

# 平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数 证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 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。本中期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 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 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>5</b>
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 其他指标 .....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	11
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 .....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
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 .....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 .....	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
6.1 资产负债表 .....	13
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	17
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 .....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	53

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	53
7.7 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 .....	53
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	53
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	53
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	53
7.12 投资组合报告附注 .....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>55</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	55
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>56</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	56
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	56
10.4 基金投资策略的改变 .....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
10.8 其他重大事件 .....	58
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录 .....	59
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## § 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
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	89,337,704.00 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
	联系电话	0755-22626828
	电子邮箱	fundservice@pingan.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
登载基金中期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>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年1月1日-2020年6月30日)
本期已实现收益	14,201,871.32
本期利润	9,825,399.08
加权平均基金份额本期利润	0.0831
本期加权平均净值利润率	7.10%
本期基金份额净值增长率	8.12%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	20,805,803.01
期末可供分配基金份额利润	0.2329
期末基金资产净值	114,030,262.31
期末基金份额净值	1.2764
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	27.64%

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

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

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

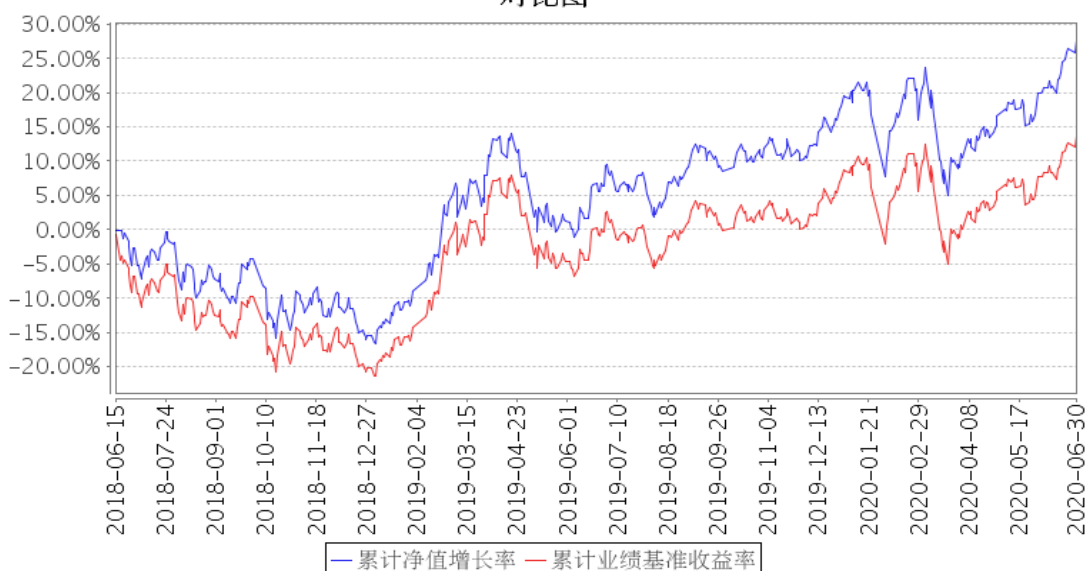
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.33%	0.86%	8.34%	0.87%	0.99%	-0.01%
过去三个月	16.51%	0.90%	14.50%	0.93%	2.01%	-0.03%
过去六个月	8.12%	1.50%	5.89%	1.53%	2.23%	-0.03%
过去一年	19.93%	1.20%	13.94%	1.22%	5.99%	-0.02%
自基金合同生效起至今	27.64%	1.36%	13.64%	1.39%	14.00%	-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 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



注：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。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

平安基金管理有限公司（以下简称“平安基金”）经中国证监会证监许可【2010】1917 号文批准设立。平安基金总部位于深圳，注册资本金为 13 亿元人民币。目前公司股东为平安信托有限责任公司，持有股权 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 2020 年 06 月 30 日，平安基金共管理 115 只公募基金，资产管理总规模约为 3,784 亿元人民币。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
成钧	ETF 指数中心指数投资总监，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	2018 年 6 月 15 日	-	9 年	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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中债-0-5年广东省地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金基金经理。
刘洁倩	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理	2018 年 10 月 16 日	2020 年 3 月 25 日	7 年	刘洁倩，浙江大学博士，曾担任国泰基金管理有限公司产品研究主管。2018 年 8 月加入平安基金管理有限公司，曾任资产配置事业部 ETF 指数投资中心指数研究员。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基金经理。
钱晶	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金经理	2019 年 2 月 28 日	-	9 年	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，曾任资产配置事业部 ETF 指数部投资经理。现担任 ETF 指数中心投资副总监，同时担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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
董俊玲	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助理	2019 年 7 月 22 日	-	2 年	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、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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。
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基金经理助理	2019 年 12 月 12 日	-	3 年	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、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、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。

注：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》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，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，本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。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

#### (1) 投资策略

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。

#### (2) 运作分析

报告期内，本基金的日均偏离度为 0.04%，年化跟踪误差 0.80%，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 1.2764 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.12%，业绩比较基准收益率为 5.89%。

#### 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 年下半年，中美贸易摩擦虽然仍有一定不确定性，但是边际影响下降。对比当前海外各国权益资产估值，A 股具备较高的吸引力，预计外资将继续流入国内市场。宏观方面，在“以国内大循环为主体、国内国际双循环相互促进”的指导下，国内经济转型进程或将加速，寻找并挖掘潜在的行业增长机会。货币政策方面，在经济未完全恢复之前，预计仍然会保持适当宽松，很难突然转向。综合考虑，我们对权益资产的前景仍保持谨慎乐观。

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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值工作组，由投研部、运营部及法律合规监察部相关人员组成。估值工作组负责公司基金估值政策、程序及方法的制定和修订，负责定期审议公司估值政策、程序及方法的科学合理性，保证基金估值的公平、合理。估值工作组的相关人员均具有一定年限的专业从业经验，具有良好的专业能力，并能在相关工作中保持独立性。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

本基金本报告期内未出现连续 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合规守信、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 托管人对本中期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 2020 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	4,578,541.14	4,224,783.78
结算备付金		74,687.23	159,486.78
存出保证金		10,394.33	13,792.45
交易性金融资产	6.4.7.2	109,971,633.91	184,070,263.89
其中：股票投资		109,971,633.91	184,070,263.89
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		264,423.86	13,215.87
应收利息	6.4.7.5	397.60	843.63
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,409.91	189,419.62
资产总计		114,975,487.98	188,671,806.02
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2020 年 6 月 30 日	2019 年 12 月 31 日
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		341,830.88	1,229,255.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		49,630.87	81,451.12
应付托管费		9,926.17	16,290.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	22,233.60	42,108.23
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	521,604.15	379,358.04
负债合计		945,225.67	1,748,463.02
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	89,337,704.00	158,337,704.00
未分配利润	6.4.7.10	24,692,558.31	28,585,639.00
所有者权益合计		114,030,262.31	186,923,343.00
负债和所有者权益总计		114,975,487.98	188,671,806.02

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2764 元，基金份额总额 89,337,704.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		10,628,158.26	77,553,605.23
1. 利息收入		11,230.13	11,181.88
其中：存款利息收入	6.4.7.11	11,230.13	11,122.15
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	59.73
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		14,820,723.43	11,613,112.37

列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	13,742,205.86	9,461,432.94
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收 益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,078,517.57	2,151,679.43
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-4,376,472.24	65,874,007.04
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	172,676.94	55,303.94
减：二、费用		802,759.18	1,321,159.30
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	346,624.54	657,276.12
2. 托管费	6.4.10.2.2	69,324.88	131,455.18
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	112,702.67	210,710.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	274,107.09	321,717.85
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,825,399.08	76,232,445.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,825,399.08	76,232,445.93

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	158,337,704.00	28,585,639.00	186,923,343.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期	-	9,825,399.08	9,825,399.08

利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-69,000,000.00	-13,718,479.77	-82,718,479.77
其中: 1. 基金申购款	3,000,000.00	272,126.56	3,272,126.56
2. 基金赎回款	-72,000,000.00	-13,990,606.33	-85,990,606.33
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)	89,337,704.00	24,692,558.31	114,030,262.31
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	386,337,704.00	-59,501,552.41	326,836,151.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	76,232,445.93	76,232,445.93
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-171,000,000.00	-2,874,166.98	-173,874,166.98
其中: 1. 基金申购款	27,000,000.00	517,541.75	27,517,541.75
2. 基金赎回款	-198,000,000.00	-3,391,708.73	-201,391,708.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	215,337,704.00	13,856,726.54	229,194,430.54



报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金(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。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	4,578,541.14
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	4,578,541.14

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	92,381,931.81	109,971,633.91	17,589,702.10
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	92,381,931.81	109,971,633.91	17,589,702.10

注：于 2020 年 6 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

注：本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	363.13
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	30.24
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	4.23
合计	397.60

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
其他应收款	-
待摊费用	75,409.91
合计	75,409.91

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	22,233.60
银行间市场应付交易费用	-
合计	22,233.60

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 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	110,890.78
应付指数使用费	35,397.50
应退替代款	374,351.87
可退替代款	964.00
合计	521,604.15

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。

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	158,337,704.00	158,337,704.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-72,000,000.00	-72,000,000.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	89,337,704.00	89,337,704.00

### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,508,924.11	11,076,714.89	28,585,639.00
本期利润	14,201,871.32	-4,376,472.24	9,825,399.08
本期基金份额交易产生的变动数	-10,904,992.42	-2,813,487.35	-13,718,479.77
其中：基金申购款	537,343.33	-265,216.77	272,126.56
基金赎回款	-11,442,335.75	-2,548,270.58	-13,990,606.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,805,803.01	3,886,755.30	24,692,558.31

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	活期存款利息收入	10,617.52
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	501.29	
其他	111.32	
合计	11,230.13	

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	9,652,767.59
股票投资收益——赎回差价收入	4,089,438.27	

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	13,742,205.86

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	51,770,723.02
减：卖出股票成本总额	42,117,955.43
买卖股票差价收入	9,652,767.59

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
赎回基金份额对价总额	85,990,606.33
减：现金支付赎回款总额	31,622,581.33
减：赎回股票成本总额	50,278,586.73
赎回差价收入	4,089,438.27

#### 6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资产生的申购差价收入。

#### 6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无证券出借差价收入。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券赎回差价收入。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内未发生由于债券投资产生的债券申购差价收入。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

##### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

##### 6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------



股票投资产生的股利收益	1,078,517.57
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	1,078,517.57

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	-4,376,472.24
股票投资	-4,376,472.24
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
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	-4,376,472.24

注：本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为零。

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	172,676.94
合计	172,676.94

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

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	112,702.67
银行间市场交易费用	-

合计	112,702.67
----	------------

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	26,355.42
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	268.00
指数使用费	88,358.22
IOPV 计算费	24,863.02
登记结算费	74,590.09
合计	274,107.09

#### 6.4.7.21 分部报告

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

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司(“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。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

## 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
平安证券	2,628,236.30	3.67	67,708,976.45	47.51

## 6.4.10.1.2 债券交易

注：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。

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

注：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。

## 6.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	1,869.44	3.67	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	48,161.96	47.51	11,096.49	21.87

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

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

## 6.4.10.2 关联方报酬

### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	346,624.54	657,276.12
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	69,324.88	131,455.18

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.1%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

### 6.4.10.4 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

#### 6.4.10.4.1 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

注：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。

#### 6.4.10.4.2 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

注：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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

注：无。

##### 6.4.10.5.2 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 2020年6月30日		上年度末 2019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	75,220,100.00	84.1975	131,980,600.00	83.3539

##### 6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期存款	4,578,541.14	10,617.52	4,568,423.43	10,283.40

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业利率计息。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销的证券。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

(1) 于2020年6月30日，本基金持有175,000.00股工商银行的A股普通股，成本总额为人民币979,221.02元，估值总额为人民币871,500.00元，占基金资产净值的比例为0.76%（2019年6月30日，本基金持有475,300.00股工商银行的A股普通股，成本总额为人民币2,663,761.90元，估值总额为人民币2,799,517.00元，占基金资产净值的比例为1.22%）。

(2) 于2020年6月30日，本基金持有35,400.00股中国平安的A股普通股，成本总额为人民币2,412,330.71元，估值总额为人民币2,527,560.00元，占基金资产净值的比例为2.22%（2019

年 6 月 30 日, 本基金持有 95,500.00 股中国平安的 A 股普通股, 成本总额为人民币 6,106,529.30 元, 估值总额为人民币 8,462,255.00 元, 占基金资产净值的比例为 3.69%)。

(3) 于 2020 年 6 月 30 日, 本基金持有 63,000.00 股平安银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 725,269.11 元, 估值总额为人民币 806,400.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.71% (2019 年 6 月 30 日, 本基金持有 151,400.00 股平安银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 1,526,536.26 元, 估值总额为人民币 2,086,292.00 元, 占基金资产净值的比例为 0.91%)。

#### 6.4.11 利润分配情况

注: 本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2020年6月30日)本基金持有的流通受限证券

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

金额单位: 人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别: 股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位: 股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020年6月29日	2020年7月10日	配股未上市	5.00	6.54	3,420	17,100.00	22,366.80	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
688051	佳华科技	2020年3月12日	2020年9月21日	新股锁定	50.81	120.27	1,505	76,469.05	181,006.35	-
688277	天智航-U	2020年6月24日	2020年7月7日	新股未上市	12.04	12.04	5,483	66,015.32	66,015.32	-
688588	凌志软件	2020年4月28日	2020年11月11日	新股锁定	11.49	33.33	11,287	129,687.63	376,195.71	-

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。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能

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

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

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

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

注：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。

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

注：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

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

注：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

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

注：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

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

注：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

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

注：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。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于约定开放日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。

#### 6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

注：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 6.4.12。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。

#### 6.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，期末除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,578,541.14	-	-	-	4,578,541.14
结算备付金	74,687.23	-	-	-	74,687.23
存出保证金	10,394.33	-	-	-	10,394.33
交易性金融资产	-	-	-	109,971,633.91	109,971,633.91
应收利息	-	-	-	397.60	397.60
应收证券清算款	-	-	-	264,423.86	264,423.86
其他资产	-	-	-	75,409.91	75,409.91
资产总计	4,663,622.70	-	-	110,311,865.28	114,975,487.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	49,630.87	49,630.87
应付托管费	-	-	-	9,926.17	9,926.17
应付证券清算款	-	-	-	341,830.88	341,830.88
应付交易费用	-	-	-	22,233.60	22,233.60
其他负债	-	-	-	521,604.15	521,604.15
负债总计	-	-	-	945,225.67	945,225.67
利率敏感度缺口	4,663,622.70	-	-	109,366,639.61	114,030,262.31
上年度末 2019 年 12 月 31 日					
资产					
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
应收利息	-	-	-	843.63	843.63
应收证券清算款	-	-	-	13,215.87	13,215.87
其他资产	-	-	-	189,419.62	189,419.62
资产总计	4,398,063.01	-	-	184,273,743.01	188,671,806.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	81,451.12	81,451.12
应付托管费	-	-	-	16,290.22	16,290.22
应付证券清算款	-	-	-	1,229,255.41	1,229,255.41
应付交易费用	-	-	-	42,108.23	42,108.23
其他负债	-	-	-	379,358.04	379,358.04
负债总计	-	-	-	1,748,463.02	1,748,463.02
利率敏感度缺口	4,398,063.01	-	-	182,525,279.99	186,923,343.00

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

注：无

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

注：无

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

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

## 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	109,971,633.91	96.44	184,070,263.89	98.47
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	109,971,633.91	96.44	184,070,263.89	98.47

## 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）	
分析	业绩比较基准增加5%	6,490,045.50	9,788,213.15
	业绩比较基准减少5%	6,490,045.50	-9,788,213.15

## 6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

## 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期末无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	109,971,633.91	95.65
	其中：股票	109,971,633.91	95.65
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	4,653,228.37	4.05
8	其他各项资产	350,625.70	0.30
9	合计	114,975,487.98	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,807,638.00	1.59
B	采矿业	2,763,014.90	2.42
C	制造业	56,066,225.33	49.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,782,155.20	2.44
E	建筑业	2,169,552.80	1.90
F	批发和零售业	1,827,602.00	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	3,064,865.50	2.69
H	住宿和餐饮业	130,556.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,389,231.91	5.60
J	金融业	23,224,428.40	20.37
K	房地产业	3,903,926.60	3.42
L	租赁和商务服务业	1,652,703.07	1.45
M	科学研究和技术服务业	910,892.00	0.80
N	水利、环境和公共	82,824.00	0.07

	设施管理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	149,850.00	0.13
Q	卫生和社会工作	1,307,158.60	1.15
R	文化、体育和娱乐业	941,765.00	0.83
S	综合	67,718.00	0.06
	合计	109,242,107.31	95.80

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	147,460.65	0.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.01
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	569,299.63	0.50
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	729,526.60	0.64

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	4,200	6,144,096.00	5.39
2	601318	中国平安	35,400	2,527,560.00	2.22
3	600036	招商银行	67,700	2,282,844.00	2.00
4	000858	五粮液	12,700	2,173,224.00	1.91
5	600276	恒瑞医药	17,367	1,602,974.10	1.41
6	600900	长江电力	72,200	1,367,468.00	1.20
7	300750	宁德时代	7,200	1,255,392.00	1.10
8	002475	立讯精密	22,922	1,177,044.70	1.03
9	603288	海天味业	8,860	1,102,184.00	0.97
10	601166	兴业银行	68,100	1,074,618.00	0.94
11	300760	迈瑞医疗	3,400	1,039,380.00	0.91
12	600000	浦发银行	96,400	1,019,912.00	0.89
13	002714	牧原股份	12,252	1,004,664.00	0.88
14	601888	中国中免	6,429	990,258.87	0.87
15	002415	海康威视	30,637	929,832.95	0.82
16	601398	工商银行	175,000	871,500.00	0.76
17	000002	万科A	32,100	839,094.00	0.74
18	601288	农业银行	245,300	829,114.00	0.73
19	000001	平安银行	63,000	806,400.00	0.71
20	600030	中信证券	32,000	771,520.00	0.68
21	600585	海螺水泥	12,900	682,539.00	0.60
22	603259	药明康德	6,920	668,472.00	0.59
23	601328	交通银行	129,400	663,822.00	0.58
24	600016	民生银行	116,700	661,689.00	0.58
25	601668	中国建筑	138,240	659,404.80	0.58
26	000661	长春高新	1,500	652,950.00	0.57
27	600887	伊利股份	20,100	625,713.00	0.55
28	600048	保利地产	39,100	577,898.00	0.51
29	601601	中国太保	20,900	569,525.00	0.50
30	300015	爱尔眼科	13,036	566,414.20	0.50
31	000651	格力电器	10,000	565,700.00	0.50
32	002352	顺丰控股	9,900	541,530.00	0.47
33	300059	东方财富	26,280	530,856.00	0.47
34	300122	智飞生物	5,200	520,780.00	0.46
35	600031	三一重工	27,600	517,776.00	0.45
36	002142	宁波银行	19,700	517,519.00	0.45
37	002304	洋河股份	4,900	515,186.00	0.45

38	000725	京东方 A	109,900	513,233.00	0.45
39	000063	中兴通讯	12,700	509,651.00	0.45
40	600309	万华化学	10,100	504,899.00	0.44
41	601012	隆基股份	12,370	503,830.10	0.44
42	601818	光大银行	129,000	461,820.00	0.40
43	600588	用友网络	10,450	460,845.00	0.40
44	300498	温氏股份	20,760	452,568.00	0.40
45	601688	华泰证券	23,800	447,440.00	0.39
46	601766	中国中车	78,800	438,916.00	0.38
47	002594	比亚迪	6,100	437,980.00	0.38
48	000568	泸州老窖	4,700	428,264.00	0.38
49	600104	上汽集团	25,200	428,148.00	0.38
50	601211	国泰君安	24,800	428,048.00	0.38
51	600809	山西汾酒	2,900	420,500.00	0.37
52	000895	双汇发展	9,100	419,419.00	0.37
53	000876	新希望	14,000	417,200.00	0.37
54	600050	中国联通	85,000	411,400.00	0.36
55	000538	云南白药	4,325	405,728.25	0.36
56	600999	招商证券	18,400	403,880.00	0.35
57	601988	中国银行	113,800	396,024.00	0.35
58	601229	上海银行	47,626	395,295.80	0.35
59	600745	闻泰科技	3,100	390,445.00	0.34
60	300413	芒果超媒	5,940	387,288.00	0.34
61	600570	恒生电子	3,482	375,011.40	0.33
62	000166	申万宏源	74,200	374,710.00	0.33
63	603501	韦尔股份	1,800	363,510.00	0.32
64	600690	海尔智家	20,400	361,080.00	0.32
65	601066	中信建投	9,100	358,358.00	0.31
66	001979	招商蛇口	21,500	353,460.00	0.31
67	601169	北京银行	70,600	345,940.00	0.30
68	601006	大秦铁路	49,000	344,960.00	0.30
69	601390	中国中铁	68,000	341,360.00	0.30
70	300601	康泰生物	2,100	340,536.00	0.30
71	600703	三安光电	13,600	340,000.00	0.30
72	603986	兆易创新	1,420	334,992.20	0.29
73	600028	中国石化	85,200	333,132.00	0.29
74	600837	海通证券	26,400	332,112.00	0.29
75	002555	三七互娱	7,000	327,600.00	0.29
76	600436	片仔癀	1,900	323,475.00	0.28
77	600547	山东黄金	8,720	319,326.40	0.28
78	002241	歌尔股份	10,800	317,088.00	0.28
79	601186	中国铁建	37,400	313,412.00	0.27



80	603160	汇顶科技	1,400	312,060.00	0.27
81	600406	国电南瑞	15,400	311,850.00	0.27
82	002007	华兰生物	6,140	307,675.40	0.27
83	601989	中国重工	76,800	307,200.00	0.27
84	601336	新华保险	6,900	305,532.00	0.27
85	601933	永辉超市	32,000	300,160.00	0.26
86	300014	亿纬锂能	6,233	298,249.05	0.26
87	601857	中国石油	70,800	296,652.00	0.26
88	601138	工业富联	19,500	295,425.00	0.26
89	000938	紫光股份	6,784	291,576.32	0.26
90	601899	紫金矿业	64,500	283,800.00	0.25
91	600019	宝钢股份	62,000	282,720.00	0.25
92	000100	TCL 科技	44,300	274,660.00	0.24
93	000338	潍柴动力	20,000	274,400.00	0.24
94	000776	广发证券	19,400	273,928.00	0.24
95	688111	金山办公	800	273,264.00	0.24
96	002027	分众传媒	48,260	268,808.20	0.24
97	002024	苏宁易购	30,500	267,485.00	0.23
98	600346	恒力石化	19,080	267,120.00	0.23
99	002230	科大讯飞	7,100	265,753.00	0.23
100	002050	三花智控	12,095	264,880.50	0.23
101	002410	广联达	3,800	264,860.00	0.23
102	600015	华夏银行	42,700	261,324.00	0.23
103	300433	蓝思科技	9,300	260,772.00	0.23
104	601088	中国神华	18,000	258,480.00	0.23
105	300142	沃森生物	4,900	256,564.00	0.22
106	002371	北方华创	1,500	256,365.00	0.22
107	300347	泰格医药	2,500	254,700.00	0.22
108	002916	深南电路	1,516	253,960.32	0.22
109	002624	完美世界	4,400	253,616.00	0.22
110	601628	中国人寿	9,300	253,053.00	0.22
111	601009	南京银行	33,800	247,754.00	0.22
112	002311	海大集团	5,100	242,709.00	0.21
113	600009	上海机场	3,300	237,831.00	0.21
114	600340	华夏幸福	10,400	237,744.00	0.21
115	601155	新城控股	7,500	234,300.00	0.21
116	601100	恒立液压	2,900	232,580.00	0.20
117	600196	复星医药	6,800	230,180.00	0.20
118	300033	同花顺	1,700	226,236.00	0.20
119	600919	江苏银行	39,600	224,532.00	0.20
120	600438	通威股份	12,900	224,202.00	0.20
121	600183	生益科技	7,600	222,452.00	0.20

122	300003	乐普医疗	6,000	219,120.00	0.19
123	002001	新和成	7,500	218,250.00	0.19
124	002129	中环股份	9,500	213,370.00	0.19
125	300124	汇川技术	5,600	212,744.00	0.19
126	600741	华域汽车	10,200	212,058.00	0.19
127	603993	洛阳钼业	57,300	210,291.00	0.18
128	002493	荣盛石化	17,000	209,100.00	0.18
129	002841	视源股份	2,100	208,992.00	0.18
130	600383	金地集团	15,200	208,240.00	0.18
131	002602	世纪华通	13,500	206,685.00	0.18
132	601225	陕西煤业	28,400	204,764.00	0.18
133	601788	光大证券	12,700	203,962.00	0.18
134	002460	赣锋锂业	3,800	203,566.00	0.18
135	002271	东方雨虹	5,000	203,150.00	0.18
136	002600	领益智造	19,000	201,970.00	0.18
137	601939	建设银行	31,600	199,396.00	0.17
138	601901	方正证券	28,000	198,240.00	0.17
139	601877	正泰电器	7,500	197,625.00	0.17
140	002236	大华股份	10,000	192,100.00	0.17
141	002120	韵达股份	7,770	189,976.50	0.17
142	300676	华大基因	1,200	187,092.00	0.16
143	002044	美年健康	12,840	185,024.40	0.16
144	600958	东方证券	19,400	184,106.00	0.16
145	600886	国投电力	23,400	183,924.00	0.16
146	000596	古井贡酒	1,200	180,288.00	0.16
147	300136	信维通信	3,400	180,268.00	0.16
148	600926	杭州银行	20,080	179,113.60	0.16
149	600893	航发动力	7,489	175,841.72	0.15
150	300529	健帆生物	2,530	175,835.00	0.15
151	002127	南极电商	8,300	175,711.00	0.15
152	603369	今世缘	4,400	175,076.00	0.15
153	000977	浪潮信息	4,424	173,332.32	0.15
154	601985	中国核电	42,100	172,189.00	0.15
155	601816	京沪高铁	27,600	171,948.00	0.15
156	600845	宝信软件	2,910	171,922.80	0.15
157	601669	中国电建	49,600	171,616.00	0.15
158	603019	中科曙光	4,444	170,649.60	0.15
159	600606	绿地控股	27,600	170,568.00	0.15
160	600010	宝钢股份	157,900	170,532.00	0.15
161	002821	凯莱英	700	170,100.00	0.15
162	002812	恩捷股份	2,580	169,764.00	0.15
163	000069	华侨城 A	28,000	169,680.00	0.15

164	603899	晨光文具	3,100	169,260.00	0.15
165	300408	三环集团	6,100	168,970.00	0.15
166	600600	青岛啤酒	2,200	168,300.00	0.15
167	300558	贝达药业	1,200	167,976.00	0.15
168	002456	欧菲光	9,100	167,349.00	0.15
169	600763	通策医疗	1,000	166,770.00	0.15
170	000768	中航飞机	9,400	166,756.00	0.15
171	600584	长电科技	5,300	165,731.00	0.15
172	600161	天坛生物	3,636	164,819.88	0.14
173	300454	深信服	800	164,768.00	0.14
174	603444	吉比特	300	164,703.00	0.14
175	300628	亿联网络	2,400	163,824.00	0.14
176	300253	卫宁健康	7,140	163,791.60	0.14
177	601881	中国银河	14,100	161,727.00	0.14
178	600521	华海药业	4,700	159,471.00	0.14
179	002384	东山精密	5,300	158,735.00	0.14
180	601990	南京证券	11,100	158,397.00	0.14
181	603939	益丰药房	1,740	158,340.00	0.14
182	002179	中航光电	3,850	157,888.50	0.14
183	601377	兴业证券	23,000	157,550.00	0.14
184	000963	华东医药	6,200	156,860.00	0.14
185	600029	南方航空	30,200	156,134.00	0.14
186	002736	国信证券	13,800	155,940.00	0.14
187	601618	中国中冶	61,800	155,118.00	0.14
188	002414	高德红外	5,260	154,012.80	0.14
189	600872	中炬高新	2,600	152,178.00	0.13
190	002463	沪电股份	6,000	149,880.00	0.13
191	002607	中公教育	5,400	149,850.00	0.13
192	000425	徐工机械	25,300	149,523.00	0.13
193	300144	宋城演艺	8,600	148,780.00	0.13
194	603658	安图生物	900	146,196.00	0.13
195	300782	卓胜微	360	146,077.20	0.13
196	600332	白云山	4,500	145,485.00	0.13
197	600061	国投资本	11,400	145,122.00	0.13
198	000656	金科股份	17,700	144,432.00	0.13
199	600660	福耀玻璃	6,900	144,003.00	0.13
200	002252	上海莱士	17,000	143,820.00	0.13
201	603799	华友钴业	3,698	143,704.28	0.13
202	002157	正邦科技	8,200	143,336.00	0.13
203	300450	先导智能	3,100	143,251.00	0.13
204	000625	长安汽车	12,900	141,900.00	0.12
205	603517	绝味食品	2,000	141,480.00	0.12

206	601111	中国国航	21,400	141,454.00	0.12
207	601727	上海电气	27,800	140,112.00	0.12
208	000157	中联重科	21,600	138,888.00	0.12
209	300308	中际旭创	2,200	138,600.00	0.12
210	600298	安琪酵母	2,800	138,544.00	0.12
211	002049	紫光国微	1,900	138,225.00	0.12
212	600352	浙江龙盛	10,800	138,132.00	0.12
213	601872	招商轮船	23,500	137,005.00	0.12
214	600115	东方航空	32,300	136,306.00	0.12
215	603882	金城医学	1,500	134,250.00	0.12
216	002603	以岭药业	4,300	134,117.00	0.12
217	603659	璞泰来	1,300	133,926.00	0.12
218	600674	川投能源	14,300	132,561.00	0.12
219	601162	天风证券	21,800	132,108.00	0.12
220	601319	中国人保	20,400	131,376.00	0.12
221	601360	三六零	7,100	130,001.00	0.11
222	600118	中国卫星	4,200	129,486.00	0.11
223	002385	大北农	14,100	128,451.00	0.11
224	300595	欧普康视	1,850	128,279.00	0.11
225	000860	顺鑫农业	2,250	128,205.00	0.11
226	600760	中航沈飞	3,900	127,998.00	0.11
227	002032	苏泊尔	1,800	127,800.00	0.11
228	000066	中国长城	9,600	126,720.00	0.11
229	600536	中国软件	1,600	126,720.00	0.11
230	002439	启明星辰	3,000	126,210.00	0.11
231	000783	长江证券	18,700	126,038.00	0.11
232	603605	珀莱雅	700	126,014.00	0.11
233	600795	国电电力	68,000	125,800.00	0.11
234	002065	东华软件	10,000	125,200.00	0.11
235	300383	光环新网	4,800	125,136.00	0.11
236	002153	石基信息	3,200	124,896.00	0.11
237	601600	中国铝业	45,000	124,200.00	0.11
238	002146	荣盛发展	15,300	123,930.00	0.11
239	002223	鱼跃医疗	3,400	123,760.00	0.11
240	600867	通化东宝	7,100	123,753.00	0.11
241	000786	北新建材	5,800	123,714.00	0.11
242	002185	华天科技	9,100	123,123.00	0.11
243	603707	健友股份	1,900	122,683.00	0.11
244	300661	圣邦股份	400	122,020.00	0.11
245	002202	金风科技	12,200	121,634.00	0.11
246	688396	华润微	2,800	121,632.00	0.11
247	600018	上港集团	28,900	121,380.00	0.11

248	601607	上海医药	6,600	121,308.00	0.11
249	600705	中航资本	30,500	120,780.00	0.11
250	601108	财通证券	11,700	119,925.00	0.11
251	600085	同仁堂	4,400	119,328.00	0.10
252	002299	圣农发展	4,100	118,900.00	0.10
253	600498	烽火通信	4,100	118,531.00	0.10
254	600998	九州通	6,300	117,306.00	0.10
255	600079	人福医药	4,300	117,046.00	0.10
256	002466	天齐锂业	5,080	116,586.00	0.10
257	600143	金发科技	8,800	115,896.00	0.10
258	002690	美亚光电	2,200	115,720.00	0.10
259	600637	东方明珠	11,990	115,703.50	0.10
260	300251	光线传媒	10,600	115,646.00	0.10
261	002180	纳思达	3,500	115,185.00	0.10
262	603338	浙江鼎力	1,520	115,170.40	0.10
263	603858	步长制药	3,976	114,707.60	0.10
264	000703	恒逸石化	12,550	114,581.50	0.10
265	300482	万孚生物	1,100	114,400.00	0.10
266	600176	中国巨石	12,400	113,460.00	0.10
267	601800	中国交建	15,400	113,036.00	0.10
268	600111	北方稀土	12,100	112,772.00	0.10
269	600109	国金证券	9,800	111,818.00	0.10
270	600489	中金黄金	12,200	111,508.00	0.10
271	300316	晶盛机电	4,500	111,330.00	0.10
272	002405	四维图新	6,750	111,307.50	0.10
273	001914	招商积余	3,600	110,628.00	0.10
274	002074	国轩高科	4,100	110,044.00	0.10
275	002739	万达电影	7,200	109,944.00	0.10
276	600522	中天科技	9,600	109,920.00	0.10
277	600004	白云机场	7,200	109,728.00	0.10
278	600201	生物股份	3,940	109,689.60	0.10
279	601018	宁波港	30,700	109,599.00	0.10
280	600132	重庆啤酒	1,500	109,500.00	0.10
281	601919	中远海控	31,500	109,305.00	0.10
282	600023	浙能电力	31,100	109,161.00	0.10
283	002773	康弘药业	2,200	109,120.00	0.10
284	000050	深天马 A	7,100	109,056.00	0.10
285	002373	千方科技	4,500	107,955.00	0.09
286	000961	中南建设	12,100	107,690.00	0.09
287	300285	国瓷材料	3,200	107,232.00	0.09
288	600011	华能国际	25,400	107,188.00	0.09
289	600699	均胜电子	4,480	106,668.80	0.09

290	000975	银泰黄金	6,800	106,624.00	0.09
291	002212	南洋股份	4,000	106,320.00	0.09
292	603345	安井食品	900	106,200.00	0.09
293	600487	亨通光电	6,460	106,008.60	0.09
294	601021	春秋航空	3,000	105,720.00	0.09
295	002019	亿帆医药	4,600	105,662.00	0.09
296	600390	五矿资本	14,900	105,194.00	0.09
297	000021	深科技	4,800	104,784.00	0.09
298	601555	东吴证券	12,830	104,692.80	0.09
299	601838	成都银行	13,100	104,276.00	0.09
300	600380	健康元	6,408	104,065.92	0.09
301	002152	广电运通	8,000	103,520.00	0.09
302	002013	中航机电	13,100	103,490.00	0.09
303	600598	北大荒	6,400	103,040.00	0.09
304	601658	邮储银行	22,500	102,825.00	0.09
305	300146	汤臣倍健	5,200	102,388.00	0.09
306	600177	雅戈尔	17,140	102,154.40	0.09
307	002673	西部证券	12,500	102,000.00	0.09
308	002601	龙蟠佰利	5,500	101,750.00	0.09
309	601799	星宇股份	800	101,600.00	0.09
310	600801	华新水泥	4,280	101,478.80	0.09
311	600315	上海家化	2,100	100,590.00	0.09
312	601689	拓普集团	3,600	100,440.00	0.09
313	300699	光威复材	1,600	100,368.00	0.09
314	002926	华西证券	9,400	99,922.00	0.09
315	300418	昆仑万维	4,000	99,840.00	0.09
316	600895	张江高科	4,900	99,813.00	0.09
317	002508	老板电器	3,200	99,552.00	0.09
318	000999	华润三九	3,400	99,246.00	0.09
319	002353	杰瑞股份	3,200	99,200.00	0.09
320	600271	航天信息	6,100	99,064.00	0.09
321	600068	葛洲坝	16,500	98,175.00	0.09
322	601198	东兴证券	9,000	98,100.00	0.09
323	601998	中信银行	19,000	97,850.00	0.09
324	002156	通富微电	3,900	97,695.00	0.09
325	600362	江西铜业	7,200	96,912.00	0.08
326	603589	口子窖	1,900	96,710.00	0.08
327	000728	国元证券	11,500	96,600.00	0.08
328	600642	申能股份	16,300	96,333.00	0.08
329	603712	七一二	2,500	95,950.00	0.08
330	600150	中国船舶	5,500	95,920.00	0.08
331	002558	巨人网络	5,500	95,700.00	0.08

332	000739	普洛药业	4,100	95,489.00	0.08
333	600426	华鲁恒升	5,400	95,472.00	0.08
334	600655	豫园股份	10,700	94,802.00	0.08
335	002500	山西证券	14,420	94,306.80	0.08
336	600170	上海建工	30,600	93,942.00	0.08
337	601231	环旭电子	4,300	93,912.00	0.08
338	600779	水井坊	1,500	93,630.00	0.08
339	600511	国药股份	2,300	93,541.00	0.08
340	002465	海格通信	7,224	93,478.56	0.08
341	600089	特变电工	13,800	93,426.00	0.08
342	300357	我武生物	1,500	93,375.00	0.08
343	300496	中科创达	1,200	93,240.00	0.08
344	002242	九阳股份	2,500	93,175.00	0.08
345	600415	小商品城	19,100	93,017.00	0.08
346	600739	辽宁成大	4,900	92,757.00	0.08
347	603833	欧派家居	800	92,720.00	0.08
348	600482	中国动力	5,900	92,630.00	0.08
349	300207	欣旺达	4,900	92,610.00	0.08
350	600885	宏发股份	2,300	92,276.00	0.08
351	002294	信立泰	3,100	91,946.00	0.08
352	002511	中顺洁柔	4,100	91,430.00	0.08
353	601117	中国化学	16,600	90,968.00	0.08
354	601966	玲珑轮胎	4,500	90,900.00	0.08
355	300168	万达信息	4,100	90,487.00	0.08
356	600875	东方电气	10,200	90,270.00	0.08
357	601878	浙商证券	9,100	90,181.00	0.08
358	600909	华安证券	13,200	90,156.00	0.08
359	002399	海普瑞	3,600	90,144.00	0.08
360	603883	老百姓	900	90,036.00	0.08
361	002507	涪陵榨菜	2,500	90,025.00	0.08
362	600208	新湖中宝	30,200	89,996.00	0.08
363	300212	易华录	1,600	89,600.00	0.08
364	300088	长信科技	7,900	88,480.00	0.08
365	002422	科伦药业	4,200	88,200.00	0.08
366	600297	广汇汽车	27,500	87,725.00	0.08
367	600516	方大炭素	13,947	87,587.16	0.08
368	002075	沙钢股份	7,000	87,500.00	0.08
369	601179	中国西电	18,000	87,120.00	0.08
370	000627	天茂集团	16,700	87,007.00	0.08
371	002925	盈趣科技	1,500	86,910.00	0.08
372	601233	桐昆股份	6,800	86,768.00	0.08
373	600369	西南证券	18,900	86,751.00	0.08

374	002557	洽洽食品	1,600	86,704.00	0.08
375	002078	太阳纸业	9,100	86,632.00	0.08
376	601992	金隅集团	28,200	86,292.00	0.08
377	002939	长城证券	7,000	86,240.00	0.08
378	000723	美锦能源	13,700	85,762.00	0.08
379	000513	丽珠集团	1,778	85,361.78	0.07
380	600219	南山铝业	42,030	85,320.90	0.07
381	002131	利欧股份	22,100	85,306.00	0.07
382	002797	第一创业	12,300	85,116.00	0.07
383	600667	太极实业	7,200	85,104.00	0.07
384	000671	阳光城	13,300	84,322.00	0.07
385	600221	海航控股	56,200	84,300.00	0.07
386	002174	游族网络	3,200	83,456.00	0.07
387	000988	华工科技	3,400	83,062.00	0.07
388	600066	宇通客车	6,800	82,960.00	0.07
389	300070	碧水源	10,200	82,824.00	0.07
390	002958	青农商行	18,500	81,955.00	0.07
391	603866	桃李面包	1,600	81,424.00	0.07
392	600027	华电国际	23,600	80,712.00	0.07
393	002468	申通快递	4,900	80,409.00	0.07
394	000750	国海证券	18,510	80,333.40	0.07
395	002572	索菲亚	3,300	79,761.00	0.07
396	002030	达安基因	2,890	78,839.20	0.07
397	603000	人民网	3,900	77,337.00	0.07
398	002683	宏大爆破	2,200	76,780.00	0.07
399	601997	贵阳银行	10,700	76,612.00	0.07
400	603156	养元饮品	3,560	76,540.00	0.07
401	600535	天士力	4,700	76,234.00	0.07
402	600688	上海石化	21,800	75,864.00	0.07
403	002081	金螳螂	9,600	75,456.00	0.07
404	601099	太平洋	23,800	75,446.00	0.07
405	600153	建发股份	9,300	75,330.00	0.07
406	000423	东阿阿胶	2,100	75,201.00	0.07
407	601128	常熟银行	10,000	75,100.00	0.07
408	600100	同方股份	10,300	75,087.00	0.07
409	000709	河钢股份	36,800	75,072.00	0.07
410	000932	华菱钢铁	19,840	74,796.80	0.07
411	000540	中天金融	23,100	74,382.00	0.07
412	600155	华创阳安	6,200	74,338.00	0.07
413	600486	扬农化工	900	74,250.00	0.07
414	600704	物产中大	17,600	74,096.00	0.06
415	601216	君正集团	29,100	73,914.00	0.06



416	600026	中远海能	11,400	73,644.00	0.06
417	300271	华宇软件	2,600	73,346.00	0.06
418	600583	海油工程	16,000	72,800.00	0.06
419	600188	兖州煤业	8,300	72,708.00	0.06
420	000729	燕京啤酒	10,600	72,610.00	0.06
421	002281	光迅科技	2,200	72,292.00	0.06
422	000688	国城矿业	3,900	72,267.00	0.06
423	600754	锦江酒店	2,600	72,150.00	0.06
424	000547	航天发展	5,200	71,084.00	0.06
425	000630	铜陵有色	36,600	70,638.00	0.06
426	600167	联美控股	4,900	70,266.00	0.06
427	601098	中南传媒	6,600	69,828.00	0.06
428	600038	中直股份	1,700	69,819.00	0.06
429	600160	巨化股份	10,100	69,589.00	0.06
430	000401	冀东水泥	4,300	68,972.00	0.06
431	300017	网宿科技	8,100	68,769.00	0.06
432	600566	济川药业	2,700	68,742.00	0.06
433	601118	海南橡胶	14,100	68,526.00	0.06
434	300024	机器人	5,000	68,350.00	0.06
435	002340	格林美	13,700	68,089.00	0.06
436	600021	上海电力	9,200	68,080.00	0.06
437	600673	东阳光	9,800	67,718.00	0.06
438	601106	中国一重	24,000	67,440.00	0.06
439	000997	新大陆	4,200	67,116.00	0.06
440	000415	渤海租赁	22,200	66,156.00	0.06
441	000402	金融街	9,900	65,736.00	0.06
442	000623	吉林敖东	4,100	64,493.00	0.06
443	600879	航天电子	10,000	64,400.00	0.06
444	600977	中国电影	4,900	64,337.00	0.06
445	000686	东北证券	7,600	64,220.00	0.06
446	600959	江苏有线	17,000	63,920.00	0.06
447	600733	北汽蓝谷	9,800	63,014.00	0.06
448	600256	广汇能源	23,300	62,910.00	0.06
449	000027	深圳能源	13,480	62,547.20	0.05
450	000825	太钢不锈	18,800	62,416.00	0.05
451	000089	深圳机场	8,100	62,046.00	0.05
452	002268	卫士通	2,900	61,886.00	0.05
453	600497	驰宏锌锗	17,800	61,232.00	0.05
454	600967	内蒙一机	5,878	61,072.42	0.05
455	600056	中国医药	4,300	60,845.00	0.05
456	000629	攀钢钒钛	30,100	60,501.00	0.05
457	600460	士兰微	4,100	60,188.00	0.05

458	002396	星网锐捷	1,700	60,061.00	0.05
459	002372	伟星新材	5,160	60,010.80	0.05
460	600528	中铁工业	6,800	59,976.00	0.05
461	601958	金钼股份	9,700	59,946.00	0.05
462	000998	隆平高科	3,600	59,940.00	0.05
463	600398	海澜之家	10,200	59,364.00	0.05
464	002010	传化智联	10,800	58,752.00	0.05
465	600372	中航电子	4,400	58,608.00	0.05
466	600258	首旅酒店	3,800	58,406.00	0.05
467	600446	金证股份	3,000	58,200.00	0.05
468	000581	威孚高科	2,800	57,904.00	0.05
469	600008	首创股份	19,200	57,792.00	0.05
470	600820	隧道股份	10,100	57,065.00	0.05
471	300026	红日药业	10,200	56,304.00	0.05
472	300012	华测检测	2,800	55,328.00	0.05
473	002110	三钢闽光	8,300	55,278.00	0.05
474	601699	潞安环能	9,900	55,143.00	0.05
475	002195	二三四五	19,531	54,882.11	0.05
476	000883	湖北能源	15,500	54,560.00	0.05
477	600675	中华企业	13,380	54,456.60	0.05
478	600776	东方通信	3,600	54,324.00	0.05
479	600968	海油发展	23,300	54,289.00	0.05
480	002387	维信诺	3,800	54,264.00	0.05
481	300296	利亚德	8,900	54,023.00	0.05
482	600808	马钢股份	20,900	53,922.00	0.05
483	600376	首开股份	9,100	53,326.00	0.05
484	002217	合力泰	10,100	53,025.00	0.05
485	600466	蓝光发展	9,800	52,822.00	0.05
486	601718	际华集团	15,900	52,788.00	0.05
487	600572	康恩贝	9,500	52,250.00	0.05
488	600737	中粮糖业	6,700	52,126.00	0.05
489	000738	航发控制	3,800	51,870.00	0.05
490	000413	东旭光电	19,400	51,798.00	0.05
491	600260	凯乐科技	3,820	51,646.40	0.05
492	000031	大悦城	10,100	51,409.00	0.05
493	601866	中远海发	27,800	51,152.00	0.04
494	601598	中国外运	15,600	50,388.00	0.04
495	000983	西山煤电	13,430	50,362.50	0.04
496	603885	吉祥航空	5,500	50,050.00	0.04
497	000028	国药一致	1,100	49,511.00	0.04
498	600863	内蒙华电	19,900	48,954.00	0.04
499	600549	厦门钨业	4,100	48,544.00	0.04

500	002221	东华能源	5,500	48,345.00	0.04
501	600718	东软集团	4,100	47,150.00	0.04
502	000898	鞍钢股份	18,930	46,378.50	0.04
503	600373	中文传媒	3,900	45,942.00	0.04
504	002506	协鑫集成	17,500	45,675.00	0.04
505	000598	兴蓉环境	9,700	44,620.00	0.04
506	300598	诚迈科技	230	43,562.00	0.04
507	000046	泛海控股	11,400	42,978.00	0.04
508	002563	森马服饰	6,000	42,300.00	0.04
509	002085	万丰奥威	6,400	41,472.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688588	凌志软件	11,287	376,195.71	0.33
2	688051	佳华科技	1,505	181,006.35	0.16
3	688277	天智航-U	5,483	66,015.32	0.06
4	603087	甘李药业	365	36,609.50	0.03
5	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
6	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.01
7	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.01
8	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
9	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
10	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.01
11	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

#### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	1,024,649.00	0.55
2	603986	兆易创新	403,422.25	0.22
3	603160	汇顶科技	397,513.00	0.21
4	600519	贵州茅台	352,223.00	0.19
5	002714	牧原股份	348,438.00	0.19
6	601816	京沪高铁	316,565.00	0.17
7	601318	中国平安	304,450.00	0.16
8	600036	招商银行	282,880.00	0.15
9	300782	卓胜微	281,851.00	0.15
10	300454	深信服	274,154.00	0.15
11	002916	深南电路	268,176.16	0.14
12	002352	顺丰控股	245,617.00	0.13

13	688111	金山办公	242,592.56	0.13
14	000858	五粮液	238,300.00	0.13
15	002841	视源股份	234,060.00	0.13
16	300661	圣邦股份	229,517.00	0.12
17	002252	上海莱士	227,526.00	0.12
18	000001	平安银行	226,842.00	0.12
19	002602	世纪华通	216,038.00	0.12
20	300750	宁德时代	211,625.00	0.11

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,862,647.00	1.00
2	000858	五粮液	1,796,952.00	0.96
3	300750	宁德时代	1,140,139.00	0.61
4	000333	美的集团	1,139,217.96	0.61
5	002415	海康威视	993,270.00	0.53
6	000002	万科A	909,697.00	0.49
7	000001	平安银行	843,484.00	0.45
8	002475	立讯精密	799,947.00	0.43
9	300760	迈瑞医疗	750,768.28	0.40
10	002714	牧原股份	712,100.00	0.38
11	000651	格力电器	599,437.00	0.32
12	300498	温氏股份	531,019.00	0.28
13	001979	招商蛇口	511,346.00	0.27
14	002304	洋河股份	505,743.00	0.27
15	000063	中兴通讯	498,783.00	0.27
16	300454	深信服	491,954.00	0.26
17	002142	宁波银行	489,343.00	0.26
18	000725	京东方A	483,215.00	0.26
19	002916	深南电路	446,025.80	0.24
20	300015	爱尔眼科	445,842.00	0.24

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	21,619,087.42
卖出股票收入（成交）总额	51,770,723.02

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

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券投资。

## 7.7 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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无股指期货投资。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

报告期内，本基金未参与国债期货交易。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末无国债期货投资。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

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。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	10,394.33
2	应收证券清算款	264,423.86
3	应收股利	-
4	应收利息	397.60
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.91
8	其他	-
9	合计	350,625.70

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688588	凌志软件	376,195.71	0.33	新股锁定
2	688051	佳华科技	181,006.35	0.16	新股锁定
3	688277	天智航-U	66,015.32	0.06	新股未上市

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 8.1.1 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 (%)
428	208,732.95	76,874,188.00	86.05	12,463,516.00	13.95

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金	75,220,100.00	84.20

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	广发证券股份有限公司	1,650,790.00	1.85
2	李莉	1,000,000.00	1.12
3	韩立宾	798,800.00	0.89
4	张玉琴	545,724.00	0.61
5	李晨	300,000.00	0.34
6	叶意琴	300,000.00	0.34
7	戴和平	254,900.00	0.29
8	徐翠华	250,708.00	0.28
9	黄思宁	250,000.00	0.28
10	普红兵	250,000.00	0.28
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	75,220,100.00	84.20

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 6 月 15 日） 基金份额总额	323,337,704.00
本报告期期初基金份额总额	158,337,704.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	72,000,000.00
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	89,337,704.00

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、副总经理汪涛因个人原因提出辞任，经公司第三届董事会第十九次会议审议通过，离任日期为 2020 年 2 月 28 日。

2、2020 年 5 月公司董事会换届，经公司 2020 年第三次股东会审议通过，陈宁、马琳接替姚波、陈敬达成为公司新任董事，任职日期为 2020 年 5 月 27 日。

3、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。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金聘用普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。



## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券	3	20,191,186.03	28.19%	14,362.51	28.19%	-
国盛证券	1	18,644,153.09	26.03%	13,262.00	26.03%	-
海通证券	4	11,615,165.79	16.21%	8,262.03	16.21%	-
长江证券	1	8,608,542.27	12.02%	6,123.06	12.02%	-
广发证券	2	8,178,870.77	11.42%	5,818.07	11.42%	-
平安证券	2	2,628,236.30	3.67%	1,869.44	3.67%	-
中泰证券	2	1,613,020.13	2.25%	1,147.48	2.25%	-
中信建投证券	2	156,894.76	0.22%	111.57	0.22%	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
新时代证券	2	-	-	-	-	-

注：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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的	成交金额	占当期权证成交总额

				比例		的比例
招商证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投 证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
新时代证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于平安 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、托管协议调整申购赎回相关条款的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 17 日
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	中国证监会规定报刊及网站	2020 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托管协议	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 17 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更新（摘要）	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 17 日
5	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更新	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 17 日
6	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 1 月 20 日
7	平安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 2 月 29 日
8	平安基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 27 日
9	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增兴业证券为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 3 月 30 日
10	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 22 日

	告		
11	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	中国证监会规定报刊及网站	2020 年 4 月 30 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2020/01/01--2020/06/30	131,980,600.00	47,619,100.00	104,379,600.00	75,220,100.00	84.20

#### 产品特有风险

本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产。在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5,000 万元,基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

注:无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予平安 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、报告期内在规定报刊以及规定网站上披露的各项公告。

## 12.2 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

## 12.3 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 8 月 28 日