

平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指 数证券投资基金 2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
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
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
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
§ 4 管理人报告	8
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
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	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	55

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	55
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	55
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12	投资组合报告附注	56
§ 8	基金份额持有人信息	57
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	57
8.2	期末上市基金前十名持有人	57
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
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	57
§ 9	开放式基金份额变动	58
§ 10	重大事件揭示	58
10.1	基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4	基金投资策略的改变	58
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
10.8	其他重大事件	60
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	61
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	61
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	61
§ 12	备查文件目录	61
12.1	备查文件目录	61
12.2	存放地点	62
12.3	查阅方式	62

§ 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	郭明
	联系电话	0755-22626828	(010)66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588

传真	0755-23997878	(010)66105798
注册地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	518048	100140
法定代表人	罗春风	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网 址	http://www.fund.pingan.com
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(2023 年 1 月 1 日-2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-754,298.51
本期利润	-877,245.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0156
本期加权平均净值利润率	-1.02%
本期基金份额净值增长率	-1.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	25,341,175.83
期末可供分配基金份额利润	0.4664
期末基金资产净值	79,678,879.83
期末基金份额净值	1.4664
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	46.64%

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。

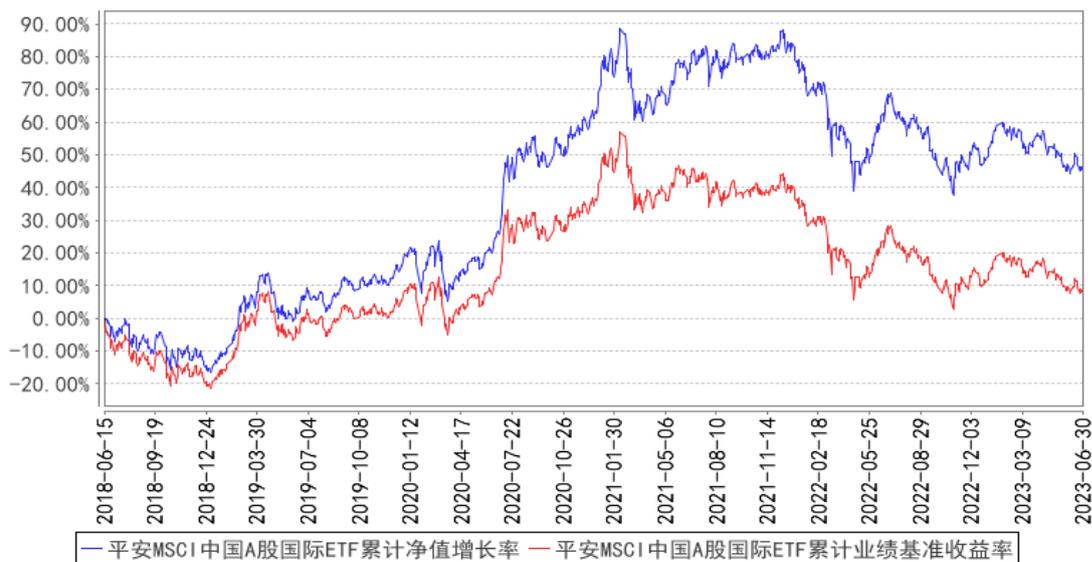
3.2 基金净值表现

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	1.09%	0.83%	0.36%	0.86%	0.73%	-0.03%
过去三个月	-5.05%	0.75%	-6.11%	0.78%	1.06%	-0.03%
过去六个月	-1.41%	0.76%	-2.29%	0.78%	0.88%	-0.02%
过去一年	-12.81%	0.90%	-14.91%	0.94%	2.10%	-0.04%
过去三年	14.89%	1.14%	-4.30%	1.18%	19.19%	-0.04%
自基金合同生效起至今	46.64%	1.23%	8.75%	1.27%	37.89%	-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、海外、专户七大业务板块（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 2023 年 6 月 30 日，平安基金共管理 186 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5,721.58 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		
钱晶	ETF 指数中心投资副总监，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	2019 年 2 月 28 日	-	12 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 ETF 指数投资中心投资经理。现任 ETF 指数中心投资副总监，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 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、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基金经理。

<p>王 仁 增</p>	<p>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</p>	<p>2021 年 7 月 8 日</p>	<p>-</p>	<p>9 年</p>	<p>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，现任 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 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、平安港股通恒生中国企业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金、平安中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 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</p>
--------------	---	-----------------------	----------	------------	--

					起式证券投资基金、平安上海金交易型开放式证券投资基金、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。
--	--	--	--	--	---

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 0.02%，年化跟踪误差 0.47%，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 1.4664 元，本报告期基金份额净值增长率为-1.41%，业绩比较基准收益率为-2.29%。

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 2023 年下半年，市场对于政策面的预期更加积极。但在基本面上，投资者可能需要更多的耐心。无论是宏观经济还是微观企业盈利，当前经济修复的内生动能还不够强、需求依然偏弱，随着稳增长政策发力，有望推动基本面持续改善。在交易层面，市场交易量持续低位震荡表达了投资者对于当前市场保持较为谨慎的情绪。但随着政策推进，情绪面不会长期处在较低位置。从中长期角度看，当前 A 股市场估值较为合理，我们对 A 股市场前景保持相对乐观。

作为一只以紧密跟踪标的指数为目标的基金，本基金始终秉持持有人利益至上，严格按照基金合同的要求，做好投资组合管理。

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 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,605,460.56	3,322,381.66
结算备付金		17,849.81	13,766.36
存出保证金		529.76	1,142.07
交易性金融资产	6.4.7.2	76,180,718.51	82,229,693.89
其中：股票投资		76,159,251.06	82,213,918.04
基金投资		-	-
债券投资		21,467.45	15,775.85
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	75,616.24	-
资产总计		79,880,174.88	85,566,983.98
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		32,797.59	36,573.57
应付托管费		6,559.51	7,314.69
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	161,937.95	244,573.78
负债合计		201,295.05	288,462.04
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	54,337,704.00	57,337,704.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	25,341,175.83	27,940,817.94
净资产合计		79,678,879.83	85,278,521.94
负债和净资产总计		79,880,174.88	85,566,983.98

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4664 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-398,311.84	-32,111,422.05
1. 利息收入		5,192.92	7,886.00
其中：存款利息收入	6.4.7.13	5,192.92	7,222.44
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		-	663.56
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-281,478.97	-21,484,374.32
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,186,100.87	-22,246,135.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	22.09	25,297.11
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	904,599.81	736,463.96
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
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	-122,947.32	-10,620,737.37
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	921.53	-14,196.36
减：二、营业总支出		478,933.99	754,245.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	212,769.58	416,724.74
2. 托管费	6.4.10.2.2	42,553.88	83,345.00
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		0.01	0.02
8. 其他费用	6.4.7.23	223,610.52	254,175.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-877,245.83	-32,865,667.60
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-877,245.83	-32,865,667.60
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-877,245.83	-32,865,667.60

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	57,337,704.00	-	27,940,817.94	85,278,521.94
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	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	-3,000,000.00	-	-1,722,396.28	-4,722,396.28

期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	-	-	-	-
2. 基金赎回款	-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基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	54,337,704.00	-	25,341,175.83	79,678,879.83
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	135,337,704.00	-	113,621,111.09	248,958,815.09
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

二、本期期初净资产（基金净值）	135,337,704.00	-	113,621,111.09	248,958,815.09
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-81,000,000.00	-	-76,568,517.24	-157,568,517.24
（一）、综合收益总额	-	-	-32,865,667.60	-32,865,667.60
（二）、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）	-81,000,000.00	-	-43,702,849.64	-124,702,849.64
其中：1. 基金申购款	6,000,000.00	-	3,099,006.58	9,099,006.58
2. 基金赎回款	-87,000,000.00	-	-46,801,856.22	-133,801,856.22
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	54,337,704.00	-	37,052,593.85	91,390,297.85

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：

<u>罗春风</u>	<u>林婉文</u>	<u>张南南</u>
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(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。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(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、《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 2023 年 06 月 30 日的财务状况以及 2023 年 01 月 01 日至 2023 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

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。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	3,605,460.56
等于：本金	3,605,160.74
加：应计利息	299.82
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	3,605,460.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	89,959,877.53	-	76,159,251.06	-13,800,626.47	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	17,000.00	14.35	21,467.45	4,453.10
	银行间市场	-	-	-	-

	合计	17,000.00	14.35	21,467.45	4,453.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
	合计	89,976,877.53	14.35	76,180,718.51	-13,796,173.37

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 2023年6月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023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	4,684.99
其中：交易所市场	4,684.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	122,252.96
应付指数使用费	35,000.00
合计	161,937.95

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	57,337,704.00	57,337,704.00
本期申购	-	-
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	38,722,555.79	-10,781,737.85	27,940,817.94
本期利润	-754,298.51	-122,947.32	-877,245.83
本期基金份额交易产生的变动数	-1,997,489.20	275,092.92	-1,722,396.28
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-1,997,489.20	275,092.92	-1,722,396.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	35,970,768.08	-10,629,592.25	25,341,175.83

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	5,143.43
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	45.37
其他	4.12
合计	5,192.92

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,027,831.38
股票投资收益——赎回差价收入	-158,269.49
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	-1,186,100.87

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	4,699,866.59
减：卖出股票成本总额	5,717,138.20
减：交易费用	10,559.77
买卖股票差价收入	-1,027,831.38

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	4,722,396.28
减：现金支付赎回款总额	1,805,583.28
减：赎回股票成本总额	3,075,082.49
减：交易费用	-
赎回差价收入	-158,269.49

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
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	22.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	22.09

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期内无债券买卖差价收入。

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	904,599.81
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	904,599.81

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-122,947.32
股票投资	-124,634.72
债券投资	1,687.40
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	-122,947.32

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	921.53
合计	921.53

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	20,827.67
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行费用	244.00
指数使用费	76,729.80
其他	86,137.47
合计	223,610.52

6.4.7.24 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 2023年1月1日至2023年6月 30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	-	78,245,483.77	83.12
------	---	---	---------------	-------

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	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 成交总额的比例 (%)
平安证券	-	-	118,295.80	100.00

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例 (%)
平安证券	-	-	7,000,000.00	100.00

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 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 (%)
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	56,165.50	83.13	39,748.05	83.85

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	212,769.58	416,724.74
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,553.88	83,345.00

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	46,426,797.00	85.4412	48,056,297.00	83.8127

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 2023年1月1日至2023年6月30 日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	3,605,460.56	5,143.43	1,811,567.75	6,128.33

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

金额单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单 位：股/ 张）	总金额
平安证券股份 有限公司	600030	中信证券	网上定价	8,130	117,315.90

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 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% (2022 年 6 月 30 日，本基金持有 121,700.00 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 593,360.51 元，估值总额为人民币 580,509.00 元，占基金资产净值的比例为 0.64%)。

(2) 于 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% (2022 年 6 月 30 日，本基金持有 22,200.00 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,318,523.95 元，估值总额为人民币 1,036,518.00 元，占基金资产净值的比例为 1.13%)。

(3) 于 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% (2022 年 6 月 30 日，本基金持有 38,100.00 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 699,017.31 元，估值总额为人民币 570,738.00 元，占基金资产净值的比例为 0.62%)。

(4) 于 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（2023 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	受限期	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
601916	浙商银行	2023 年 6 月 27 日	1-6 个月（含）	配股流通受限	2.02	2.64	10,020	20,240.40	26,452.80	-

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%。（完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的基金品种可以不受此条款规定的比例限制）

于本期末，本基金持有除国债、央行票据、政策性金融债之外的债券资产的账面价值占基金净资产的比例为 0.03%（上年末：0.02%）。

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 个工作日内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 个工作日内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 2023 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	3,605,460.56	-	-	-	3,605,460.56
结算备付金	17,849.81	-	-	-	17,849.81
存出保证金	529.76	-	-	-	529.76
交易性金融资产	21,467.45	-	-	76,159,251.06	76,180,718.51
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	3,645,307.58	-	-	76,234,867.30	79,880,174.88

负债					
应付管理人报酬	-	-	-	32,797.59	32,797.59
应付托管费	-	-	-	6,559.51	6,559.51
其他负债	-	-	-	161,937.95	161,937.95
负债总计	-	-	-	201,295.05	201,295.05
利率敏感度缺口	3,645,307.58	-	-	76,033,572.25	79,678,879.83
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,322,381.66	-	-	-	3,322,381.66
结算备付金	13,766.36	-	-	-	13,766.36
存出保证金	1,142.07	-	-	-	1,142.07
交易性金融资产	15,775.85	-	-	82,213,918.04	82,229,693.89
资产总计	3,353,065.94	-	-	82,213,918.04	85,566,983.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	36,573.57	36,573.57
应付托管费	-	-	-	7,314.69	7,314.69
其他负债	-	-	-	244,573.78	244,573.78
负债总计	-	-	-	288,462.04	288,462.04
利率敏感度缺口	3,353,065.94	-	-	81,925,456.00	85,278,521.94

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为：0.03%（上年末：0.02%），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

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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	76,159,251.06	95.58	82,213,918.04	96.41
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	76,159,251.06	95.58	82,213,918.04	96.41

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（2023 年 6 月 30 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
分析	沪深 300 指数上升 5%	3,531,828.33	4,089,305.99
	沪深 300 指数下降 5%	-3,531,828.33	-4,089,305.99

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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	76,154,265.71	82,137,771.49
第二层次	26,452.80	91,922.40
第三层次	-	-
合计	76,180,718.51	82,229,693.89

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	76,159,251.06	95.34
	其中：股票	76,159,251.06	95.34
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,467.45	0.03
	其中：债券	21,467.45	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	3,623,310.37	4.54
8	其他各项资产	76,146.00	0.10
9	合计	79,880,174.88	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	833,554.95	1.05
B	采矿业	3,337,483.74	4.19
C	制造业	43,183,607.79	54.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,911,409.70	3.65
E	建筑业	1,622,121.35	2.04
F	批发和零售业	957,771.47	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	2,501,792.88	3.14
H	住宿和餐饮业	117,902.00	0.15
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,722,954.24	4.67
J	金融业	13,468,459.13	16.90
K	房地产业	1,190,377.00	1.49
L	租赁和商务服务业	691,808.97	0.87
M	科学研究和技术服务业	514,756.04	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	103,374.80	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	54,990.00	0.07
Q	卫生和社会工作	500,101.60	0.63
R	文化、体育和娱乐业	342,689.40	0.43
S	综合	104,096.00	0.13
	合计	76,159,251.06	95.58

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	4,058,400.00	5.09
2	300750	宁德时代	8,260	1,889,805.40	2.37
3	600036	招商银行	38,800	1,271,088.00	1.60
4	000858	五粮液	7,300	1,194,061.00	1.50
5	600900	长江电力	44,500	981,670.00	1.23
6	601318	中国平安	20,400	946,560.00	1.19
7	002594	比亚迪	3,400	878,118.00	1.10
8	300760	迈瑞医疗	2,300	689,540.00	0.87
9	601166	兴业银行	39,000	610,350.00	0.77
10	000568	泸州老窖	2,800	586,796.00	0.74
11	600276	恒瑞医药	11,960	572,884.00	0.72
12	601398	工商银行	118,200	569,724.00	0.72
13	601288	农业银行	160,000	564,800.00	0.71
14	600309	万华化学	5,900	518,256.00	0.65
15	601138	工业富联	18,700	471,240.00	0.59
16	600030	中信证券	23,030	455,533.40	0.57
17	601668	中国建筑	78,840	452,541.60	0.57
18	601899	紫金矿业	38,700	440,019.00	0.55
19	002475	立讯精密	13,422	435,543.90	0.55
20	600809	山西汾酒	2,320	429,362.40	0.54
21	002714	牧原股份	10,173	428,791.95	0.54
22	601328	交通银行	73,800	428,040.00	0.54
23	300059	东方财富	29,790	423,018.00	0.53
24	002352	顺丰控股	9,200	414,828.00	0.52
25	601888	中国中免	3,729	412,166.37	0.52
26	000001	平安银行	36,500	409,895.00	0.51
27	601012	隆基绿能	14,225	407,830.75	0.51
28	603288	海天味业	8,701	407,641.85	0.51
29	600000	浦发银行	55,200	399,648.00	0.50
30	601088	中国神华	12,600	387,450.00	0.49
31	600028	中国石化	59,600	379,056.00	0.48
32	688111	金山办公	800	377,776.00	0.47
33	002304	洋河股份	2,800	367,780.00	0.46
34	600406	国电南瑞	15,134	349,595.40	0.44
35	000063	中兴通讯	7,500	341,550.00	0.43

36	600887	伊利股份	12,033	340,774.56	0.43
37	601601	中国太保	13,000	337,740.00	0.42
38	601225	陕西煤业	18,200	331,058.00	0.42
39	300274	阳光电源	2,800	326,564.00	0.41
40	300015	爱尔眼科	17,604	326,554.20	0.41
41	601816	京沪高铁	61,500	323,490.00	0.41
42	002371	北方华创	1,000	317,650.00	0.40
43	600436	片仔癀	1,100	314,996.00	0.40
44	002142	宁波银行	12,400	313,720.00	0.39
45	601857	中国石油	41,300	308,511.00	0.39
46	603259	药明康德	4,864	303,075.84	0.38
47	601766	中国中车	46,500	302,250.00	0.38
48	002230	科大讯飞	4,400	299,024.00	0.38
49	601390	中国中铁	39,200	297,136.00	0.37
50	600048	保利发展	22,500	293,175.00	0.37
51	600438	通威股份	8,500	291,635.00	0.37
52	600905	三峡能源	53,800	288,906.00	0.36
53	000725	京东方 A	70,500	288,345.00	0.36
54	600690	海尔智家	12,200	286,456.00	0.36
55	600050	中国联通	59,100	283,680.00	0.36
56	600150	中国船舶	8,500	279,735.00	0.35
57	600031	三一重工	16,300	271,069.00	0.34
58	601818	光大银行	87,200	267,704.00	0.34
59	601658	邮储银行	54,700	267,483.00	0.34
60	002459	晶澳科技	6,356	265,045.20	0.33
61	000002	万科 A	18,800	263,576.00	0.33
62	601988	中国银行	67,200	262,752.00	0.33
63	601985	中国核电	36,500	257,325.00	0.32
64	600016	民生银行	67,800	254,250.00	0.32
65	002129	TCL 中环	7,625	253,150.00	0.32
66	600019	宝钢股份	42,600	239,412.00	0.30
67	688036	传音控股	1,600	235,200.00	0.30
68	300498	温氏股份	12,660	232,311.00	0.29
69	300014	亿纬锂能	3,833	231,896.50	0.29
70	002493	荣盛石化	19,400	225,816.00	0.28
71	601919	中远海控	23,960	225,224.00	0.28
72	300308	中际旭创	1,500	221,175.00	0.28
73	603501	韦尔股份	2,230	218,629.20	0.27
74	600893	航发动力	5,089	215,061.14	0.27
75	600104	上汽集团	14,900	211,133.00	0.26
76	600919	江苏银行	28,330	208,225.50	0.26
77	601006	大秦铁路	27,900	207,297.00	0.26
78	300122	智飞生物	4,650	205,530.00	0.26

79	000625	长安汽车	15,814	204,475.02	0.26
80	002466	天齐锂业	2,880	201,340.80	0.25
81	000792	盐湖股份	10,500	201,285.00	0.25
82	000596	古井贡酒	800	197,904.00	0.25
83	601211	国泰君安	14,100	197,259.00	0.25
84	000651	格力电器	5,400	197,154.00	0.25
85	601066	中信建投	8,100	196,020.00	0.25
86	000166	申万宏源	42,400	195,888.00	0.25
87	300896	爱美客	440	195,778.00	0.25
88	601688	华泰证券	14,100	194,157.00	0.24
89	001979	招商蛇口	14,800	192,844.00	0.24
90	600346	恒力石化	13,280	190,302.40	0.24
91	600999	招商证券	13,910	188,758.70	0.24
92	002460	赣锋锂业	3,080	187,756.80	0.24
93	688012	中微公司	1,200	187,740.00	0.24
94	601669	中国电建	32,400	185,976.00	0.23
95	601628	中国人寿	5,300	185,288.00	0.23
96	002027	分众传媒	27,160	184,959.60	0.23
97	601169	北京银行	39,700	183,811.00	0.23
98	600585	海螺水泥	7,700	182,798.00	0.23
99	688599	天合光能	4,200	178,962.00	0.22
100	300316	晶盛机电	2,500	177,250.00	0.22
101	600886	国投电力	14,000	177,100.00	0.22
102	603993	洛阳钼业	33,200	176,956.00	0.22
103	000538	云南白药	3,355	176,070.40	0.22
104	688223	晶科能源	12,500	175,750.00	0.22
105	300033	同花顺	1,000	175,280.00	0.22
106	600989	宝丰能源	13,800	174,018.00	0.22
107	000938	紫光股份	5,398	171,926.30	0.22
108	600845	宝信软件	3,368	171,128.08	0.21
109	601689	拓普集团	2,100	169,470.00	0.21
110	600089	特变电工	7,600	169,404.00	0.21
111	601360	三六零	13,400	168,036.00	0.21
112	600111	北方稀土	7,000	167,860.00	0.21
113	000338	潍柴动力	13,400	166,964.00	0.21
114	600837	海通证券	18,100	166,882.00	0.21
115	601100	恒立液压	2,592	166,743.36	0.21
116	600570	恒生电子	3,719	164,714.51	0.21
117	000895	双汇发展	6,700	164,083.00	0.21
118	600011	华能国际	17,700	163,902.00	0.21
119	000776	广发证券	11,100	163,281.00	0.20
120	600703	三安光电	9,400	162,056.00	0.20
121	002812	恩捷股份	1,680	161,868.00	0.20

122	601009	南京银行	20,100	160,800.00	0.20
123	300124	汇川技术	2,500	160,525.00	0.20
124	600547	山东黄金	6,788	159,382.24	0.20
125	002920	德赛西威	1,000	155,810.00	0.20
126	002709	天赐材料	3,760	154,874.40	0.19
127	601229	上海银行	26,726	153,674.50	0.19
128	002555	三七互娱	4,400	153,472.00	0.19
129	600010	宝钢股份	85,700	153,403.00	0.19
130	000425	徐工机械	22,600	153,002.00	0.19
131	002049	紫光国微	1,620	151,065.00	0.19
132	603659	璞泰来	3,944	150,739.68	0.19
133	600085	同仁堂	2,600	149,656.00	0.19
134	600188	兖矿能源	4,900	146,608.00	0.18
135	002311	海大集团	3,100	145,204.00	0.18
136	600600	青岛啤酒	1,400	145,082.00	0.18
137	600958	东方证券	14,824	143,792.80	0.18
138	601336	新华保险	3,900	143,403.00	0.18
139	601600	中国铝业	26,100	143,289.00	0.18
140	000963	华东医药	3,300	143,121.00	0.18
141	603799	华友钴业	3,117	143,101.47	0.18
142	601868	中国能建	61,000	142,740.00	0.18
143	600588	用友网络	6,850	140,425.00	0.18
144	600660	福耀玻璃	3,900	139,815.00	0.18
145	000100	TCL 科技	35,260	138,924.40	0.17
146	600926	杭州银行	11,780	138,415.00	0.17
147	000301	东方盛虹	11,700	138,294.00	0.17
148	000977	浪潮信息	2,824	136,964.00	0.17
149	600015	华夏银行	25,300	136,873.00	0.17
150	603986	兆易创新	1,288	136,850.00	0.17
151	688303	大全能源	3,300	133,485.00	0.17
152	601618	中国中冶	33,600	133,392.00	0.17
153	603806	福斯特	3,584	133,288.96	0.17
154	688256	寒武纪	700	131,600.00	0.17
155	601995	中金公司	3,700	131,424.00	0.16
156	688396	华润微	2,500	131,025.00	0.16
157	600039	四川路桥	13,300	130,473.00	0.16
158	600221	海航控股	81,400	128,612.00	0.16
159	600795	国电电力	33,500	128,305.00	0.16
160	601865	福莱特	3,300	127,083.00	0.16
161	603369	今世缘	2,400	126,720.00	0.16
162	600196	复星医药	4,100	126,690.00	0.16
163	600674	川投能源	8,400	126,420.00	0.16
164	688008	澜起科技	2,200	126,324.00	0.16

165	600029	南方航空	20,400	123,012.00	0.15
166	600426	华鲁恒升	4,000	122,520.00	0.15
167	300413	芒果超媒	3,540	121,103.40	0.15
168	601633	长城汽车	4,800	120,816.00	0.15
169	002241	歌尔股份	6,800	120,700.00	0.15
170	601111	中国国航	14,600	120,304.00	0.15
171	601939	建设银行	19,100	119,566.00	0.15
172	002236	大华股份	6,000	118,500.00	0.15
173	600745	闻泰科技	2,400	117,360.00	0.15
174	601727	上海电气	25,500	116,535.00	0.15
175	601607	上海医药	5,200	116,532.00	0.15
176	300433	蓝思科技	9,900	116,424.00	0.15
177	600741	华域汽车	6,300	116,298.00	0.15
178	601877	正泰电器	4,200	116,130.00	0.15
179	601788	光大证券	7,300	115,997.00	0.15
180	000999	华润三九	1,900	115,254.00	0.14
181	601916	浙商银行	43,420	114,628.80	0.14
182	605117	德业股份	756	113,059.80	0.14
183	300999	金龙鱼	2,800	111,972.00	0.14
184	002736	国信证券	12,800	111,744.00	0.14
185	600176	中国巨石	7,887	111,679.92	0.14
186	002602	世纪华通	14,700	111,573.00	0.14
187	600023	浙能电力	22,000	111,540.00	0.14
188	688126	沪硅产业	5,272	110,184.80	0.14
189	000661	长春高新	800	109,040.00	0.14
190	600009	上海机场	2,400	109,008.00	0.14
191	601901	方正证券	16,500	107,910.00	0.14
192	601127	赛力斯	2,900	106,633.00	0.13
193	601319	中国人保	18,200	106,288.00	0.13
194	600027	华电国际	15,800	105,702.00	0.13
195	300408	三环集团	3,600	105,660.00	0.13
196	000876	新希望	9,000	105,120.00	0.13
197	603260	合盛硅业	1,500	105,030.00	0.13
198	600522	中天科技	6,600	105,006.00	0.13
199	603392	万泰生物	1,568	104,695.36	0.13
200	600875	东方电气	5,600	104,440.00	0.13
201	600115	中国东航	21,800	103,768.00	0.13
202	601021	春秋航空	1,800	103,446.00	0.13
203	600732	爱旭股份	3,360	103,320.00	0.13
204	002050	三花智控	3,400	102,884.00	0.13
205	600584	长电科技	3,300	102,861.00	0.13
206	002252	上海莱士	13,500	101,385.00	0.13
207	601117	中国化学	12,200	101,016.00	0.13

208	601377	兴业证券	16,430	100,551.60	0.13
209	601825	沪农商行	18,400	100,280.00	0.13
210	601238	广汽集团	9,600	100,032.00	0.13
211	601881	中国银河	8,600	99,846.00	0.13
212	002648	卫星化学	6,640	99,334.40	0.12
213	600233	圆通速递	6,800	99,008.00	0.12
214	600489	中金黄金	9,500	98,135.00	0.12
215	300782	卓胜微	1,005	97,113.15	0.12
216	000983	山西焦煤	10,630	96,733.00	0.12
217	000157	中联重科	14,200	95,850.00	0.12
217	000733	振华科技	1,000	95,850.00	0.12
218	002001	新和成	6,220	95,788.00	0.12
219	600415	小商品城	11,100	94,683.00	0.12
220	601872	招商轮船	16,200	93,798.00	0.12
221	002180	纳思达	2,700	92,475.00	0.12
222	002938	鹏鼎控股	3,800	92,302.00	0.12
223	600061	国投资本	12,936	92,104.32	0.12
224	300751	迈为股份	540	91,465.20	0.11
225	601699	潞安环能	5,600	91,392.00	0.11
226	002074	国轩高科	3,300	91,146.00	0.11
227	688777	中控技术	1,450	91,031.00	0.11
228	300454	深信服	800	90,600.00	0.11
229	600918	中泰证券	13,100	90,521.00	0.11
230	002600	领益智造	13,000	89,830.00	0.11
231	688041	海光信息	1,300	88,751.00	0.11
232	300418	昆仑万维	2,200	88,616.00	0.11
233	300832	新产业	1,500	88,500.00	0.11
234	600256	广汇能源	12,900	88,494.00	0.11
235	300628	亿联网络	2,520	88,376.40	0.11
236	603833	欧派家居	920	88,136.00	0.11
237	600515	海南机场	21,700	88,102.00	0.11
238	603345	安井食品	600	88,080.00	0.11
239	002384	东山精密	3,400	88,060.00	0.11
240	601838	成都银行	7,200	87,912.00	0.11
241	000807	云铝股份	6,900	87,837.00	0.11
242	600026	中远海能	6,912	87,367.68	0.11
243	600803	新奥股份	4,600	87,308.00	0.11
244	000066	中国长城	6,300	87,129.00	0.11
245	002841	视源股份	1,300	86,892.00	0.11
246	600079	人福医药	3,200	86,208.00	0.11
247	600332	白云山	2,700	86,076.00	0.11
248	603486	科沃斯	1,100	85,547.00	0.11
249	688072	拓荆科技	200	85,194.00	0.11

250	603899	晨光股份	1,900	84,816.00	0.11
251	600161	天坛生物	3,116	84,599.40	0.11
252	688009	中国通号	14,457	83,850.60	0.11
253	002007	华兰生物	3,740	83,813.40	0.11
254	002603	以岭药业	3,260	83,749.40	0.11
255	000786	北新建材	3,400	83,334.00	0.10
256	600132	重庆啤酒	900	82,944.00	0.10
257	603198	迎驾贡酒	1,300	82,940.00	0.10
258	002821	凯莱英	700	82,502.00	0.10
259	300142	沃森生物	3,100	81,995.00	0.10
260	600460	士兰微	2,700	81,729.00	0.10
261	300146	汤臣倍健	3,400	81,532.00	0.10
262	300003	乐普医疗	3,600	81,396.00	0.10
263	688363	华熙生物	900	80,244.00	0.10
264	002422	科伦药业	2,700	80,136.00	0.10
265	600362	江西铜业	4,200	79,716.00	0.10
266	603688	石英股份	700	79,688.00	0.10
267	300223	北京君正	900	79,479.00	0.10
268	002463	沪电股份	3,780	79,153.20	0.10
269	688301	奕瑞科技	280	79,080.40	0.10
270	300724	捷佳伟创	700	78,645.00	0.10
271	002568	百润股份	2,156	78,370.60	0.10
272	300763	锦浪科技	750	78,075.00	0.10
273	601878	浙商证券	7,900	78,052.00	0.10
274	002601	龙佰集团	4,700	77,550.00	0.10
275	300496	中科创达	800	77,080.00	0.10
276	002916	深南电路	1,016	76,575.92	0.10
277	600754	锦江酒店	1,800	76,212.00	0.10
278	688120	华海清科	298	75,110.90	0.09
279	300759	康龙化成	1,950	74,646.00	0.09
280	600160	巨化股份	5,400	74,412.00	0.09
281	600702	舍得酒业	600	74,370.00	0.09
282	601799	星宇股份	600	74,160.00	0.09
283	002202	金风科技	6,900	73,278.00	0.09
284	000988	华工科技	1,900	72,219.00	0.09
285	000069	华侨城 A	16,400	72,160.00	0.09
286	002223	鱼跃医疗	2,000	71,980.00	0.09
287	600219	南山铝业	23,830	71,966.60	0.09
288	688521	芯原股份	1,000	71,920.00	0.09
289	002294	信立泰	2,300	71,737.00	0.09
290	600536	中国软件	1,521	71,304.48	0.09
291	300957	贝泰妮	800	71,104.00	0.09
292	601615	明阳智能	4,200	70,896.00	0.09

293	300037	新宙邦	1,360	70,570.40	0.09
294	603939	益丰药房	1,907	70,559.00	0.09
295	002028	思源电气	1,500	70,080.00	0.09
296	300661	圣邦股份	845	69,399.85	0.09
297	601555	东吴证券	9,939	68,976.66	0.09
298	600018	上港集团	13,100	68,775.00	0.09
299	002430	杭氧股份	2,000	68,720.00	0.09
300	600642	申能股份	9,800	68,502.00	0.09
301	601216	君正集团	16,700	68,470.00	0.09
302	002624	完美世界	4,050	68,404.50	0.09
303	601058	赛轮轮胎	6,000	68,340.00	0.09
304	600705	中航产融	17,800	68,174.00	0.09
305	002558	巨人网络	3,800	68,134.00	0.09
306	601958	金钼股份	6,100	68,015.00	0.09
307	002080	中材科技	3,300	67,716.00	0.08
308	000408	藏格矿业	3,000	67,710.00	0.08
309	600004	白云机场	4,700	67,398.00	0.08
310	688561	奇安信	1,300	67,353.00	0.08
311	000729	燕京啤酒	5,400	67,338.00	0.08
312	000629	钒钛股份	17,200	67,252.00	0.08
313	002064	华峰化学	9,800	67,228.00	0.08
314	002625	光启技术	4,400	67,144.00	0.08
315	600487	亨通光电	4,560	66,849.60	0.08
316	600884	杉杉股份	4,400	66,616.00	0.08
317	300919	中伟股份	1,100	66,275.00	0.08
318	002850	科达利	500	66,125.00	0.08
319	601108	财通证券	9,060	65,594.40	0.08
320	000932	华菱钢铁	13,740	65,539.80	0.08
321	000975	银泰黄金	5,600	65,520.00	0.08
322	688390	固德威	392	65,409.12	0.08
323	603233	大参林	2,333	65,347.33	0.08
324	002414	高德红外	8,378	65,097.06	0.08
325	600109	国金证券	7,500	65,025.00	0.08
326	688536	思瑞浦	298	64,964.00	0.08
327	600383	金地集团	9,000	64,890.00	0.08
328	601155	新城控股	4,500	64,845.00	0.08
329	603885	吉祥航空	4,200	64,806.00	0.08
330	603290	斯达半导	300	64,560.00	0.08
331	300144	宋城演艺	5,200	64,480.00	0.08
332	601966	玲珑轮胎	2,900	64,438.00	0.08
333	000783	长江证券	11,100	64,380.00	0.08
334	000423	东阿阿胶	1,200	64,140.00	0.08
335	603737	三棵树	980	64,111.60	0.08

336	000723	美锦能源	8,500	64,090.00	0.08
337	002865	钧达股份	419	63,910.07	0.08
338	600183	生益科技	4,500	63,900.00	0.08
339	600970	中材国际	5,000	63,750.00	0.08
340	603606	东方电缆	1,300	63,739.00	0.08
341	002340	格林美	9,200	63,572.00	0.08
342	603596	伯特利	800	63,408.00	0.08
343	002156	通富微电	2,800	63,280.00	0.08
344	600153	建发股份	5,800	63,278.00	0.08
345	601077	渝农商行	17,600	63,184.00	0.08
346	600096	云天化	3,700	63,159.00	0.08
347	600157	永泰能源	44,400	63,048.00	0.08
348	601577	长沙银行	8,100	62,856.00	0.08
349	002372	伟星新材	3,060	62,852.40	0.08
350	688187	时代电气	1,500	62,790.00	0.08
351	688122	西部超导	1,120	62,417.60	0.08
352	601233	桐昆股份	4,700	62,275.00	0.08
353	002939	长城证券	7,600	61,788.00	0.08
354	000009	中国宝安	5,100	61,557.00	0.08
354	600298	安琪酵母	1,700	61,557.00	0.08
355	000027	深圳能源	9,280	61,155.20	0.08
356	002153	石基信息	4,368	61,152.00	0.08
357	000738	航发控制	2,500	61,000.00	0.08
358	603156	养元饮品	2,460	60,762.00	0.08
359	000630	铜陵有色	21,000	60,690.00	0.08
360	600606	绿地控股	22,049	60,634.75	0.08
361	601990	南京证券	7,400	60,532.00	0.08
362	603882	金域医学	800	60,400.00	0.08
363	688220	翱捷科技	800	60,312.00	0.08
364	600352	浙江龙盛	6,400	59,840.00	0.08
365	603185	弘元绿能	800	59,640.00	0.07
366	603816	顾家家居	1,560	59,514.00	0.07
367	688063	派能科技	300	59,475.00	0.07
368	000831	中国稀土	2,000	59,200.00	0.07
369	603568	伟明环保	3,380	59,183.80	0.07
370	688099	晶晨股份	700	59,024.00	0.07
371	600177	雅戈尔	9,340	58,935.40	0.07
372	600872	中炬高新	1,600	58,864.00	0.07
373	000933	神火股份	4,500	58,500.00	0.07
374	002409	雅克科技	800	58,304.00	0.07
375	600511	国药股份	1,500	58,275.00	0.07
376	600021	上海电力	5,400	58,158.00	0.07
377	600763	通策医疗	600	58,116.00	0.07

378	000021	深科技	2,900	57,971.00	0.07
379	002185	华天科技	6,300	57,960.00	0.07
380	002078	太阳纸业	5,400	57,726.00	0.07
381	601696	中银证券	5,400	57,564.00	0.07
382	002152	广电运通	4,900	57,428.00	0.07
383	600998	九州通	5,513	57,224.94	0.07
384	002673	西部证券	9,000	57,150.00	0.07
385	002756	永兴材料	910	56,975.10	0.07
386	601933	永辉超市	18,200	56,966.00	0.07
387	000728	国元证券	8,730	56,919.60	0.07
388	601880	辽港股份	36,300	56,628.00	0.07
389	688188	柏楚电子	300	56,568.00	0.07
390	600733	北汽蓝谷	10,500	56,490.00	0.07
391	002056	横店东磁	3,100	56,451.00	0.07
392	300118	东方日升	2,200	56,386.00	0.07
393	300487	蓝晓科技	900	56,178.00	0.07
394	002120	韵达股份	5,870	56,117.20	0.07
395	600348	华阳股份	7,050	55,765.50	0.07
396	300207	欣旺达	3,400	55,488.00	0.07
397	600985	淮北矿业	4,800	55,296.00	0.07
398	600848	上海临港	4,620	55,209.00	0.07
399	002739	万达电影	4,400	55,176.00	0.07
400	688385	复旦微电	1,100	55,110.00	0.07
401	002044	美年健康	7,740	55,031.40	0.07
402	002405	四维图新	4,750	55,005.00	0.07
403	002607	中公教育	11,700	54,990.00	0.07
404	600546	山煤国际	3,800	54,986.00	0.07
405	600563	法拉电子	400	54,920.00	0.07
406	603658	安图生物	1,060	54,833.80	0.07
407	002531	天顺风能	3,600	54,828.00	0.07
408	601179	中国西电	10,100	54,641.00	0.07
409	688516	奥特维	290	54,636.00	0.07
410	603589	口子窖	1,100	54,285.00	0.07
411	600655	豫园股份	7,900	54,194.00	0.07
412	002240	盛新锂能	1,700	54,179.00	0.07
413	002385	大北农	8,200	54,120.00	0.07
414	000799	酒鬼酒	600	54,090.00	0.07
415	300676	华大基因	900	53,991.00	0.07
416	600873	梅花生物	6,000	53,580.00	0.07
417	600977	中国电影	3,800	53,390.00	0.07
418	600521	华海药业	2,900	53,389.00	0.07
419	000683	远兴能源	7,400	53,206.00	0.07
420	600637	东方明珠	6,790	53,097.80	0.07

421	600779	水井坊	900	53,091.00	0.07
422	002244	滨江集团	6,000	52,920.00	0.07
423	600418	江淮汽车	4,200	52,878.00	0.07
424	300601	康泰生物	2,080	52,811.20	0.07
425	600378	昊华科技	1,400	52,696.00	0.07
426	688348	昱能科技	280	52,592.40	0.07
427	600486	扬农化工	600	52,452.00	0.07
428	601231	环旭电子	3,500	52,360.00	0.07
429	601991	大唐发电	15,800	52,298.00	0.07
430	300604	长川科技	1,100	52,239.00	0.07
431	002532	天山铝业	8,700	52,113.00	0.07
432	600583	海油工程	8,900	52,065.00	0.07
433	000800	一汽解放	6,200	51,894.00	0.07
434	601162	天风证券	17,400	51,852.00	0.07
435	300347	泰格医药	800	51,632.00	0.06
436	000591	太阳能	7,600	51,528.00	0.06
437	600549	厦门钨业	2,700	51,381.00	0.06
438	600704	物产中大	10,400	51,376.00	0.06
439	000960	锡业股份	3,300	51,315.00	0.06
440	300390	天华新能	1,430	51,194.00	0.06
441	000987	越秀资本	8,053	51,136.55	0.06
442	600141	兴发集团	2,300	51,106.00	0.06
443	300595	欧普康视	1,690	51,021.10	0.06
444	603893	瑞芯微	700	50,995.00	0.06
445	600497	驰宏锌锗	10,100	50,702.00	0.06
446	600271	航天信息	3,700	50,653.00	0.06
447	601198	东兴证券	6,300	50,526.00	0.06
448	600481	双良节能	3,600	50,328.00	0.06
449	603613	国联股份	1,359	50,187.87	0.06
450	688180	君实生物	1,300	50,102.00	0.06
451	002032	苏泊尔	1,000	50,000.00	0.06
452	002299	圣农发展	2,600	49,790.00	0.06
453	002738	中矿资源	976	49,717.44	0.06
454	600416	湘电股份	2,600	49,634.00	0.06
455	601168	西部矿业	4,700	49,397.00	0.06
456	600566	济川药业	1,700	49,368.00	0.06
457	000703	恒逸石化	7,250	49,155.00	0.06
458	603444	吉比特	100	49,111.00	0.06
459	688728	格科微	3,100	49,042.00	0.06
460	301236	软通动力	1,800	48,978.00	0.06
461	603858	步长制药	2,376	48,921.84	0.06
462	002128	电投能源	3,700	48,914.00	0.06
463	601866	中远海发	19,800	48,906.00	0.06

464	000519	中兵红箭	2,700	48,843.00	0.06
465	300251	光线传媒	6,000	48,540.00	0.06
466	600390	五矿资本	9,000	48,420.00	0.06
467	600380	健康元	3,808	48,399.68	0.06
468	605358	立昂微	1,316	48,336.68	0.06
469	002508	老板电器	1,900	48,051.00	0.06
470	600516	方大炭素	7,747	48,031.40	0.06
471	000709	河钢股份	21,200	47,912.00	0.06
472	600170	上海建工	17,800	47,882.00	0.06
473	600369	西南证券	13,100	47,815.00	0.06
474	002353	杰瑞股份	1,900	47,747.00	0.06
475	688567	孚能科技	2,200	47,498.00	0.06
476	002797	第一创业	8,300	47,476.00	0.06
477	002268	电科网安	1,700	47,379.00	0.06
478	600598	北大荒	3,500	46,655.00	0.06
479	601636	旗滨集团	5,400	46,548.00	0.06
480	601106	中国一重	13,800	46,368.00	0.06
481	603338	浙江鼎力	820	45,928.20	0.06
482	002966	苏州银行	7,000	45,850.00	0.06
483	000513	丽珠集团	1,178	45,835.98	0.06
484	002465	海格通信	4,424	45,744.16	0.06
485	688538	和辉光电	18,000	45,720.00	0.06
486	600859	王府井	2,300	45,517.00	0.06
487	600699	均胜电子	2,580	45,511.20	0.06
488	603712	七一二	1,500	45,315.00	0.06
489	002791	坚朗五金	700	45,297.00	0.06
489	300073	当升科技	900	45,297.00	0.06
490	603529	爱玛科技	1,400	45,108.00	0.06
491	600392	盛和资源	3,500	45,045.00	0.06
492	603826	坤彩科技	900	45,000.00	0.06
493	688002	睿创微纳	1,000	44,800.00	0.06
494	601016	节能风电	12,150	44,590.50	0.06
495	600143	金发科技	5,100	44,523.00	0.06
496	002065	东华软件	6,300	44,478.00	0.06
497	300699	光威复材	1,440	44,424.00	0.06
498	600988	赤峰黄金	3,300	44,418.00	0.06
499	000739	普洛药业	2,500	44,350.00	0.06
500	688052	纳芯微	280	44,343.60	0.06
501	300395	菲利华	900	44,280.00	0.06
502	002266	浙富控股	10,700	44,191.00	0.06
503	000050	深天马 A	4,800	44,064.00	0.06
504	002926	华西证券	5,300	44,043.00	0.06
505	002518	科士达	1,100	44,011.00	0.06

506	600909	华安证券	9,410	43,944.70	0.06
507	002831	裕同科技	1,800	43,902.00	0.06
508	600867	通化东宝	4,200	43,848.00	0.06
509	603456	九洲药业	1,600	43,808.00	0.05
510	600038	中直股份	1,100	43,802.00	0.05
511	000937	冀中能源	6,800	43,384.00	0.05
512	603707	健友股份	3,210	43,335.00	0.05
513	688005	容百科技	800	43,216.00	0.05
514	300212	易华录	1,300	43,199.00	0.05
515	600499	科达制造	3,800	43,168.00	0.05
516	000825	太钢不锈	11,100	42,957.00	0.05
517	002145	中核钛白	7,290	42,938.10	0.05
518	002507	涪陵榨菜	2,340	42,845.40	0.05
519	600827	百联股份	3,200	42,784.00	0.05
520	603077	和邦生物	17,600	42,768.00	0.05
521	002497	雅化集团	2,400	42,672.00	0.05
522	600208	新潮中宝	17,200	42,656.00	0.05
523	600673	东阳光	5,900	42,539.00	0.05
524	600008	首创环保	14,650	42,192.00	0.05
525	000155	川能动力	2,900	41,760.00	0.05
526	002407	多氟多	2,100	41,706.00	0.05
527	688779	长远锂科	3,700	41,699.00	0.05
528	600258	首旅酒店	2,200	41,690.00	0.05
529	600559	老白干酒	1,700	41,667.00	0.05
530	000893	亚钾国际	1,800	41,292.00	0.05
531	000830	鲁西化工	3,900	41,184.00	0.05
532	300568	星源材质	2,395	41,170.05	0.05
533	603517	绝味食品	1,100	40,865.00	0.05
534	600399	抚顺特钢	4,000	40,800.00	0.05
535	300373	扬杰科技	1,000	40,570.00	0.05
536	002176	江特电机	3,400	40,528.00	0.05
537	002408	齐翔腾达	6,300	40,131.00	0.05
538	002500	山西证券	7,120	39,729.60	0.05
539	600739	辽宁成大	3,000	39,450.00	0.05
540	300438	鹏辉能源	800	38,432.00	0.05
541	000998	隆平高科	2,500	38,375.00	0.05
542	002138	顺络电子	1,600	38,256.00	0.05
543	601997	贵阳银行	7,400	38,184.00	0.05
544	600056	中国医药	2,940	38,161.20	0.05
545	603218	日月股份	2,000	37,980.00	0.05
546	600688	上海石化	12,200	37,942.00	0.05
547	300529	健帆生物	1,630	37,783.40	0.05
548	600315	上海家化	1,300	37,713.00	0.05

549	601118	海南橡胶	8,400	37,632.00	0.05
550	000401	冀东水泥	5,100	37,587.00	0.05
551	603160	汇顶科技	800	37,000.00	0.05
552	601456	国联证券	4,000	36,400.00	0.05
553	601992	金隅集团	16,500	35,970.00	0.05
554	300769	德方纳米	312	34,391.76	0.04
555	601666	平煤股份	4,500	33,930.00	0.04
556	002541	鸿路钢构	1,170	33,707.70	0.04
557	300558	贝达药业	700	33,621.00	0.04
558	002192	融捷股份	500	33,415.00	0.04
559	002092	中泰化学	5,100	32,895.00	0.04
560	600338	西藏珠峰	1,800	32,868.00	0.04
561	600801	华新水泥	2,580	31,863.00	0.04
562	603866	桃李面包	3,144	31,817.28	0.04
563	002432	九安医疗	900	31,689.00	0.04
564	603127	昭衍新药	768	31,411.20	0.04
565	603876	鼎胜新材	1,620	31,087.80	0.04
566	002487	大金重工	1,000	30,840.00	0.04
567	688200	华峰测控	200	30,600.00	0.04
568	600885	宏发股份	960	30,576.00	0.04
569	300357	我武生物	900	30,267.00	0.04
570	300363	博腾股份	1,000	29,590.00	0.04
571	002030	达安基因	2,704	26,958.88	0.03
572	000032	深桑达 A	200	6,580.00	0.01

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	600519	贵州茅台	166,100.00	0.19
2	600221	海航控股	153,416.00	0.18
3	688303	大全能源	133,084.17	0.16
4	300418	昆仑万维	122,737.00	0.14
5	688041	海光信息	118,688.39	0.14
6	600515	海南机场	98,613.00	0.12
7	002050	三花智控	85,543.00	0.10
8	688072	拓荆科技	84,000.00	0.10
9	688120	华海清科	77,950.00	0.09
10	002558	巨人网络	77,650.00	0.09
11	300118	东方日升	71,968.00	0.08

12	002607	中公教育	69,757.00	0.08
13	600970	中材国际	65,585.00	0.08
14	000988	华工科技	62,014.00	0.07
15	688220	翱捷科技	61,299.88	0.07
16	000021	深科技	60,056.00	0.07
17	603893	瑞芯微	58,089.00	0.07
18	600925	苏能股份	55,372.80	0.06
19	300487	蓝晓科技	55,260.00	0.06
20	600378	昊华科技	53,578.00	0.06

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	300124	汇川技术	170,234.00	0.20
2	300750	宁德时代	128,122.00	0.15
3	000858	五粮液	104,529.00	0.12
4	601816	京沪高铁	100,047.00	0.12
5	002013	中航机电	89,569.00	0.11
6	688111	金山办公	84,310.00	0.10
7	688169	石头科技	84,081.20	0.10
8	001301	尚太科技	79,128.72	0.09
9	002594	比亚迪	75,319.00	0.09
10	601136	首创证券	71,179.78	0.08
11	300760	迈瑞医疗	62,236.00	0.07
12	600925	苏能股份	54,297.60	0.06
13	688163	赛伦生物	49,969.30	0.06
14	000568	泸州老窖	47,200.00	0.06
15	301035	润丰股份	46,407.00	0.05
16	300059	东方财富	45,698.00	0.05
17	688256	寒武纪	45,644.00	0.05
18	002304	洋河股份	44,492.00	0.05
19	603605	珀莱雅	42,730.16	0.05
20	000988	华工科技	41,617.00	0.05

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	2,862,188.43
卖出股票收入（成交）总额	4,699,866.59

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）	21,467.45	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,467.45	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	8,473.28	0.01
2	113059	福莱转债	60	7,194.96	0.01
3	118030	睿创转债	40	5,799.21	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，兴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	529.76
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	75,616.24
8	其他	-
9	合计	76,146.00

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	8,473.28	0.01
2	113059	福莱转债	7,194.96	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：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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)	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 (%)
326	166,680.07	48,663,971.00	89.56	5,673,733.00	10.44

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	46,426,797.00	85.44

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	李莉	1,000,000.00	1.84
2	海通证券股份有限公司	905,076.00	1.67
3	华泰证券股份有限公司	849,900.00	1.56
4	上海惠澄资产管理有 限公司-惠澄贤至一 号私募证券投资基金	478,900.00	0.88
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-平安大华 MSCI 中国 A 股国际交 易型开放式指数证券 投资基金联接基金	46,426,797.00	85.44

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	0

门负责人持有本开放式基金	
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	57,337,704.00
本报告期基金总申购份额	-
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

本基金管理人公司董事杨玉萍女士因工作安排不再出任公司第四届董事会董事，公司股东平安信托有限责任公司根据《公司章程》推荐郭晓涛先生接替杨玉萍女士出任公司董事。经公司 2023 年第二次股东会审议，同意郭晓涛先生出任公司董事，杨玉萍女士不再担任公司董事。上述变更自 2023 年 3 月 17 日公司 2023 年第二次股东会做出决议之日起生效。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

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、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 (%)	
广发证券	2	3,085,406.72	42.13	2,225.59	42.13	-
中信建投证券	2	1,850,822.70	25.27	1,335.31	25.28	-
海通证券	4	1,835,738.84	25.06	1,324.08	25.06	-
国盛证券	1	434,003.22	5.93	313.03	5.93	-
长江证券	1	79,128.72	1.08	57.07	1.08	-
中泰证券	2	38,846.15	0.53	28.02	0.53	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	3	-	-	-	-	-
新时代	2	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	-

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	成交金额	占当期债券回购成交总	成交金额	占当期权证
		券				

		成交总额 的比例 (%)		额的比例 (%)		成交总额 的比例 (%)
广发证 券	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	-	-	-	-	-	-
长江证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	平安基金管理有限公司关于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	2023 年 01 月 05 日
2	平安基金管理有限公司关于面向特定投资者(养老金客户)通过直销柜台认、申购旗下所有基金实施费率优惠的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 19 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 2022 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 01 月 19 日
4	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 03 月 31 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 2023 年第 1 季	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 04 月 21 日

	度报告		
6	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增中国中金财富证券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	2023 年 05 月 23 日
7	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增万联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	2023 年 05 月 23 日
8	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 31 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基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2023 年 05 月 31 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	2023/01/01-2023/06/30	48,056,297.00	325,700.00	1,955,200.00	46,426,797.00	85.44
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

2023 年 8 月 31 日