16,000	127,520.00	0.07
392	000027	深圳能源	20,500	127,305.00	0.07
393	600315	上海家化	4,100	126,854.00	0.07
394	002399	海普瑞	6,500	126,815.00	0.07
395	600733	北汽蓝谷	21,700	126,728.00	0.07
396	601866	中远海发	48,700	126,133.00	0.07
397	600258	首旅酒店	6,100	125,721.00	0.07
398	600511	国药股份	4,600	125,534.00	0.07
399	002340	格林美	25,700	125,159.00	0.07
400	002019	亿帆医药	7,700	125,125.00	0.07
401	000932	华菱钢铁	26,140	124,949.20	0.07
402	600380	健康元	12,008	124,282.80	0.07
403	000089	深圳机场	12,700	124,079.00	0.07
404	000513	丽珠集团	3,678	123,948.60	0.07
405	600160	巨化股份	17,000	123,760.00	0.07
406	600460	士兰微	8,000	123,760.00	0.07
407	600486	扬农化工	1,800	123,534.00	0.07
408	601106	中国一重	42,400	123,384.00	0.07
409	600776	东方通信	5,900	122,897.00	0.07
410	600959	江苏有线	30,800	122,584.00	0.07
411	600968	海油发展	41,700	122,181.00	0.07
412	002281	光迅科技	4,100	122,098.00	0.07
413	002414	高德红外	5,800	121,800.00	0.07
414	600143	金发科技	16,700	121,576.00	0.07
415	300296	利亚德	15,800	121,186.00	0.06
416	600566	济川药业	5,000	120,900.00	0.06
417	000983	西山煤电	19,500	119,535.00	0.06
418	000623	吉林敖东	7,200	119,016.00	0.06
419	600754	锦江酒店	4,100	117,711.00	0.06
420	000998	隆平高科	8,000	117,680.00	0.06
421	002572	索菲亚	5,600	117,320.00	0.06
422	600820	隧道股份	19,300	116,572.00	0.06
423	600008	首创股份	35,200	115,808.00	0.06

424	601179	中国西电	31,800	115,752.00	0.06
425	600675	中华企业	24,880	115,692.00	0.06
426	600373	中文传媒	8,500	115,685.00	0.06
427	601598	中国外运	27,100	115,446.00	0.06
428	000413	东旭光电	34,300	115,248.00	0.06
429	002195	二三四五	35,631	115,088.13	0.06
430	000729	燕京啤酒	17,500	114,100.00	0.06
431	300595	欧普康视	2,400	113,592.00	0.06
432	600808	马钢股份	37,000	113,590.00	0.06
433	600549	厦门钨业	8,700	113,448.00	0.06
434	000883	湖北能源	27,000	112,590.00	0.06
435	600079	人福医药	8,300	112,133.00	0.06
436	600967	内蒙一机	10,478	111,381.14	0.06
437	002563	森马服饰	11,200	110,544.00	0.06
438	600737	中粮糖业	13,000	109,980.00	0.06
439	000898	鞍钢股份	32,730	109,645.50	0.06
440	600446	金证股份	5,300	109,074.00	0.06
441	002294	信立泰	5,400	107,676.00	0.06
442	000960	锡业股份	10,300	107,532.00	0.06
443	600567	山鹰纸业	28,500	107,445.00	0.06
444	600026	中远海能	16,800	107,184.00	0.06
445	600598	北大荒	11,000	107,140.00	0.06
446	002217	合力泰	19,300	107,115.00	0.06
447	601333	广深铁路	34,900	106,794.00	0.06
448	002074	国轩高科	7,100	103,305.00	0.06
449	000997	新大陆	6,500	103,220.00	0.06
450	603883	老百姓	1,600	102,528.00	0.05
451	000778	新兴铸管	24,500	102,165.00	0.05
452	600879	航天电子	16,900	101,062.00	0.05
453	600572	康恩贝	16,400	100,860.00	0.05
454	600782	新钢股份	19,500	100,035.00	0.05
455	000028	国药一致	2,200	99,792.00	0.05
456	600392	盛和资源	10,960	99,407.20	0.05
457	600863	内蒙华电	36,000	99,000.00	0.05
458	601168	西部矿业	14,800	97,976.00	0.05
459	600273	嘉化能源	8,700	97,875.00	0.05
460	000581	威孚高科	5,100	97,155.00	0.05
461	000046	泛海控股	21,200	96,460.00	0.05
462	601880	大连港	47,500	96,425.00	0.05

463	600339	中油工程	28,400	96,276.00	0.05
464	002583	海能达	11,400	95,874.00	0.05
465	601000	唐山港	36,600	95,160.00	0.05
466	600643	爱建集团	9,900	95,040.00	0.05
467	000060	中金岭南	22,000	94,600.00	0.05
468	000830	鲁西化工	9,000	94,590.00	0.05
469	000503	国新健康	5,500	94,160.00	0.05
470	000732	泰禾集团	15,300	94,095.00	0.05
471	600282	南钢股份	27,100	93,495.00	0.05
472	002603	以岭药业	7,500	93,225.00	0.05
473	002085	万丰奥威	13,300	93,100.00	0.05
474	000738	航发控制	7,100	92,797.00	0.05
475	000039	中集集团	9,440	92,700.80	0.05
476	000559	万向钱潮	17,100	91,827.00	0.05
477	300072	三聚环保	14,300	90,376.00	0.05
478	002124	天邦股份	7,200	90,360.00	0.05
479	600649	城投控股	15,700	89,804.00	0.05
480	601718	际华集团	27,400	89,324.00	0.05
481	600827	百联股份	9,900	88,902.00	0.05
482	600500	中化国际	16,740	88,722.00	0.05
483	002092	中泰化学	13,000	88,270.00	0.05
484	600718	东软集团	7,700	87,395.00	0.05
485	600777	新潮能源	41,600	87,360.00	0.05
486	600056	中国医药	6,600	86,130.00	0.05
487	600062	华润双鹤	6,540	85,347.00	0.05
488	000839	中信国安	24,080	85,243.20	0.05
489	600873	梅花生物	18,900	84,105.00	0.04
490	000598	兴蓉环境	18,100	83,803.00	0.04
491	002038	双鹭药业	6,350	83,502.50	0.04
492	600648	外高桥	4,800	83,376.00	0.04
493	600260	凯乐科技	6,120	83,048.40	0.04
494	600835	上海机电	5,000	82,850.00	0.04
495	600582	天地科技	25,600	81,664.00	0.04
496	603077	和邦生物	54,800	81,104.00	0.04
497	000826	启迪环境	8,800	80,784.00	0.04
498	002221	东华能源	10,100	78,376.00	0.04
499	600037	歌华有线	8,600	77,486.00	0.04
500	000681	视觉中国	4,300	74,132.00	0.04
501	002424	贵州百灵	8,500	74,035.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688218	江苏北人	5,790	135,949.20	0.07
2	688310	迈得医疗	3,276	88,845.12	0.05
3	600848	上海临港	3,100	76,105.00	0.04
4	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
5	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01

**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	600519	贵州茅台	3,052,818.18	0.93
2	300498	温氏股份	2,077,486.96	0.64
3	300750	宁德时代	1,365,873.00	0.42
4	600900	长江电力	1,333,253.27	0.41
5	000858	五粮液	1,154,649.00	0.35
6	600309	万华化学	1,131,571.70	0.35
7	603259	药明康德	1,049,238.00	0.32
8	601318	中国平安	976,000.00	0.30
9	601390	中国中铁	929,881.00	0.28
10	300015	爱尔眼科	927,688.00	0.28
11	300059	东方财富	885,668.40	0.27
12	300760	迈瑞医疗	873,651.00	0.27
13	002415	海康威视	835,009.00	0.26
14	600036	招商银行	742,717.00	0.23
15	000002	万科A	702,675.00	0.21
16	600745	闻泰科技	699,504.00	0.21
17	601600	中国铝业	691,370.00	0.21
18	002916	深南电路	679,818.60	0.21
19	688111	金山办公	672,261.74	0.21
20	600061	国投资本	646,762.00	0.20

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	5,176,470.00	1.58
2	000858	五粮液	5,016,136.63	1.53
3	002415	海康威视	4,255,965.32	1.30
4	000002	万科A	3,815,880.72	1.17
5	000001	平安银行	3,123,931.17	0.96
6	600519	贵州茅台	2,710,206.00	0.83
7	002304	洋河股份	2,349,009.27	0.72
8	000651	格力电器	2,143,113.00	0.66
9	688111	金山办公	1,935,056.60	0.59
10	001979	招商蛇口	1,872,763.92	0.57
11	000725	京东方A	1,835,221.00	0.56
12	601318	中国平安	1,815,221.00	0.56
13	600036	招商银行	1,537,908.00	0.47
14	002024	苏宁易购	1,537,437.00	0.47
15	002714	牧原股份	1,530,356.25	0.47
16	002475	立讯精密	1,496,060.61	0.46
17	002142	宁波银行	1,492,888.00	0.46
18	000063	中兴通讯	1,431,691.95	0.44
19	000166	申万宏源	1,405,089.52	0.43
20	000568	泸州老窖	1,351,426.56	0.41

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	92,476,679.37
卖出股票收入（成交）总额	159,950,954.47

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

本报告期末本基金未持有债券投资。

## 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。

### 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

### 8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货投资。

### 8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资

## 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。

本组合投资的前十名证券之一浦发银行，银保监会于 2019 年 6 月 24 日做出银保监罚决字（2019）7 号，由于上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“公司”）：（一）对成都分行授信业务及整改情况严重失察；（二）重大审计发现未向监管部门报告；（三）轮岗制度执行不力。根据相关规定对公司罚款 130 万元。

本组合投资的前十名证券之一兴业银行，北京银保监局于 2019 年 10 月 8 日做出京银保监罚

决字〔2019〕41号，由于兴业银行北京分行：违规向房地产开发企业提供融资、违规通过同业投资规避监管指标、违规修改理财协议文本、违规向企业权益性投资提供融资、违规向普通客户销售投向非上市公司股权的理财产品。根据相关规定责令兴业银行北京分行改正，并给予合计 600 万元罚款的行政处罚。

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	13,792.45
2	应收证券清算款	13,215.87
3	应收股利	-
4	应收利息	843.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	189,419.62
9	合计	217,271.57

### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限的情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688218	江苏北人	135,949.20	0.07	新股锁定
2	688310	迈得医疗	88,845.12	0.05	新股锁定

**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
630	251,329.69	134,620,093.00	85.02%	23,717,611.00	14.98%

### 9.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额（份）	占总份额比例
平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金	131,980,600.00	83.35%

### 9.3 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额 比例
1	广发证券股份有限公司	1,573,487.00	0.99%
2	张玉琴	1,365,724.00	0.86%
3	中信证券股份有限公司	1,044,708.00	0.66%
4	李莉	1,000,000.00	0.63%
5	徐思申	1,000,000.00	0.63%
6	王钦军	1,000,000.00	0.63%
7	韩立宾	875,800.00	0.55%
8	项陆海	500,000.00	0.32%
9	叶意琴	500,000.00	0.32%
10	徐诚	500,000.00	0.32%
11	中国工商银行股份有限公司-平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	131,980,600.00	83.35%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

无。

**9.5 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2018 年 6 月 15 日）基金份额总额	323,337,704.00
本报告期期初基金份额总额	386,337,704.00
本报告期基金总申购份额	42,000,000.00
减:本报告期基金总赎回份额	270,000,000.00
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	158,337,704.00

## § 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、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。
- 3、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 53,000.00 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	
东方证券	2	78,688,825.93	32.01%	55,970.93	32.00%	-

平安证券	2	72,302,202.38	29.41%	51,428.84	29.41%	-
招商证券	3	34,917,026.64	14.20%	24,836.62	14.20%	-
海通证券	4	24,358,316.36	9.91%	17,326.41	9.91%	-
广发证券	1	23,121,291.02	9.40%	16,446.10	9.40%	-
中泰证券	2	11,992,107.19	4.88%	8,529.96	4.88%	-
长城证券	2	482,620.17	0.20%	343.32	0.20%	新增 2 个
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
中信建投	2	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
爱建证券	2	-	-	-	-	-

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。

### 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
东方证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	1,000,000.00	100.00%	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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 4 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 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
8	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
9	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 1 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 4 月 19 日
10	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
11	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
12	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
13	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
14	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
15	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 2 季度报告	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 16 日
16	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	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 25 日

	书（2019 年第 1 期）		
17	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（2019 年第 1 期）摘要	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 7 月 25 日
18	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
19	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年半年度报告（摘要）	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 8 月 23 日
20	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	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 8 月 23 日
21	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增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 10 日
22	关于旗下 ETF 基金新增华泰证券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 9 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 MSCI 中国 A 股国际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
25	平安基金管理有限公司关于旗下部分基金网下获配首次公开发行股票的公告（迈得医疗）	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 11 月 28 日
26	关于旗下 12 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 27 日
27	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	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 12 月 27 日
28	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	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 12 月 27 日
29	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（2019 年 12 月）	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 12 月 27 日
30	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摘要（2019 年 12 月）	中国证监会指定报刊及网站	2019 年 12 月 27 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	2019/01/01--2019/12/31	206,160,298	121,016,302	195,196,000	131,980,600	83.3%
			.00	.00	.00	.00	5%
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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 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 30 日