

平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数  
证券投资基金  
2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 31 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 2024 年 08 月 30 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 2024 年 01 月 01 日起至 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	7
<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	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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的真实、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	15
6.3 净资产变动表	16
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	38
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	52

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 本基金投资股指期货的投资政策 .....	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>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	54
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>55</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 .....	56
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 .....	59
12.3 查阅方式 .....	59

## § 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	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	54,337,704.00 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
	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	廖林

## 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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,057,234.94
本期利润	487,336.72
加权平均基金份额本期利润	0.0090
本期加权平均净值利润率	0.67%
本期基金份额净值增长率	0.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	18,241,324.03
期末可供分配基金份额利润	0.3357
期末基金资产净值	72,579,028.03
期末基金份额净值	1.3357
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	33.57%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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。

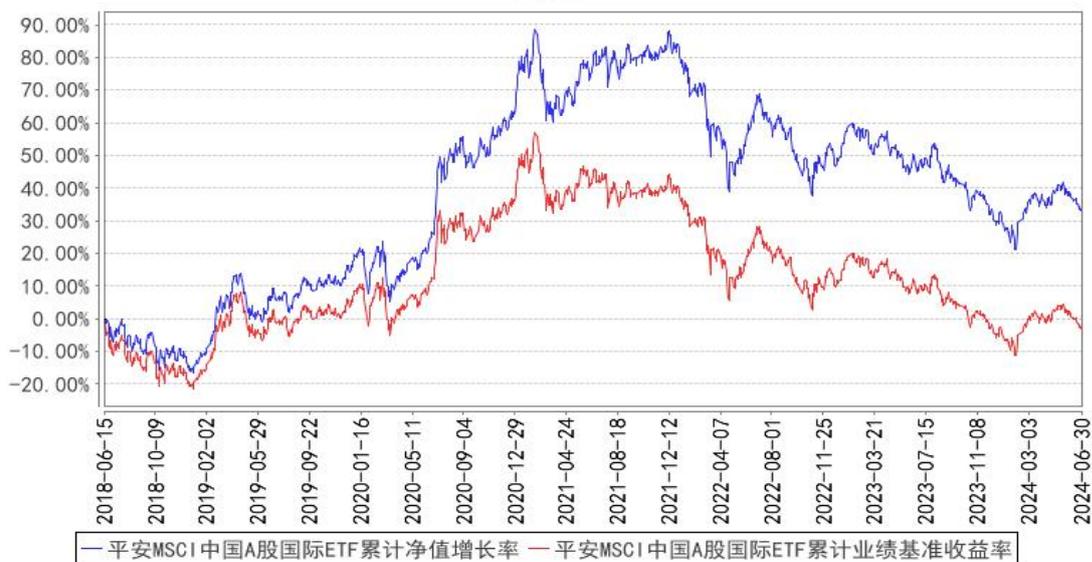
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-2.94%	0.48%	-3.88%	0.51%	0.94%	-0.03%
过去三个月	-1.55%	0.75%	-2.63%	0.79%	1.08%	-0.04%
过去六个月	0.61%	0.95%	-0.11%	0.99%	0.72%	-0.04%
过去一年	-8.91%	0.87%	-10.49%	0.91%	1.58%	-0.04%
过去三年	-26.61%	1.01%	-33.17%	1.04%	6.56%	-0.03%
自基金合同生效起至今	33.57%	1.18%	-2.66%	1.22%	36.23%	-0.04%

#### 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成立于 2011 年 1 月 7 日，平安基金总部位于深圳，注册资本为 13 亿元人民币。作为中国平安集团旗下成员，平安基金“以专业承载信赖”，为海内外各类机构和个人投资者提供专业、全面的资产管理服务。依托中国平安集团综合金融优势，平安基金建立了以固收投资、权益投资、指数投资、资产配置、资产证券化、专户六大业务板块（其中资产证券化及非标专户业务通过旗下全资子公司深圳平安汇通投资管理有限公司开展）。基于平安集团四大研究院和集团整体科技基础设施，平安基金构建了以智能投研、智能运营、智能销售、智慧风控四大应用方向为基础的资产管理智能解决方案，致力于成为国内领先的科技赋能型智慧资产管理公司。截至 2024 年 6 月 30 日，平安基金共管理 206 只公募基金，公募资产管理总规模约为 6655 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		
王仁增	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	2021 年 7 月 8 日	-	10 年	王仁增先生，南开大学世界经济专业硕士研究生。曾先后担任财通基金管理有限公司产品经理、华安基金管理有限公司高级产品经理。2021 年 6 月加入平安基金管理有限公司，任 ETF 指数投资中心高级研究员、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中证消费电子主题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、平安中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任平安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、平安 MSCI

					<p>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 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联接基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料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发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金基金经理助理。</p>
李严	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	2023 年 12 月 29 日	-	3 年	<p>李严先生, 复旦大学应用统计学专业硕士, 曾担任东北证券股份有限公司上海证券研究咨询分公司证券分析师。2023 年 4 月加入平安基金管理有限公司, 现任 ETF 指数投资中心高级研究员、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 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、平安中证 500 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 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金、平安中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、平安国证 2000 交易</p>

					<p>型开放式指数证券投资基金、平安中证 A50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。同时担任平安 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、平安中证畜牧养殖交易型开放式指数证券投资基金、平安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新材料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发起式联接基金、平安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数证券投资基金、平安中证医药及医疗器械创新指数型发起式证券投资基金、平安中证消费电子主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、平安中债-0-3 年国开行债券交易型开放式指数证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理。</p>
成钧	ETF 指数投资中心投资执行总经理，平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金	2023 年 9 月 7 日	2024 年 1 月 3 日	13 年	<p>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，曾任 ETF 指数投资中心投资执行总经理、基金经理。</p>

	基金经理				
--	------	--	--	--	--

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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

#### 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

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 0.64%，较好地实现了本基金的投资目标。

#### 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 1.3357 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.61%，业绩比较基准收益率为-0.11%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2024 年下半年，中国经济将继续在“稳中求进”的总基调下运行，经济增速有望保持在合理区间。从外部宏观上看，全球流动性有望宽松，一部分主要经济体央行已进入降息周期，全球经济或将持续复苏，分母端的压力减退有望提振权益资产的投资价值。从国内宏观来看，房地产产业的支持性政策刺激下，商品房销售面积数据出现了较为明显的改善，叠加地产开工增速放缓，地产下行最快的时候已经过去。出口端强劲，外贸持续保持顺差，我国的出口市场更加多元化，展现了更强的跨越周期波动的能力。投资端，在三中全会的定调下，对于财政端发力预期会更加清晰。

对于下半年股票投资上看，可以适当更积极乐观一些。对于市场掣肘的因素正在逐步消退，外部流动性随着降息的落地会有回流的诉求，国内基本面的维稳改善提振了投资预期，资产间性价比中股票市场的价值正在逐步突出，政策端对于股票市场机制的不断完善保障了长期的投资价值。

指数化投资在经历市场的震荡中进一步凸显了该投资范式的普遍性，作为基金管理人，我们将继续坚持紧密跟踪标的指数表现的投资目标。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。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委员会，由研究中心及投资管理部门、运营部、风险管理室及法律合规监察部相关人员组成。估值委员会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。估值委员会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。

基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值发生重大变化的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与第三方定价服务机构签署服务协议，由其按约定提供相关参考数据。

#### 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低于 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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——平安基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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本基金 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,883,728.26	2,748,843.76
结算备付金		7,990.00	10,999.30
存出保证金		890.77	992.78
交易性金融资产	6.4.7.2	67,753,378.64	69,655,888.26
其中：股票投资		67,735,096.63	69,620,217.25
基金投资		-	-

债券投资		18,282.01	35,671.01
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	9.60
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,410.07	-
资产总计		72,721,397.74	72,416,733.70
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		30,322.22	30,377.95
应付托管费		6,064.46	6,075.61
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	105,983.03	240,146.81
负债合计		142,369.71	276,600.37
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	54,337,704.00	54,337,704.00
未分配利润	6.4.7.12	18,241,324.03	17,802,429.33
净资产合计		72,579,028.03	72,140,133.33
负债和净资产总计		72,721,397.74	72,416,733.70

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3357 元，基金份额总额 54,337,704.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		930,171.92	-398,311.84
1. 利息收入		5,790.07	5,192.92
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,790.07	5,192.92
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,625,711.40	-281,478.97
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-4,490,200.55	-1,186,100.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-573.87	22.09
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	865,063.02	904,599.81
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	4,544,571.66	-122,947.32
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	5,521.59	921.53
<b>减：二、营业总支出</b>		442,835.20	478,933.99
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	181,636.67	212,769.58
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,327.30	42,553.88
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-

7. 税金及附加		0.02	0.01
8. 其他费用	6.4.7.23	224,871.21	223,610.52
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		487,336.72	-877,245.83
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		487,336.72	-877,245.83
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		487,336.72	-877,245.83

### 6.3 净资产变动表

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: 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	54,337,704.00	-	17,802,429.33	72,140,133.33
二、本期期初净资产	54,337,704.00	-	17,802,429.33	72,140,133.33
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	438,894.70	438,894.70
(一)、综合收益总额	-	-	487,336.72	487,336.72
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-48,442.02	-48,442.02
其中: 1. 基金申购款	3,000,000.00	-	924,009.56	3,924,009.56
2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-	-972,451.58	-3,972,451.58
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	54,337,704.00	-	18,241,324.03	72,579,028.03

项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	57,337,704.00	-	27,940,817.94	85,278,521.94
二、本期期初净资产	57,337,704.00	-	27,940,817.94	85,278,521.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-2,599,642.11	-5,599,642.11
(一)、综合收益总额	-	-	-877,245.83	-877,245.83
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,000,000.00	-	-1,722,396.28	-4,722,396.28
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-3,000,000.00	-	-1,722,396.28	-4,722,396.28
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	54,337,704.00	-	25,341,175.83	79,678,879.83

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，其中网上现金方式认购资金利息折合 15,749.00 份基金份额。本基金的基金管理人为平安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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。本基金主要投资于 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。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)。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。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%。本基金将在基金合同生效之日起 6 个月内达到这一投资比例。此后，如因标的指数成份股调整导致基金不符合这一投资比例的，

基金管理人将在 10 个交易日内进行调整，但中国证监会认定的特殊情形除外。本基金的业绩比较基准为：MSCI 中国 A 股国际指数(MSCI China A International Index)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。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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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

本基金本报告期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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 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、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
活期存款	4,883,728.26
等于：本金	4,883,311.49
加：应计利息	416.77
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	4,883,728.26

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	82,178,628.09	-	67,735,096.63	-14,443,531.46
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	23.71	18,282.01	1,258.30
	银行间市场	-	-	-
	合计	23.71	18,282.01	1,258.30
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	82,195,628.09	23.71	67,753,378.64	-14,442,273.16

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：本基金本报告期末未持有期货合约。

**6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

**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。

**6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。

**6.4.7.5 债权投资**

**6.4.7.5.1 债权投资情况**

注：本基金本报告期末无债权投资。

**6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末无债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资**

**6.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

**6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：本基金本报告期末无其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

**6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：本基金本报告期末无其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-

待摊费用	75,410.07
合计	75,410.07

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
应付交易费用	2,359.93
其中：交易所市场	2,359.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	103,623.10
合计	105,983.03

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	54,337,704.00	54,337,704.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
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	54,337,704.00	54,337,704.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购、赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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	33,790,039.54	-15,987,610.21	17,802,429.33
本期期初	33,790,039.54	-15,987,610.21	17,802,429.33
本期利润	-4,057,234.94	4,544,571.66	487,336.72
本期基金份额交易产生的变动数	28,908.44	-77,350.46	-48,442.02

其中：基金申购款	1,859,096.55	-935,086.99	924,009.56
基金赎回款	-1,830,188.11	857,736.53	-972,451.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	29,761,713.04	-11,520,389.01	18,241,324.03

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		5,717.53
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		65.89
其他		6.65
合计		5,790.07

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-4,084,473.70
股票投资收益——赎回差价收入		-405,726.85
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		-4,490,200.55

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		5,436,229.53
减：卖出股票成本总额		9,510,827.56
减：交易费用		9,875.67
买卖股票差价收入		-4,084,473.70

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额		3,972,451.58
减：现金支付赎回款总额		1,512,467.58
减：赎回股票成本总额		2,865,710.85
减：交易费用		-

赎回差价收入	-405,726.85
--------	-------------

#### 6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期无股票申购差价收入。

#### 6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期无股票投资收益——证券出借差价收入。

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	51.49
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-625.36
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	-573.87

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	15,499.47
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,100.00
减：应计利息总额	24.21
减：交易费用	0.62
买卖债券差价收入	-625.36

##### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

##### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 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。

**6.4.7.17.2 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。

**6.4.7.17.3 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。

**6.4.7.17.4 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。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 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——买卖权证差价收入。

**6.4.7.18.2 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——其他投资收益。

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	865,063.02
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	865,063.02

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	4,544,571.66
股票投资	4,545,855.79
债券投资	-1,284.13
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	4,544,571.66

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	5,521.59
合计	5,521.59

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	18,897.06
信息披露费	39,781.56
证券出借违约金	-
银行费用	245.00
指数使用费	81,413.18
其他	84,534.41
合计	224,871.21

### 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
中国工商银行股份有限公司(“工商银行”)	基金托管人
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
平安信托有限责任公司	基金管理人的股东
深圳平安汇通投资管理有限公司(“平安汇通”)	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
方正证券股份有限公司(“方正证券”)	基金销售机构、与基金管理人受同一最终控股公司控制的公司
中国平安保险(集团)股份有限公司(“平安集团”)	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 ETF 联接基金”)	本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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	1,832,435.91	20.48	-	-

#### 6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

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 2024年1月1日至2024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	1,348.44	20.48	1,346.60	57.06
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023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 (%)
-	-	-	-	-

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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	181,636.67	212,769.58
其中：应支付销售机构的客户维护 费	3,103.93	-
应支付基金管理人的净管理费	178,532.74	212,769.58

注：支付基金管理人平安基金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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	36,327.30	42,553.88

注：支付基金托管行工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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×0.10%/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固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 2024年6月30日		上年度末 2023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	43,856,897.00	80.7117	43,886,897.00	80.7669

注：投资相关费率符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30 日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	4,883,728.26	5,717.53	3,605,460.56	5,143.43

注：本基金的银行存款由基金托管人工商银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 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

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

(1) 于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有 118,300.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 577,613.83 元，估值总额为人民币 674,310.00 元，占基金资产净值的比例为 0.93% (2023 年 6 月 30 日，本基金持有 118,200.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 575,673.01 元，估值总额为人民币 569,724.00 元，占基金资产净值的比例为 0.72%)。

(2) 于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有 20,500.00 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,156,840.71 元，估值总额为人民币 847,880.00 元，占基金资产净值的比例为 1.17% (2023 年 6 月 30 日，本基金持有 20,400.00 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,197,448.57 元，估值总额为人民币 946,560.00 元，占基金资产净值的比例为 1.19%)。

(3) 于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有 36,600.00 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 621,879.36 元，估值总额为人民币 371,490.00 元，占基金资产净值的比例为 0.51% (2023 年 6 月 30 日，本基金持有 36,500.00 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 662,016.99 元，估值总额为人民币 409,895.00 元，占基金资产净值的比例为 0.51%)。

(4) 于 2024 年 6 月 30 日，本基金持有 15,200.00 股方正证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 122,041.07 元，估值总额为人民币 117,496.00 元，占基金资产净值的比例为 0.16% (2023 年 6 月 30 日，本基金持有 16,500.00 股方正证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 134,970.40 元，估值总额为人民币 107,910.00 元，占基金资产净值的比例为 0.14%)。

#### 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（2024 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

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末无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由金融工具产生的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。

本基金管理人秉承全面风险管理的理念，将风险管理融入业务中，建立了由风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部门以及各个业务部门构成的风险管理架构体系。各部门负责人为其所在部门风险管理的第一责任人，公司员工在其岗位职责范围内承担相应风险管理责任。本基金管理人设立风险管理部门，风险管理部门对公司的风险管理进行独立评估、监控、检查并及时向管理层汇报。

#### 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的发行人出现违约、拒绝支付到期本息等导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的投资范围及投资比例符合相关法律法规的要求、相关监管机构的相关规定及本基金的合同要求。本基金管理人通过建立和完善内部信用评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。本基金的活期银行存款存放在具有托管资格的银行；本基金存放定期存款前，均对交易对手进行信用评估以控制相应的信用风险，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与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在银行间同业市场仅与达到本基金管理人既定信用政策标准的交易对手进行交易，并对证券交割方式进行限制，以控制相应的信用风险。本基金以非约定申报方式参与的

转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券；以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，因此违约风险可能性很小。

本基金管理人还通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券，不得超过该证券余额的 10%。

于本报告期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券和资产支持证券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.03%（上年末：0.05%）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险，是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另一方面来自于基金份额持有人可依据基金合同约定要求赎回其持有的基金份额。

本基金的基金管理人专业审慎、勤勉尽责地管控本基金的流动性风险，全覆盖、多维度的建立以压力测试为核心的流动性风险监测与预警制度，确保本基金组合的资产变现能力与投资者赎回需求匹配与平衡。

#### 6.4.13.3.1 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的发行的证券不得超过该证券的 10%。由本基金的基金管理人管理的所有开放式基金于开放期内共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

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。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%。

本基金的基金管理人对其管理的所有开放式基金于开放期内，对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因市场价格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。本基金管理人通过对不同类型的风险分别设定风险限制，并由独立于投资部门的风险管理人员监控、报告以及定期风险回顾的方法管理投资组合的市场风险。

##### 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未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。

本基金管理人通过由风险管理人员定期监控组合中债券投资部分的利率风险，及时调整投资组合久期等方法管理利率风险。

下表统计了本基金的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	4,883,728.26	-	-	-	4,883,728.26
结算备付金	7,990.00	-	-	-	7,990.00
存出保证金	890.77	-	-	-	890.77
交易性金融资产	18,282.01	-	-	67,735,096.63	67,753,378.64
其他资产	-	-	-	75,410.07	75,410.07

资产总计	4,910,891.04	-	-	67,810,506.70	72,721,397.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	30,322.22	30,322.22
应付托管费	-	-	-	6,064.46	6,064.46
其他负债	-	-	-	105,983.03	105,983.03
负债总计	-	-	-	142,369.71	142,369.71
利率敏感度缺口	4,910,891.04	-	-	67,668,136.99	72,579,028.03
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,748,843.76	-	-	-	2,748,843.76
结算备付金	10,999.30	-	-	-	10,999.30
存出保证金	992.78	-	-	-	992.78
交易性金融资产	35,671.01	-	-	69,620,217.25	69,655,888.26
应收清算款	-	-	-	9.60	9.60
资产总计	2,796,506.85	-	-	69,620,226.85	72,416,733.70
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	30,377.95	30,377.95
应付托管费	-	-	-	6,075.61	6,075.61
其他负债	-	-	-	240,146.81	240,146.81
负债总计	-	-	-	276,600.37	276,600.37
利率敏感度缺口	2,796,506.85	-	-	69,343,626.48	72,140,133.33

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，本基金持有交易性债券投资和交易性资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.03%（上年度末：0.05%），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）。

#### 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。本基金持有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

其他价格风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因除外汇风险和利率风险以外的市场

价格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或银行间同业市场交易的证券，所面临的重大价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低其它价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

经测算本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	67,735,096.63	93.33	69,620,217.25	96.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	67,735,096.63	93.33	69,620,217.25	96.51

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除“沪深300指数”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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）	
分析	沪深300指数上升5%	3,757,484.90	3,271,101.46
	沪深300指数下降5%	-3,757,484.90	-3,271,101.46

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	67,753,378.64	69,655,888.26
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	67,753,378.64	69,655,888.26

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃、非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

#### 6.4.15 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	67,735,096.63	93.14
	其中：股票	67,735,096.63	93.14

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	18,282.01	0.03
	其中：债券	18,282.01	0.03
	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	4,891,718.26	6.73
8	其他各项资产	76,300.84	0.10
9	合计	72,721,397.74	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	746,899.00	1.03
B	采矿业	4,501,304.74	6.20
C	制造业	36,185,631.64	49.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,577,619.00	4.93
E	建筑业	1,434,957.40	1.98
F	批发和零售业	459,366.68	0.63
G	交通运输、仓储和邮政业	2,740,867.52	3.78
H	住宿和餐饮业	41,364.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,376,618.76	3.27
J	金融业	13,650,551.34	18.81
K	房地产业	633,330.20	0.87
L	租赁和商务服务业	519,449.81	0.72
M	科学研究和技术服务业	277,140.66	0.38
N	水利、环境和公共设施管理业	69,560.40	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	203,425.28	0.28
R	文化、体育和娱乐业	238,908.00	0.33
S	综合	41,536.00	0.06

	合计	67,698,530.43	93.28
--	----	---------------	-------

### 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	34,060.27	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	149.50	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	404.80	0.00
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	1,857.63	0.00
J	金融业	94.00	0.00
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	36,566.20	0.05

### 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	2,400	3,521,736.00	4.85
2	300750	宁德时代	8,360	1,505,050.80	2.07
3	600900	长江电力	46,500	1,344,780.00	1.85
4	600036	招商银行	39,200	1,340,248.00	1.85
5	000858	五粮液	7,400	947,496.00	1.31

6	002594	比亚迪	3,400	850,850.00	1.17
7	601318	中国平安	20,500	847,880.00	1.17
8	601288	农业银行	161,900	705,884.00	0.97
9	601166	兴业银行	39,100	688,942.00	0.95
10	601899	紫金矿业	39,200	688,744.00	0.95
11	601138	工业富联	24,900	682,260.00	0.94
12	601398	工商银行	118,300	674,310.00	0.93
13	300760	迈瑞医疗	2,300	669,093.00	0.92
14	601328	交通银行	73,900	552,033.00	0.76
15	601088	中国神华	12,400	550,188.00	0.76
16	002475	立讯精密	13,422	527,618.82	0.73
17	601816	京沪高铁	92,300	495,651.00	0.68
18	600809	山西汾酒	2,320	489,241.60	0.67
19	600309	万华化学	5,900	477,074.00	0.66
20	601225	陕西煤业	18,200	469,014.00	0.65
21	600276	恒瑞医药	11,960	459,981.60	0.63
22	600000	浦发银行	55,400	455,942.00	0.63
23	002714	牧原股份	10,373	452,262.80	0.62
24	000333	美的集团	6,600	425,700.00	0.59
25	601857	中国石油	41,100	424,152.00	0.58
26	600030	中信证券	23,030	419,836.90	0.58
27	601668	中国建筑	78,940	419,171.40	0.58
28	000568	泸州老窖	2,800	401,772.00	0.55
29	600028	中国石化	61,700	389,944.00	0.54
30	601985	中国核电	35,900	382,694.00	0.53
31	600406	国电南瑞	15,134	377,744.64	0.52
32	000001	平安银行	36,600	371,490.00	0.51
33	601919	中远海控	23,960	371,140.40	0.51
34	601601	中国太保	13,000	362,180.00	0.50
35	601766	中国中车	46,300	347,713.00	0.48
36	600150	中国船舶	8,500	346,035.00	0.48
37	600690	海尔智家	12,000	340,560.00	0.47
38	002352	顺丰控股	9,200	328,348.00	0.45
39	002371	北方华创	1,000	319,890.00	0.44
40	300059	东方财富	29,990	316,694.40	0.44
41	600887	伊利股份	12,033	310,932.72	0.43
42	688041	海光信息	4,400	309,408.00	0.43
43	601988	中国银行	66,800	308,616.00	0.43
44	603288	海天味业	8,701	299,923.47	0.41
45	300308	中际旭创	2,100	289,548.00	0.40
46	000725	京东方 A	70,600	288,754.00	0.40
47	603993	洛阳钼业	33,300	283,050.00	0.39
48	600050	中国联通	59,100	277,770.00	0.38

49	601658	邮储银行	54,700	277,329.00	0.38
50	601818	光大银行	87,200	276,424.00	0.38
51	600019	宝钢股份	41,200	273,980.00	0.38
52	002142	宁波银行	12,400	273,544.00	0.38
53	600031	三一重工	15,700	259,050.00	0.36
54	600919	江苏银行	34,530	256,557.90	0.35
55	601390	中国中铁	39,200	255,584.00	0.35
56	600886	国投电力	14,000	255,360.00	0.35
57	601127	赛力斯	2,800	255,136.00	0.35
58	300498	温氏股份	12,660	250,921.20	0.35
59	600016	民生银行	65,600	248,624.00	0.34
60	300274	阳光电源	3,920	243,157.60	0.34
61	600989	宝丰能源	13,800	239,154.00	0.33
62	601006	大秦铁路	33,400	239,144.00	0.33
63	600905	三峡能源	53,900	235,004.00	0.32
64	601169	北京银行	39,700	231,848.00	0.32
65	603501	韦尔股份	2,330	231,532.10	0.32
66	600436	片仔癀	1,100	227,887.00	0.31
67	601888	中国中免	3,629	226,776.21	0.31
68	002304	洋河股份	2,800	226,072.00	0.31
69	000651	格力电器	5,400	211,788.00	0.29
70	000063	中兴通讯	7,500	209,775.00	0.29
71	601009	南京银行	20,100	208,839.00	0.29
72	000338	潍柴动力	12,800	207,872.00	0.29
73	600104	上汽集团	14,900	206,514.00	0.28
74	000625	长安汽车	15,314	205,667.02	0.28
75	600795	国电电力	33,500	200,665.00	0.28
76	601012	隆基绿能	14,225	199,434.50	0.27
77	600048	保利发展	22,500	197,100.00	0.27
78	601229	上海银行	26,726	194,030.76	0.27
79	600999	招商证券	13,910	193,488.10	0.27
80	601211	国泰君安	14,100	191,055.00	0.26
81	002230	科大讯飞	4,400	188,980.00	0.26
82	002493	荣盛石化	19,400	187,404.00	0.26
83	601600	中国铝业	24,500	186,935.00	0.26
84	600660	福耀玻璃	3,900	186,810.00	0.26
85	603259	药明康德	4,764	186,701.16	0.26
86	600893	航发动力	5,089	186,002.95	0.26
87	600547	山东黄金	6,788	185,855.44	0.26
88	600346	恒力石化	13,280	185,256.00	0.26
89	000792	盐湖股份	10,500	183,225.00	0.25
90	000166	申万宏源	42,400	182,744.00	0.25
91	688111	金山办公	800	182,000.00	0.25

92	601669	中国电建	32,500	181,675.00	0.25
93	300015	爱尔眼科	17,604	181,673.28	0.25
94	600585	海螺水泥	7,700	181,643.00	0.25
95	002938	鹏鼎控股	4,400	174,944.00	0.24
96	601688	华泰证券	14,100	174,699.00	0.24
97	600674	川投能源	9,300	174,375.00	0.24
98	000538	云南白药	3,355	171,608.25	0.24
99	688036	传音控股	2,240	171,449.60	0.24
100	600011	华能国际	17,700	170,274.00	0.23
101	688012	中微公司	1,200	169,512.00	0.23
102	000596	古井贡酒	800	168,856.00	0.23
103	300433	蓝思科技	9,200	167,900.00	0.23
104	600188	兖矿能源	7,300	165,929.00	0.23
105	002027	分众传媒	27,260	165,195.60	0.23
106	601628	中国人寿	5,300	164,565.00	0.23
107	688271	联影医疗	1,500	164,550.00	0.23
108	600438	通威股份	8,500	162,435.00	0.22
109	601111	中国国航	22,000	162,360.00	0.22
110	600015	华夏银行	25,300	161,920.00	0.22
111	000425	徐工机械	22,600	161,590.00	0.22
112	600023	浙能电力	22,000	156,420.00	0.22
113	601066	中信建投	8,100	155,844.00	0.21
114	600837	海通证券	18,100	154,936.00	0.21
115	300014	亿纬锂能	3,833	153,013.36	0.21
116	000100	TCL 科技	35,260	152,323.20	0.21
117	000895	双汇发展	6,400	152,128.00	0.21
118	601881	中国银河	13,800	149,868.00	0.21
119	001979	招商蛇口	16,800	147,672.00	0.20
120	002311	海大集团	3,100	145,855.00	0.20
121	600926	杭州银行	10,980	143,289.00	0.20
122	600489	中金黄金	9,500	140,600.00	0.19
123	688256	寒武纪	700	139,069.00	0.19
124	002463	沪电股份	3,780	137,970.00	0.19
125	300502	新易盛	1,300	137,215.00	0.19
126	601872	招商轮船	16,200	136,890.00	0.19
127	000776	广发证券	11,100	135,087.00	0.19
128	003816	中国广核	29,100	134,733.00	0.19
129	601995	中金公司	4,500	133,245.00	0.18
130	601939	建设银行	17,800	131,720.00	0.18
131	600160	巨化股份	5,400	130,302.00	0.18
132	600089	特变电工	9,360	129,823.20	0.18
133	603392	万泰生物	1,968	129,651.84	0.18
134	605499	东鹏饮料	600	129,450.00	0.18

135	601868	中国能建	61,000	129,320.00	0.18
136	600115	中国东航	32,200	129,122.00	0.18
137	600845	宝信软件	4,042	129,061.06	0.18
138	300124	汇川技术	2,500	128,250.00	0.18
139	688008	澜起科技	2,200	125,752.00	0.17
140	000002	万科 A	18,000	124,740.00	0.17
141	300122	智飞生物	4,450	124,733.50	0.17
142	601825	沪农商行	18,400	123,648.00	0.17
143	603986	兆易创新	1,288	123,158.56	0.17
144	002241	歌尔股份	6,300	122,913.00	0.17
145	601633	长城汽车	4,800	121,440.00	0.17
146	601100	恒立液压	2,592	120,735.36	0.17
147	000938	紫光股份	5,398	120,645.30	0.17
148	600111	北方稀土	7,000	120,400.00	0.17
149	600029	南方航空	20,400	120,156.00	0.17
150	002648	卫星化学	6,640	119,387.20	0.16
151	601901	方正证券	15,200	117,496.00	0.16
152	601336	新华保险	3,900	117,117.00	0.16
153	601689	拓普集团	2,100	112,581.00	0.16
154	601916	浙商银行	40,520	111,835.20	0.15
155	688223	晶科能源	15,700	111,470.00	0.15
156	600703	三安光电	9,500	111,340.00	0.15
157	603369	今世缘	2,400	110,880.00	0.15
158	002001	新和成	5,720	109,824.00	0.15
159	600027	华电国际	15,800	109,652.00	0.15
160	000983	山西焦煤	10,630	109,595.30	0.15
161	601838	成都银行	7,200	109,368.00	0.15
162	000157	中联重科	14,200	109,056.00	0.15
163	600066	宇通客车	4,200	108,360.00	0.15
164	600039	四川路桥	13,700	108,093.00	0.15
165	600026	中远海能	6,912	107,896.32	0.15
166	002916	深南电路	1,016	107,462.32	0.15
167	601788	光大证券	7,300	106,726.00	0.15
168	600426	华鲁恒升	4,000	106,560.00	0.15
169	600233	圆通速递	6,800	106,420.00	0.15
170	300896	爱美客	616	106,013.60	0.15
171	000999	华润三九	2,470	105,172.60	0.14
172	300408	三环集团	3,600	105,084.00	0.14
173	600958	东方证券	13,824	105,062.40	0.14
174	600584	长电科技	3,300	104,643.00	0.14
175	600522	中天科技	6,600	104,610.00	0.14
176	601618	中国中冶	33,600	104,160.00	0.14
177	300033	同花顺	1,000	103,700.00	0.14

178	002736	国信证券	11,900	103,411.00	0.14
179	600875	东方电气	5,600	103,320.00	0.14
180	601360	三六零	13,400	102,912.00	0.14
181	000977	浪潮信息	2,824	102,708.88	0.14
182	001965	招商公路	8,600	101,996.00	0.14
183	600600	青岛啤酒	1,400	101,878.00	0.14
184	601699	潞安环能	5,600	101,528.00	0.14
185	601021	春秋航空	1,800	101,394.00	0.14
186	300832	新产业	1,500	101,160.00	0.14
187	000786	北新建材	3,400	100,844.00	0.14
188	601117	中国化学	12,200	100,528.00	0.14
189	002028	思源电气	1,500	100,350.00	0.14
190	600362	江西铜业	4,200	99,456.00	0.14
191	601607	上海医药	5,200	99,372.00	0.14
192	600085	同仁堂	2,600	99,346.00	0.14
193	000301	东方盛虹	12,400	98,828.00	0.14
194	002252	上海莱士	12,500	97,750.00	0.13
195	600741	华域汽车	5,900	96,642.00	0.13
196	600803	新奥股份	4,600	95,680.00	0.13
197	600183	生益科技	4,500	94,770.00	0.13
198	601567	三星医疗	2,700	94,500.00	0.13
199	601319	中国人保	18,300	94,245.00	0.13
200	688396	华润微	2,500	93,600.00	0.13
201	000807	云铝股份	6,900	93,219.00	0.13
202	002236	大华股份	6,000	92,760.00	0.13
203	300628	亿联网络	2,520	92,660.40	0.13
204	002600	领益智造	13,000	92,560.00	0.13
205	000963	华东医药	3,300	91,773.00	0.13
206	600161	天坛生物	3,739	91,231.60	0.13
207	000975	山金国际	5,600	91,224.00	0.13
208	002422	科伦药业	3,000	90,990.00	0.13
209	600219	南山铝业	23,830	90,792.30	0.13
210	600196	复星医药	4,100	90,774.00	0.13
211	603195	公牛集团	1,160	89,459.20	0.12
212	002128	电投能源	4,200	88,620.00	0.12
213	601077	渝农商行	17,600	88,352.00	0.12
214	002460	赣锋锂业	3,080	88,242.00	0.12
215	002601	龙佰集团	4,700	87,279.00	0.12
216	600176	中国巨石	7,887	87,151.35	0.12
217	002920	德赛西威	1,000	87,090.00	0.12
218	000933	神火股份	4,300	86,989.00	0.12
219	000708	中信特钢	6,400	86,848.00	0.12
220	688009	中国通号	14,457	86,742.00	0.12

221	300394	天孚通信	980	86,651.60	0.12
222	601727	上海电气	23,400	86,580.00	0.12
223	600642	申能股份	9,800	86,534.00	0.12
224	600256	广汇能源	12,900	86,430.00	0.12
225	000617	中油资本	15,600	86,112.00	0.12
226	002049	紫光国微	1,620	85,212.00	0.12
227	600733	北汽蓝谷	10,500	84,840.00	0.12
228	300999	金龙鱼	3,100	84,785.00	0.12
229	000630	铜陵有色	23,400	84,474.00	0.12
230	601168	西部矿业	4,700	84,365.00	0.12
231	600398	海澜之家	9,100	84,084.00	0.12
232	601058	赛轮轮胎	6,000	84,000.00	0.12
233	002466	天齐锂业	2,780	83,149.80	0.11
234	601377	兴业证券	16,430	83,135.80	0.11
235	000876	新希望	9,000	82,260.00	0.11
236	601179	中国西电	10,200	82,008.00	0.11
237	600985	淮北矿业	4,800	80,352.00	0.11
238	601877	正泰电器	4,200	80,052.00	0.11
239	600332	白云山	2,700	79,191.00	0.11
240	605117	德业股份	1,058	78,651.72	0.11
241	688169	石头科技	200	78,520.00	0.11
242	300782	卓胜微	1,005	78,128.70	0.11
243	688188	柏楚电子	420	77,511.00	0.11
244	600009	上海机场	2,400	77,400.00	0.11
245	601878	浙商证券	7,200	77,184.00	0.11
246	002625	光启技术	4,400	76,340.00	0.11
247	600018	上港集团	13,100	75,718.00	0.10
248	600415	小商品城	10,200	75,684.00	0.10
249	002078	太阳纸业	5,400	75,330.00	0.10
250	002223	鱼跃医疗	2,000	75,200.00	0.10
251	000423	东阿阿胶	1,200	75,120.00	0.10
252	601233	桐昆股份	4,700	75,012.00	0.10
253	603198	迎驾贡酒	1,300	74,750.00	0.10
254	601238	广汽集团	9,600	74,304.00	0.10
255	600918	中泰证券	13,100	74,277.00	0.10
256	688187	时代电气	1,500	74,070.00	0.10
257	300866	安克创新	1,040	74,058.40	0.10
258	300413	芒果超媒	3,540	73,986.00	0.10
259	603806	福斯特	5,018	73,764.60	0.10
260	000661	长春高新	800	73,416.00	0.10
261	600061	国投资本	12,936	73,088.40	0.10
262	688126	沪硅产业	5,272	72,806.32	0.10
263	601865	福莱特	3,600	72,360.00	0.10

264	000408	藏格矿业	3,000	72,210.00	0.10
265	600487	亨通光电	4,560	71,911.20	0.10
266	600096	云天化	3,700	71,854.00	0.10
267	300316	晶盛机电	2,500	71,825.00	0.10
268	002180	纳思达	2,700	71,334.00	0.10
269	002459	晶澳科技	6,356	71,187.20	0.10
270	688599	天合光能	4,200	71,064.00	0.10
271	601991	大唐发电	23,600	71,036.00	0.10
272	002064	华峰化学	9,900	70,983.00	0.10
273	300418	昆仑万维	2,200	70,928.00	0.10
274	002532	天山铝业	8,700	70,557.00	0.10
275	002384	东山精密	3,400	70,380.00	0.10
276	600348	华阳股份	7,050	70,218.00	0.10
277	603260	合盛硅业	1,500	70,065.00	0.10
278	300661	圣邦股份	845	69,949.10	0.10
279	603568	伟明环保	3,380	69,560.40	0.10
280	603799	华友钴业	3,117	68,979.21	0.10
281	600515	海南机场	21,700	68,138.00	0.09
282	600745	闻泰科技	2,400	67,800.00	0.09
283	000027	深圳能源	9,280	67,744.00	0.09
284	688303	大全能源	3,300	67,287.00	0.09
285	002353	杰瑞股份	1,900	66,652.00	0.09
286	300765	新诺威	2,640	66,607.20	0.09
287	600418	江淮汽车	4,200	66,528.00	0.09
288	600177	雅戈尔	9,340	66,500.80	0.09
289	601577	长沙银行	8,100	66,258.00	0.09
290	002709	天赐材料	3,760	66,025.60	0.09
291	002129	TCL 中环	7,625	65,956.25	0.09
292	600570	恒生电子	3,719	65,677.54	0.09
293	002050	三花智控	3,400	64,872.00	0.09
294	300751	迈为股份	540	64,519.20	0.09
295	601958	金钼股份	6,100	63,501.00	0.09
296	600588	用友网络	6,350	63,500.00	0.09
297	603606	东方电缆	1,300	63,453.00	0.09
298	301236	软通动力	1,800	63,378.00	0.09
299	002074	国轩高科	3,300	63,195.00	0.09
300	002156	通富微电	2,800	62,692.00	0.09
301	300442	润泽科技	2,600	62,270.00	0.09
302	600060	海信视像	2,500	61,850.00	0.09
303	601216	君正集团	16,700	61,623.00	0.08
304	000932	华菱钢铁	13,740	60,868.20	0.08
305	603979	金诚信	1,200	60,636.00	0.08
306	600970	中材国际	5,000	60,300.00	0.08

307	600873	梅花生物	6,000	60,120.00	0.08
308	601108	财通证券	9,060	59,886.60	0.08
309	002812	恩捷股份	1,880	59,502.00	0.08
310	603899	晨光股份	1,900	59,432.00	0.08
311	601555	东吴证券	9,939	58,640.10	0.08
312	002340	格林美	9,200	58,604.00	0.08
313	600282	南钢股份	11,700	58,266.00	0.08
314	000921	海信家电	1,800	58,032.00	0.08
315	600038	中直股份	1,400	57,554.00	0.08
316	002555	三七互娱	4,400	57,420.00	0.08
317	002595	豪迈科技	1,500	57,255.00	0.08
318	000988	华工科技	1,900	56,867.00	0.08
319	601990	南京证券	7,400	56,832.00	0.08
320	002444	巨星科技	2,300	56,810.00	0.08
321	600109	国金证券	7,500	56,625.00	0.08
322	688120	华海清科	298	56,494.84	0.08
323	300919	中伟股份	1,820	56,401.80	0.08
324	601231	环旭电子	3,500	56,175.00	0.08
325	603939	益丰药房	2,288	56,170.40	0.08
326	002281	光迅科技	1,500	56,055.00	0.08
327	601799	星宇股份	500	56,020.00	0.08
328	002294	信立泰	2,100	55,923.00	0.08
329	600352	浙江龙盛	6,500	55,835.00	0.08
330	603659	璞泰来	3,944	55,728.72	0.08
331	002673	西部证券	9,000	55,710.00	0.08
332	603338	浙江鼎力	920	55,586.40	0.08
333	600546	山煤国际	3,800	55,556.00	0.08
334	000066	中国长城	6,300	55,125.00	0.08
335	603160	汇顶科技	800	55,000.00	0.08
336	600079	人福医药	3,200	54,944.00	0.08
337	688777	中控技术	1,450	54,665.00	0.08
338	600132	重庆啤酒	900	54,630.00	0.08
339	600582	天地科技	7,900	54,431.00	0.07
340	600460	士兰微	3,100	54,281.00	0.07
341	301269	华大九天	700	53,935.00	0.07
342	600497	驰宏锌锗	10,100	53,934.00	0.07
343	600988	赤峰黄金	3,300	53,922.00	0.07
344	600566	济川药业	1,700	53,907.00	0.07
345	000783	长江证券	11,100	53,613.00	0.07
346	600895	张江高科	2,900	53,592.00	0.07
347	300003	乐普医疗	3,600	53,424.00	0.07
348	600021	上海电力	5,400	53,406.00	0.07
349	601966	玲珑轮胎	2,900	53,273.00	0.07

350	002739	万达电影	4,400	53,196.00	0.07
351	600968	海油发展	12,900	53,148.00	0.07
352	002085	万丰奥威	4,000	52,960.00	0.07
353	000728	国元证券	8,730	52,903.80	0.07
354	002007	华兰生物	3,340	52,738.60	0.07
355	601666	平煤股份	4,700	52,640.00	0.07
356	688072	拓荆科技	438	52,608.18	0.07
357	601928	凤凰传媒	4,800	52,608.00	0.07
358	600583	海油工程	8,900	52,599.00	0.07
359	002966	苏州银行	7,000	52,500.00	0.07
360	603156	养元饮品	2,460	52,324.20	0.07
361	603486	科沃斯	1,100	51,898.00	0.07
362	600153	建发股份	5,800	51,794.00	0.07
363	300207	欣旺达	3,400	51,578.00	0.07
364	300759	康龙化成	2,775	51,559.50	0.07
365	000703	恒逸石化	7,250	51,402.50	0.07
366	002185	华天科技	6,300	51,345.00	0.07
367	002152	广电运通	4,900	51,254.00	0.07
368	000683	远兴能源	7,400	51,134.00	0.07
369	000960	锡业股份	3,300	51,117.00	0.07
370	601866	中远海发	19,800	51,084.00	0.07
371	002939	长城证券	7,600	50,920.00	0.07
372	688363	华熙生物	900	50,913.00	0.07
373	000831	中国稀土	2,000	50,700.00	0.07
374	300251	光线传媒	6,000	50,460.00	0.07
375	002602	世纪华通	14,700	50,421.00	0.07
376	603816	顾家家居	1,560	50,372.40	0.07
377	002409	雅克科技	800	50,328.00	0.07
378	000738	航发控制	2,500	50,175.00	0.07
379	601198	东兴证券	6,300	50,148.00	0.07
380	002032	苏泊尔	1,000	50,100.00	0.07
381	002603	以岭药业	3,260	49,975.80	0.07
382	688065	凯赛生物	1,100	49,929.00	0.07
383	300223	北京君正	900	49,896.00	0.07
384	688728	格科微	4,100	49,651.00	0.07
385	600521	华海药业	2,900	49,445.00	0.07
386	002414	高德红外	8,378	49,346.42	0.07
387	603833	欧派家居	920	49,275.20	0.07
388	601696	中银证券	5,400	49,032.00	0.07
389	603658	安图生物	1,060	48,834.20	0.07
390	600998	九州通	9,956	48,585.28	0.07
391	000800	一汽解放	6,200	48,546.00	0.07
392	000729	燕京啤酒	5,400	47,682.00	0.07

393	002456	欧菲光	6,100	47,641.00	0.07
394	600298	安琪酵母	1,700	47,481.00	0.07
395	002372	伟星新材	3,060	47,185.20	0.07
396	600369	西南证券	13,100	46,898.00	0.06
397	600549	厦门钨业	2,700	46,575.00	0.06
398	002202	金风科技	6,900	46,368.00	0.06
399	600511	国药股份	1,500	46,185.00	0.06
400	603885	吉祥航空	4,200	46,158.00	0.06
401	300146	汤臣倍健	3,400	46,070.00	0.06
402	002831	裕同科技	1,800	46,062.00	0.06
403	002465	海格通信	4,424	45,832.64	0.06
404	000937	冀中能源	6,800	45,560.00	0.06
405	600536	中国软件	1,521	45,508.32	0.06
406	002120	韵达股份	5,870	45,433.80	0.06
407	600704	物产中大	10,400	45,136.00	0.06
408	002262	恩华药业	1,900	45,106.00	0.06
409	603345	安井食品	600	44,586.00	0.06
410	600004	白云机场	4,700	44,556.00	0.06
411	002430	杭氧股份	2,000	44,500.00	0.06
412	600486	扬农化工	780	44,031.00	0.06
413	000009	中国宝安	5,100	43,860.00	0.06
414	000513	丽珠集团	1,178	43,833.38	0.06
415	603529	爱玛科技	1,600	43,728.00	0.06
416	600598	北大荒	3,500	43,715.00	0.06
417	603596	伯特利	1,120	43,568.00	0.06
418	000629	钒钛股份	17,300	43,250.00	0.06
419	688538	和辉光电	21,800	43,164.00	0.06
420	603589	口子窖	1,100	43,109.00	0.06
421	688122	西部超导	1,120	42,918.40	0.06
422	002080	中材科技	3,300	42,570.00	0.06
423	600380	健康元	3,808	42,535.36	0.06
424	688082	盛美上海	500	42,255.00	0.06
425	002797	第一创业	8,300	42,247.00	0.06
426	600848	上海临港	4,620	42,088.20	0.06
427	002508	老板电器	1,900	41,990.00	0.06
428	603000	人民网	2,100	41,979.00	0.06
429	300144	宋城演艺	5,200	41,756.00	0.06
430	600673	东阳光	5,900	41,536.00	0.06
431	000733	振华科技	1,000	41,530.00	0.06
432	688099	晶晨股份	700	41,524.00	0.06
433	603893	瑞芯微	700	41,419.00	0.06
434	600754	锦江酒店	1,800	41,364.00	0.06
435	000709	河钢股份	21,300	41,322.00	0.06

436	600637	东方明珠	6,790	41,283.20	0.06
437	600977	中国电影	3,800	40,888.00	0.06
438	600655	豫园股份	7,900	40,685.00	0.06
439	000723	美锦能源	8,500	40,460.00	0.06
439	600378	昊华科技	1,400	40,460.00	0.06
440	300454	深信服	800	40,424.00	0.06
441	000987	越秀资本	8,053	39,942.88	0.06
442	600705	中航产融	17,900	39,738.00	0.05
443	600699	均胜电子	2,680	39,717.60	0.05
444	600909	华安证券	9,410	39,616.10	0.05
445	002821	凯莱英	600	39,480.00	0.05
446	600008	首创环保	14,650	39,262.00	0.05
447	300347	泰格医药	800	38,880.00	0.05
448	300037	新宙邦	1,360	38,841.60	0.05
449	002056	横店东磁	3,100	38,657.00	0.05
450	300957	贝泰妮	800	38,656.00	0.05
451	601456	国联证券	4,000	38,560.00	0.05
452	002841	视源股份	1,300	38,389.00	0.05
453	600170	上海建工	17,800	38,270.00	0.05
454	002517	恺英网络	4,000	38,200.00	0.05
455	002850	科达利	500	38,190.00	0.05
456	600839	四川长虹	8,500	38,165.00	0.05
457	601162	天风证券	17,500	38,150.00	0.05
458	688114	华大智造	800	37,928.00	0.05
459	600072	中船科技	2,800	37,856.00	0.05
460	300487	蓝晓科技	900	37,584.00	0.05
461	000825	太钢不锈	11,100	37,518.00	0.05
462	002738	中矿资源	1,376	36,876.80	0.05
463	300496	中科创达	800	36,472.00	0.05
464	600872	中炬高新	1,600	36,304.00	0.05
465	603290	斯达半导	420	36,166.20	0.05
466	300699	光威复材	1,440	35,755.20	0.05
467	600884	杉杉股份	4,400	35,728.00	0.05
468	300142	沃森生物	3,100	35,278.00	0.05
469	600702	舍得酒业	600	34,002.00	0.05
470	600166	福田汽车	15,100	33,975.00	0.05
471	600779	水井坊	900	33,867.00	0.05
472	002756	永兴材料	910	32,559.80	0.04
473	300601	康泰生物	2,080	32,468.80	0.04
474	603728	鸣志电器	800	32,184.00	0.04
475	603233	大参林	2,200	31,460.00	0.04
476	300763	锦浪科技	750	31,230.00	0.04
477	603688	石英股份	1,050	31,090.50	0.04

478	600563	法拉电子	400	30,472.00	0.04
479	600732	爱旭股份	3,360	30,408.00	0.04
480	002271	东方雨虹	2,400	29,616.00	0.04
481	603882	金域医学	800	21,752.00	0.03

### 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	600885	宏发股份	960	26,572.80	0.04
2	300595	欧普康视	90	1,411.20	0.00
3	688516	奥特维	29	1,212.49	0.00
4	002541	鸿路钢构	70	1,187.90	0.00
5	603613	国联股份	59	1,156.99	0.00
6	603858	步长制药	76	1,151.40	0.00
7	300568	星源材质	95	779.00	0.00
8	002865	钧达股份	19	729.22	0.00
9	600056	中国医药	40	404.80	0.00
10	002153	石基信息	68	389.64	0.00
11	605358	立昂微	16	370.24	0.00
12	300769	德方纳米	12	338.40	0.00
13	002405	四维图新	50	311.00	0.00
14	603185	弘元绿能	18	307.62	0.00
15	601016	节能风电	50	149.50	0.00
16	002500	山西证券	20	94.00	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	000333	美的集团	416,920.00	0.58
2	600519	贵州茅台	168,810.00	0.23
3	300750	宁德时代	115,504.00	0.16
4	000708	中信特钢	96,448.00	0.13
5	001965	招商公路	93,808.00	0.13
6	000858	五粮液	82,715.00	0.11
7	000921	海信家电	72,990.00	0.10
8	601567	三星医疗	71,849.00	0.10
9	603979	金诚信	67,104.00	0.09
10	601881	中国银河	61,292.00	0.08
11	601666	平煤股份	60,818.00	0.08
12	600282	南钢股份	60,606.00	0.08
13	002085	万丰奥威	59,960.00	0.08
14	300760	迈瑞医疗	58,982.00	0.08

15	688041	海光信息	56,176.00	0.08
16	600582	天地科技	56,090.00	0.08
17	600968	海油发展	53,793.00	0.07
18	000568	泸州老窖	47,974.00	0.07
19	603233	大参林	44,073.00	0.06
20	601006	大秦铁路	39,518.00	0.05

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	600010	包钢股份	123,552.00	0.17
2	600221	海航控股	112,470.00	0.16
3	300750	宁德时代	77,620.00	0.11
4	000858	五粮液	55,921.00	0.08
5	600157	永泰能源	55,485.00	0.08
6	002244	滨江集团	51,900.00	0.07
7	603233	大参林	50,368.50	0.07
8	601155	新城控股	49,931.00	0.07
9	688032	禾迈股份	49,400.21	0.07
10	002568	百润股份	48,731.92	0.07
11	601880	辽港股份	48,279.00	0.07
12	688301	奕瑞科技	48,274.80	0.07
13	002138	顺络电子	46,522.00	0.06
14	000069	华侨城 A	46,032.00	0.06
15	300724	捷佳伟创	45,883.00	0.06
16	601933	永辉超市	45,802.00	0.06
17	002926	华西证券	44,383.00	0.06
18	002299	圣农发展	44,193.00	0.06
19	601615	明阳智能	43,157.00	0.06
20	603737	三棵树	42,908.60	0.06

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	3,510,035.00
卖出股票收入（成交）总额	5,436,229.53

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	18,282.01	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	18,282.01	0.03

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113661	福 22 转债	70	7,444.87	0.01
2	113059	福莱转债	60	6,408.72	0.01
3	118030	睿创转债	40	4,428.42	0.01

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期无股指期货投资。

## 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

本基金本报告期无国债期货投资。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 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

根据发布的相关公告，本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、

招商银行股份有限公司在本报告编制日前一年内受到监管部门的公开谴责或处罚。

本基金投资上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

### 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

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选库以外的股票。

### 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	890.77
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,410.07
8	其他	-
9	合计	76,300.84

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	113661	福 22 转债	7,444.87	0.01
2	113059	福莱转债	6,408.72	0.01
3	118030	睿创转债	4,428.42	0.01

### 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无流通受限的股票。

#### 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

### 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	户均持有的	持有人结构
-------	-------	-------

(户)	基金份额	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 (%)
289	188,019.74	48,705,580.00	89.63	5,632,124.00	10.37

### 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	43,856,897.00	80.71

### 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	海通证券股份有限公司	2,249,176.00	4.14
2	广发证券股份有限公司	2,196,200.00	4.04
3	李莉	1,000,000.00	1.84
4	华泰证券股份有限公司	400,009.00	0.74
5	叶意琴	290,000.00	0.53
6	戴和平	254,900.00	0.47
7	徐翠华	250,708.00	0.46
8	曹洪祥	230,000.00	0.42
9	黄思宁	196,000.00	0.36
10	纪远升	140,981.00	0.26
11	中国工商银行股份有限公司—平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金联接基金	43,856,897.00	80.71

### 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、基金投资和研发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	54,337,704.00
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	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	54,337,704.00

## § 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

本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

本报告期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

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内托管人及其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 (%)	
海通证券	4	2,904,821.00	32.47	2,137.70	32.47	-

平安证券	2	1,832,435.91	20.48	1,348.44	20.48	-
中信建投证券	2	1,631,622.70	18.24	1,200.72	18.24	-
长江证券	1	1,418,988.00	15.86	1,044.25	15.86	-
国盛证券	1	1,158,396.92	12.95	852.62	12.95	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券	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比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	15,499.47	100.00	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-

东方证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 03 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招募说明书(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 03 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基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 04 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基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 05 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	2024 年 01 月 05 日
6	平安基金管理有限公司关于提醒投资者及时完善、更新身份信息资料以免影响业务办理的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 15 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 2023 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 01 月 19 日
8	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增国金证券股份有限公司为申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 月 21 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 2023 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 03 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 2024 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 04 月 19 日
11	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	2024 年 05 月 31 日
12	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产品资料概要	中国证监会规定报刊及网站	2024 年 05 月 31 日

更新		
----	--	--

## § 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	2024 年 01 月 01 日-2024 年 06 月 30 日	43,886,897.00	300,000.00	330,000.00	43,856,897.00	80.71
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>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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募集注册的文件
- (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) 法律意见书
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

### 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) 投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件

(2) 投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人平安基金管理有限公司,客户服务电话: 400-800-4800 (免长途话费)

平安基金管理有限公司

2024 年 8 月 31 日