

# 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

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：平安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 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。

本报告除特别注明外，金额单位均为人民币元。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	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	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	23

<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金资产组合情况	54
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	56
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	72
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	72
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b>	<b>74</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2 期末上市基金前十名持有人	75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	75
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	75
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b>	<b>76</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b>	<b>76</b>
11.1 基金份额持有人大会决议	76
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4 基金投资策略的改变	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.8 其他重大事件	78
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b>	<b>80</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	80
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
<b>§ 13 备查文件目录</b>	<b>80</b>
13.1 备查文件目录	80
13.2 存放地点	81
13.3 查阅方式	81

## § 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	57,337,704.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 7 月 20 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		平安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	陈特正	郭明
	联系电话	0755-22626828	(010) 66105799
	电子邮箱	fundservice@pingan.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-800-4800	95588
传真		0755-23997878	(010) 66105798

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.fund.pingan.com">http://www.fund.pingan.com</a>
基金年度报告备置地点	深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-21,874,633.70	33,701,447.41	46,500,103.17
本期利润	-43,966,171.52	17,958,429.86	48,695,258.15
加权平均基 金份额本期 利润	-0.5582	0.1705	0.4604
本期加权平 均净值利润率	-35.11%	9.57%	34.54%
本期基金份 额净值增长 率	-19.15%	8.98%	42.98%
3.1.2 期末 数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分 配利润	27,940,817.94	113,621,111.09	47,220,642.02
期末可供分 配基金份额 利润	0.4873	0.8395	0.5878

期末基金资产净值	85,278,521.94	248,958,815.09	135,605,315.69
期末基金份额净值	1.4873	1.8395	1.6879
3.1.3 累计 期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累 计净值增长 率	48.73%	83.95%	68.79%

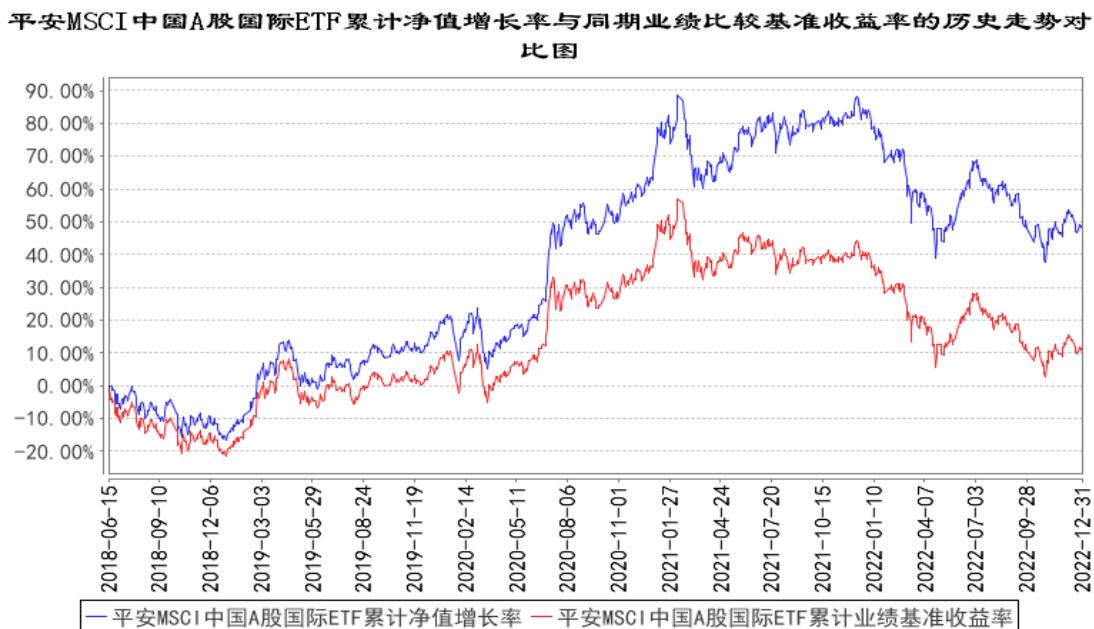
注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；  
 2. 期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，而非当期发生数）；  
 3. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 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
过去三个月	1.23%	1.16%	1.20%	1.20%	0.03%	-0.04%
过去六个月	-11.57%	1.02%	-12.91%	1.07%	1.34%	-0.05%
过去一年	-19.15%	1.24%	-20.71%	1.28%	1.56%	-0.04%
过去三年	25.99%	1.26%	3.70%	1.30%	22.29%	-0.04%
自基金合同生效起至今	48.73%	1.27%	11.30%	1.31%	37.43%	-0.04%

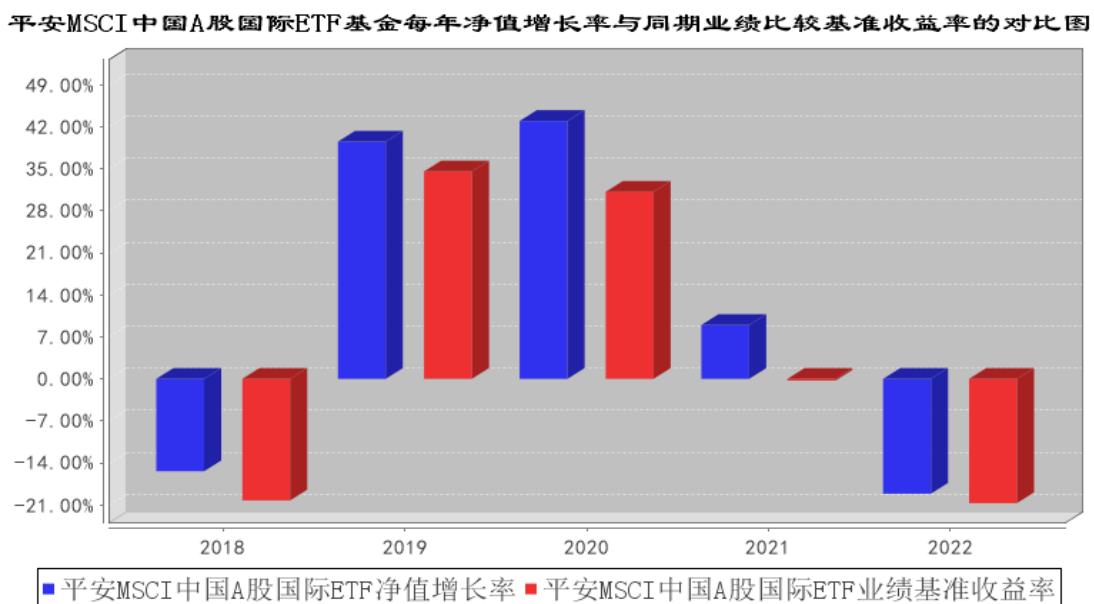
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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。

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



注：本基金合同于 2018 年 06 月 15 日正式生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

注：本基金本报告期内无其他指标。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过往三年无利润分配情况。

## § 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，注册资本金为 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 2022 年 12 月 31 日，平安基金共管理 181 只公募基金，公募资产管理总规模约为 5080.52 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	-	11 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、平安中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金、平安创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、平安中证消费电子 主题交易型开放式指数证券投资基金、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 基金经理。
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	-	8 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，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组型发起式证券投资基金、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组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组证券投资基金发起式联接基金基金经理助理。
王 宁 宁	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	2020 年 11 月 18 日	2022 年 7 月 18 日	5 年	王宁宁女士，法国雷恩高等商学院硕士，曾任平安道远投资管理（上海）有限公司量化投资部助理产品经理，2018 年 11 月加入平安基金管理有限公司，曾任 ETF 指数投资中心指数研究员、基金经理助理。
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 金基 金经 理	2018 年 6 月 15 日	2022 年 6 月 23 日	12 年	成钧先生，上海交通大学博士，南京大学和上海证券交易所博士后，曾任职于上海证券交易所、国泰基金管理有限公司、嘉实基金管理有限公司、中国平安人寿保险股份有限公司。2017 年 2 月加入平安基金管理有限公司，现任 ETF 指数投资中心投资执行总经理。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组证券投资基金、平安中债-中高等级公司债利差因子交易型开放式指数组证券投资基金、平安中证 5-10 年期国债活跃券交易型开放式指数组证券投资基金、平安股息精选沪港深股票型证券投资基金、平安富时中国国企开放共赢交易型开放式指数组证券投资基金、平安中证新能源汽车产业交易型开放式指数组证券投资基金发起式联接基金、平安中证光伏产业指数组型发起式证券投资基金、平安中证港股通医药卫生综合交易型开放式指数组证券投资基金、平安上海金交易型开放式证券投资基金基金经理助理。

					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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金本报告期内基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金投资于 MSCI 中国 A 股国际指数。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 0.04%，年化跟踪误差 0.74%，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 1.4873 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.15%，业绩比较基准收益率为-20.71%。

### 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，全球经济大概率逐渐步入衰退，但幅度较温和，全球通胀趋于回落，美联储紧缩也逐步接近尾声。随着国内经济的修复，海外资金配置 A 股的比例仍有较大的提升空间，预计外资将继续流入。国内方面，随着疫情和防控政策的不断优化，经济趋于复苏。货币政策方面，预计稳增长仍然是首要目标，货币政策整体偏宽松，降准降息仍然可期。财政政策方面，由于国内经济修复叠加海外衰退，经济压力仍然较大，财政政策仍会较为积极，会更多在减税降费方面发力，降低实体企业经营成本。消费方面，随着疫情防控持续优化，消费复苏是大趋势，此外汽车和家电等大宗消费促进政策会逐步落地，预计持续复苏，服务消费也有望逐步复苏。基建方面，作为稳增长重要抓手，目前基建项目储备和资金支持较充裕，韧性较强。综上，我们对 2023 年权益资产的前景保持相对乐观。

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

#### **4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况**

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

#### **4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明**

本基金管理人按照企业会计准则、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。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

报告期内本基金未进行利润分配，符合基金合同的约定。

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

本基金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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对平安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第 20342 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容 我们审计了平安 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“平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金”)的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>

形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的基金管理人平安基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出</p>

	<p>结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	郭素宏 李崇
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	3,322,381.66	5,707,169.79
结算备付金		13,766.36	118,318.80
存出保证金		1,142.07	27,070.70
交易性金融资产	7.4.7.2	82,229,693.89	245,075,968.05
其中：股票投资		82,213,918.04	245,075,968.05
基金投资		-	-
债券投资		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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资	7. 4. 7. 6	-	-
其他权益工具投资	7. 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	7. 4. 7. 8	-	646. 45
资产总计		85, 566, 983. 98	250, 929, 173. 79
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	1, 225, 166. 52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36, 573. 57	110, 064. 03
应付托管费		7, 314. 69	22, 012. 82
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	7. 4. 7. 9	244, 573. 78	613, 115. 33
负债合计		288, 462. 04	1, 970, 358. 70
<b>净资产:</b>			
实收基金	7. 4. 7. 10	57, 337, 704. 00	135, 337, 704. 00
其他综合收益	7. 4. 7. 11	-	-
未分配利润	7. 4. 7. 12	27, 940, 817. 94	113, 621, 111. 09
净资产合计		85, 278, 521. 94	248, 958, 815. 09
负债和净资产总计		85, 566, 983. 98	250, 929, 173. 79

注： 报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.4873 元，基金份额总额 57, 337, 704. 00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021
----	-----	----------------------------	---------------------------------

		年 12 月 31 日	年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-42,734,508.41	20,016,576.47
1. 利息收入		14,361.09	22,280.50
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 13	13,697.53	22,280.50
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“-”号填列）		-20,640,952.12	35,075,297.48
其中：股票投资收益	7. 4. 7. 14	-22,417,835.83	32,588,809.07
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7. 4. 7. 15	25,305.60	-
资产支持证券投资收益	7. 4. 7. 16	-	-
贵金属投资收益	7. 4. 7. 17	-	-
衍生工具收益	7. 4. 7. 18	-	-
股利收益	7. 4. 7. 19	1,751,578.11	2,486,488.41
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）	7. 4. 7. 20	-22,091,537.82	-15,743,017.55
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 21	-16,379.56	662,016.04
<b>减：二、营业总支出</b>		1,231,663.11	2,058,146.61
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	637,675.05	934,258.52
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	127,535.02	186,851.71
3. 销售服务费	7. 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	7. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		0.02	-
8. 其他费用	7. 4. 7. 23	466,453.02	937,036.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-43,966,171.52	17,958,429.86

减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-43,966,171.52	17,958,429.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-43,966,171.52	17,958,429.86

### 7.3 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31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)	-78,000,000.00	-	-85,680,293.15	-163,680,293.15
(一)、综合收益总额	-	-	-43,966,171.52	-43,966,171.52
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值	-78,000,000.00	-	-41,714,121.63	-119,714,121.63

变动数 (净值 减少以 “-”号 填列)				
其中:1. 基金申购款	9,000,000.00	-	5,087,734.59	14,087,734.59
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)	57,337,704.00	-	27,940,817.94	85,278,521.94
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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)	80,337,704.00	-	55,267,611.69	135,605,315.69
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)	80,337,704.00	-	55,267,611.69	135,605,315.69
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	55,000,000.00	-	58,353,499.40	113,353,499.40
(一)、综合收益总额	-	-	17,958,429.86	17,958,429.86
(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)	55,000,000.00	-	40,395,069.54	95,395,069.54
其中:1.基金申购款	137,000,000.00	-	105,342,634.71	242,342,634.71
2.基金赎回款	-82,000,000.00	-	-64,947,565.17	-146,947,565.17
(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)	135,337,704.00	-	113,621,111.09	248,958,815.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

罗春风

林婉文

张南南

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金(原名为平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金，以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2018]528 号《关于准予平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由平安基金管理有限公司(原平安大华基金管理有限公司，已于 2018 年 10 月 25 日办理完成工商变更登记)依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 323,321,955.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第 0365 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《平安大华 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 6 月 15 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 323,337,704.00 份基金份额，其中网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管理联接基金(以下简称“平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金”)。平安 MSCI 中国 A 股国际 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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管理合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

## 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。

金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### **7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则**

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩应回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认

为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

#### 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的收益分配政策为：(1) 基金收益评价日核定的基金份额净值增长率超过同期标的指数增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配；基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一目标的指数收盘值之比减去 1 乘以 100%(期间如发生基金份额折算，则以基金份额折算日为初始日重新计算)；(2) 本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近同期标的指数增

长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；(3) 本基金的收益分配采取现金分红的方式；(4) 《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；(5) 每一基金份额享有同等分配权；(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下简称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年

颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和应收利息，金额分别为 5,707,169.79 元、118,318.80 元、27,070.70 元和 646.45 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金和其他资产-应收利息，金额分别为 5,707,750.84 元、118,372.00 元、27,082.90 元和 0.00 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 245,075,968.05 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 245,075,968.05 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,225,166.52 元、110,064.03 元、22,012.82 元、40,368.27 元和 267,747.06 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,225,166.52 元、110,064.03 元、22,012.82 元、40,368.27 元和 267,747.06 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

- (4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。
- (5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	3,322,381.66	5,707,169.79
等于：本金	3,322,062.29	5,707,169.79
加：应计利息	319.37	-
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	3,322,381.66	5,707,169.79

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	95,889,909.79	-	82,213,918.04	-13,675,991.75
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	13,000.00	10.15	15,775.85
	银行间市场	-	-	-
	合计	13,000.00	10.15	15,775.85
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	95,902,909.79	10.15	82,229,693.89	-13,673,226.05

项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	236,657,656.28	-	245,075,968.05	8,418,311.77
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	236,657,656.28	-	245,075,968.05	8,418,311.77

注：于 2022 年 12 月 31 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为零。（2021 年 12 月 31 日：零）。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 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。

##### 7.4.7.3.3 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。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

##### 7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

#### 7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他债权投资。

### 7.4.7.7 其他权益工具投资

#### 7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末无其他权益工具投资。

### 7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	646.45
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	646.45

### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	2,573.78	40,368.27
其中：交易所市场	2,573.78	40,368.27
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	172,000.00	270,000.00
应付指数使用费	70,000.00	35,000.00
应退退补款	-	267,747.06
合计	244,573.78	613,115.33

注：应退退补款指投资者采用可以现金替代方式申购(赎回)本基金时，替代价格与实际买入成本(实际卖出金额)或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	135,337,704.00	135,337,704.00
本期申购	9,000,000.00	9,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-87,000,000.00	-87,000,000.00
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	57,337,704.00	57,337,704.00

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。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 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
本期期初	129,699,821.21	-16,078,710.12	113,621,111.09
本期利润	-21,874,633.70	-22,091,537.82	-43,966,171.52
本期基金份额交易产生的变动数	-69,102,631.72	27,388,510.09	-41,714,121.63
其中：基金申购款	6,060,774.79	-973,040.20	5,087,734.59
基金赎回款	-75,163,406.51	28,361,550.29	-46,801,856.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	38,722,555.79	-10,781,737.85	27,940,817.94

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,374.83	18,954.05
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,088.69	2,938.97
其他	234.01	387.48
合计	13,697.53	22,280.50

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-14,052,580.69	24,747,269.65
股票投资收益——赎回差价收入	-8,365,255.14	7,841,539.42
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	-22,417,835.83	32,588,809.07

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	76,909,747.92	143,056,434.64
减：卖出股票成本总额	90,796,817.24	118,309,164.99
减：交易费用	165,511.37	-
买卖股票差价收入	-14,052,580.69	24,747,269.65

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	133,801,856.22	146,947,565.17
减：现金支付赎回款总额	53,773,124.22	65,038,404.17
减：赎回股票成本总额	88,393,987.14	74,067,621.58
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-8,365,255.14	7,841,539.42

#### 7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票申购差价收入。

#### 7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票出借差价收入。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	20.44	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	25,285.16	-
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	25,305.60	-

##### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	118,295.80	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	93,000.00	-
减：应计利息总额	10.52	-
减：交易费用	0.12	-
买卖债券差价收入	25,285.16	-

##### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券赎回差价收入。

##### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.17 贵金属投资收益****7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

**7.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,751,578.11	2,486,488.41
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,751,578.11	2,486,488.41

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-22,091,537.82	-15,743,017.55
股票投资	-22,094,303.52	-15,743,017.55
债券投资	2,765.70	-
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	-22,091,537.82	-15,743,017.55

注: 本基金本年度公允价值变动收益-股票投资中包含的可退替代款产生的公允价值变动收益为零  
(2021 年度可比期间: 零)。

#### 7.4.7.21 其他收入

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-16,379.56	176,740.07
其他	-	485,275.97
合计	-16,379.56	662,016.04

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。

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注: 本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	42,000.00	50,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-

银行费用	474.00	530.00
指数使用费	143,979.02	141,798.90
其他	200,000.00	200,000.00
交易费用	—	424,707.48
合计	466,453.02	937,036.38

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
平安基金管理有限公司（“平安基金”）	基金管理人
中国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
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
平安证券	82,777,726.56	79.89	227,375,582.01	70.66

### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	-	-

### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	-	-

### 7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
平安证券	59,434.76	79.88	-	-
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	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 (%)
	161,730.42	70.66	25,313.76	62.71

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。权证交易不计佣金。

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等服务。

### 7.4.10.2 关联方报酬

#### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	637,675.05	934,258.52
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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	127,535.02	186,851.71

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

注：无。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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

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

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

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。

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

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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

注：无。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	48,056,297.00	83.8127	128,514,335.00	94.9583

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行-活期	3,322,381.66	12,374.83	5,707,169.79	18,954.05

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。

#### 7.4.10.7 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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
				数量(单位： 股/张)	总金额
平安证券	600030	中信证券	网上定价	8,130	117,315.90
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 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	605011	杭州热电	公开发行	525	3,239.25
平安证券	605162	新中港	公开发行	1,377	8,358.39

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

为更好地实现基金合同所规定的投资目标，紧密跟踪标的指数，提高基金运作效率，本基金根据基金合同约定的投资策略，按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，经基金托管人审核同意，在报告期内投资于基金管理人的最终控股母公司中国平安保险(集团)股份有限公司发行的股票中国平安、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 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 128,800 股工商银行的 A 股普通股，成本总额为 627,298.51 人民币元，估值总额为 558,992.00 人民币元，占基金资产净值的比例为 0.66% (2021

年 12 月 31 日：数量：320,700 股；成本：1,575,694.30 元；市值：1,484,841.00 元；占基金资产净值的比例：0.60%）。

(2)于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 21,900 股中国平安的 A 股普通股，成本总额为人民币 1,285,496.26 元，估值总额为人民币 1,092,300.00 元，占基金资产净值的比例 1.21%（2021 年 12 月 31 日：数量：55,200 股；成本：3,443,214.02 元；市值：2,782,632.00 元；占基金资产净值的比例：1.12%）。

(3)于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 39,300 股平安银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 712,801.86 元，估值总额为人民币 517,188.00 元，占基金资产净值的比例为 0.61%（2021 年 12 月 31 日：数量：97,800 股；成本：1,843,807.22 元；市值：1,611,744.00 元；占基金资产净值的比例：0.65%）。

(4)于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 17,400.00 股方正证券的 A 股普通股，成本总额为人民币 142,332.42 元，估值总额为人民币 111,012.00 元，占基金资产净值的比例为 0.13%。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

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

注：本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600038	中直股份	2022 年 12 月 26 日	重大事项停牌	46.41	2023 年 1 月 10 日	51.05	1,200	58,414.20	55,692.00	-
300850	新强联	2022 年 12 月 30 日	重大事项停牌	53.28	2023 年 01 月 10 日	56.88	680	84,733.78	36,230.40	-

注：本基金截至 2022 年 12 月 31 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

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。

#### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

### **7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

注：本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### **7.4.13 金融工具风险及管理**

#### **7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中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。

#### **7.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券的发行人出现违约、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

人对债券证券公司的偿付能力等进行了必要的准入管理，且债券证券公司最近 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 0.02%（上年末：无）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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，并按照合约规定的重新定价日或到期日进行了分类。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
上年度末 2021 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	5,707,169.79	-	-	-	5,707,169.79
结算备付金	118,318.80	-	-	-	118,318.80
存出保证金	27,070.70	-	-	-	27,070.70
交易性金融资产	-	-	-	245,075,968.05	245,075,968.05
其他资产	-	-	-	646.45	646.45
资产总计	5,852,559.29	-	-	245,076,614.50	250,929,173.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	110,064.03	110,064.03
应付托管费	-	-	-	22,012.82	22,012.82
应付证券清算款	-	-	-	1,225,166.52	1,225,166.52
其他负债	-	-	-	613,115.33	613,115.33
负债总计	-	-	-	1,970,358.70	1,970,358.70
利率敏感度缺口	5,852,559.29	-	-	243,106,255.80	248,958,815.09

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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 0.02%（上年末：无），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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指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，所面临的最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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	82,213,918.04	96.41	245,075,968.05	98.44
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	82,213,918.04	96.41	245,075,968.05	98.44

#### 7.4.13.4.3.2 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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022 年 12 月 31 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
	沪深 300 指数上升 5%	4,089,305.99	11,743,982.23
	沪深 300 指数下降 5%	-4,089,305.99	-11,743,982.23

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

注：无

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	82,137,771.49	243,703,730.92
第二层次	91,922.40	274,984.78
第三层次	-	1,097,252.35
合计	82,229,693.89	245,075,968.05

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生的当期期初为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,097,252.35	1,097,252.35
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	1,097,252.35	1,097,252.35
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目		上年度可比同期 2021年1月1日至2021年12月31日	
		交易性金融资产	
		债券投资	股票投资
期初余额	-	-	-
当期购买	-	927,190.41	927,190.41
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	255,132.66	255,132.66
当期利得或损失总额	-	425,194.60	425,194.60
其中：计入损益的利得或损失	-	425,194.60	425,194.60
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,097,252.35	1,097,252.35
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	425,194.60	425,194.60

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2022 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允	采用的估	不可观察输入值		

	价值	值技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	1,097,252.35	平均价格 亚式期权 模型	预期年化波动率	31.38%-274.17%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 基金申购款

于 2022 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 14,087,734.59 元(2021 年度：242,342,634.71 元)，其中包括以股票支付的申购款 8,613,314.00 元和以现金支付的申购款 5,474,420.59 元(2021 年度：其中包括以股票支付的申购款 132,585,399.80 元和以现金支付的申购款 109,757,234.91 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	82,213,918.04	96.08
	其中：股票	82,213,918.04	96.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,775.85	0.02
	其中：债券	15,775.85	0.02
	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	3,336,148.02	3.90
8	其他各项资产	1,142.07	0.00

9	合计	85,566,983.98	100.00
---	----	---------------	--------

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	983,079.55	1.15
B	采矿业	3,323,472.58	3.90
C	制造业	47,054,139.73	55.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,841,414.80	3.33
E	建筑业	1,513,247.22	1.77
F	批发和零售业	1,114,971.68	1.31
G	交通运输、仓储和邮政业	2,977,556.60	3.49
H	住宿和餐饮业	167,905.00	0.20
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,973,944.10	3.49
J	金融业	14,421,560.30	16.91
K	房地产业	1,377,149.40	1.61
L	租赁和商务服务业	1,112,226.67	1.30
M	科学研究和技术服务业	789,622.88	0.93
N	水利、环境和公共设施管理业	146,941.40	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	672,946.07	0.79
R	文化、体育和娱乐业	374,938.80	0.44
S	综合	119,164.00	0.14
	合计	81,964,280.78	96.11

### 8.2.2 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	167,083.88	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮电业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	82,553.38	0.10
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	249,637.26	0.29

### 8.2.3 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。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,500	4,317,500.00	5.06
2	300750	宁德时代	4,900	1,927,758.00	2.26
3	600036	招商银行	41,700	1,553,742.00	1.82
4	000858	五粮液	7,900	1,427,451.00	1.67
5	601318	中国平安	21,900	1,029,300.00	1.21
6	600900	长江电力	46,000	966,000.00	1.13
7	002594	比亚迪	3,700	950,789.00	1.11
8	601888	中国中免	3,929	848,781.87	1.00
9	300760	迈瑞医疗	2,500	789,925.00	0.93
10	601166	兴业银行	42,500	747,575.00	0.88
11	600809	山西汾酒	2,420	689,675.80	0.81
12	000568	泸州老窖	3,000	672,840.00	0.79
13	601012	隆基绿能	15,325	647,634.50	0.76
14	603288	海天味业	7,851	624,939.60	0.73
15	600309	万华化学	6,400	592,960.00	0.70

16	002352	顺丰控股	9,900	571,824.00	0.67
17	601398	工商银行	128,800	558,992.00	0.66
18	300059	东方财富	27,075	525,255.00	0.62
19	002714	牧原股份	10,773	525,183.75	0.62
20	000001	平安银行	39,300	517,188.00	0.61
21	601288	农业银行	174,400	507,504.00	0.60
22	600276	恒瑞医药	13,060	503,201.80	0.59
23	600030	中信证券	25,030	498,347.30	0.58
24	002304	洋河股份	3,100	497,550.00	0.58
25	601668	中国建筑	85,840	466,111.20	0.55
26	002475	立讯精密	14,522	461,073.50	0.54
27	300015	爱尔眼科	14,341	445,574.87	0.52
28	002142	宁波银行	13,500	438,075.00	0.51
29	600000	浦发银行	60,100	437,528.00	0.51
30	603259	药明康德	5,264	426,384.00	0.50
31	601899	紫金矿业	42,100	421,000.00	0.49
32	601816	京沪高铁	83,800	412,296.00	0.48
33	600887	伊利股份	13,133	407,123.00	0.48
34	601328	交通银行	80,400	381,096.00	0.45
35	600048	保利发展	24,500	370,685.00	0.43
36	601225	陕西煤业	19,900	369,742.00	0.43
37	300124	汇川技术	5,300	368,350.00	0.43
38	601088	中国神华	13,300	367,346.00	0.43
39	000002	万科 A	19,900	362,180.00	0.42
40	600438	通威股份	9,200	354,936.00	0.42
41	600436	片仔癀	1,200	346,152.00	0.41
42	601601	中国太保	13,800	338,376.00	0.40
43	300014	亿纬锂能	3,833	336,920.70	0.40
44	300274	阳光电源	3,000	335,400.00	0.39
45	600406	国电南瑞	13,712	334,572.80	0.39
46	600905	三峡能源	58,500	330,525.00	0.39
47	600690	海尔智家	12,900	315,534.00	0.37
48	002459	晶澳科技	4,840	290,835.60	0.34
49	300122	智飞生物	3,300	289,839.00	0.34
50	600028	中国石化	64,400	280,784.00	0.33
51	688599	天合光能	4,400	280,544.00	0.33
52	600050	中国联通	62,600	280,448.00	0.33
53	600031	三一重工	17,200	271,760.00	0.32
54	601919	中远海控	26,360	271,244.40	0.32
55	688111	金山办公	1,000	264,490.00	0.31
56	300498	温氏股份	13,360	262,256.80	0.31
57	000725	京东方 A	76,800	259,584.00	0.30
58	601818	光大银行	83,700	256,959.00	0.30

59	002129	TCL 中环	6,700	252,322.00	0.30
60	002493	荣盛石化	20,500	252,150.00	0.30
61	600019	宝钢股份	45,100	252,109.00	0.30
62	000792	盐湖股份	11,100	251,859.00	0.30
63	601658	邮储银行	54,500	251,790.00	0.30
64	601766	中国中车	49,200	251,412.00	0.29
65	300896	爱美客	440	249,194.00	0.29
66	002371	北方华创	1,100	247,830.00	0.29
67	600016	民生银行	71,700	247,365.00	0.29
68	002466	天齐锂业	3,080	243,289.20	0.29
69	002812	恩捷股份	1,780	233,696.20	0.27
70	601985	中国核电	38,600	231,600.00	0.27
71	601390	中国中铁	41,500	230,740.00	0.27
72	002460	赣锋锂业	3,280	227,992.80	0.27
73	600893	航发动力	5,389	227,846.92	0.27
74	600104	上汽集团	15,800	227,678.00	0.27
75	002049	紫光国微	1,720	226,730.40	0.27
76	601988	中国银行	71,100	224,676.00	0.26
77	600585	海螺水泥	8,100	221,778.00	0.26
78	601009	南京银行	21,200	220,904.00	0.26
79	600919	江苏银行	29,930	218,189.70	0.26
80	601857	中国石油	43,700	217,189.00	0.25
81	601669	中国电建	30,600	216,648.00	0.25
82	601066	中信建投	9,100	216,125.00	0.25
83	002311	海大集团	3,500	216,055.00	0.25
84	000596	古井贡酒	800	213,520.00	0.25
85	601211	国泰君安	15,700	213,363.00	0.25
86	000063	中兴通讯	8,200	212,052.00	0.25
87	601006	大秦铁路	31,300	209,084.00	0.25
88	601628	中国人寿	5,600	207,872.00	0.24
89	000625	长安汽车	16,714	205,749.34	0.24
90	600999	招商证券	15,410	204,953.00	0.24
91	000538	云南白药	3,755	204,121.80	0.24
92	002027	分众传媒	30,260	202,136.80	0.24
93	600150	中国船舶	9,000	200,520.00	0.24
94	001979	招商蛇口	15,700	198,291.00	0.23
95	601169	北京银行	44,600	192,226.00	0.23
96	000776	广发证券	12,400	192,076.00	0.23
97	600346	恒力石化	12,280	190,708.40	0.22
98	601688	华泰证券	14,900	189,826.00	0.22
99	000166	申万宏源	47,300	188,254.00	0.22
100	603501	韦尔股份	2,430	187,328.70	0.22
101	601138	工业富联	20,300	186,354.00	0.22

102	600111	北方稀土	7,400	185,370.00	0.22
103	603799	华友钴业	3,317	184,524.71	0.22
104	000651	格力电器	5,700	184,224.00	0.22
105	600010	包钢股份	95,900	184,128.00	0.22
106	000895	双汇发展	7,100	184,103.00	0.22
107	601229	上海银行	29,926	176,862.66	0.21
108	603806	福斯特	2,660	176,730.40	0.21
109	600837	海通证券	20,300	176,407.00	0.21
110	600588	用友网络	7,250	175,232.50	0.21
111	600188	兖矿能源	5,200	174,616.00	0.20
112	002709	天赐材料	3,960	173,685.60	0.20
113	000963	华东医药	3,700	173,160.00	0.20
114	603993	洛阳钼业	37,400	170,170.00	0.20
115	601100	恒立液压	2,692	169,999.80	0.20
116	600886	国投电力	15,500	167,865.00	0.20
117	300316	晶盛机电	2,600	165,256.00	0.19
118	300751	迈为股份	400	164,736.00	0.19
119	600029	南方航空	21,600	164,160.00	0.19
120	600926	杭州银行	12,480	163,238.40	0.19
121	600703	三安光电	9,500	163,020.00	0.19
122	600600	青岛啤酒	1,500	161,250.00	0.19
123	600089	特变电工	8,000	160,640.00	0.19
124	600795	国电电力	37,600	160,552.00	0.19
125	600570	恒生电子	3,919	158,562.74	0.19
126	002230	科大讯飞	4,800	157,584.00	0.18
127	601868	中国能建	68,600	157,094.00	0.18
128	600989	宝丰能源	12,900	155,703.00	0.18
129	603392	万泰生物	1,220	154,574.00	0.18
130	600196	复星医药	4,300	151,532.00	0.18
131	603659	璞泰来	2,920	151,518.80	0.18
132	601633	长城汽车	5,100	151,062.00	0.18
133	002180	纳思达	2,900	150,481.00	0.18
134	688008	澜起科技	2,400	150,240.00	0.18
135	600426	华鲁恒升	4,500	149,175.00	0.17
136	601111	中国国航	13,900	147,340.00	0.17
137	600547	山东黄金	7,688	147,302.08	0.17
138	600233	圆通速递	7,200	144,648.00	0.17
139	000338	潍柴动力	14,200	144,556.00	0.17
140	600009	上海机场	2,500	144,275.00	0.17
141	600660	福耀玻璃	4,100	143,787.00	0.17
142	600011	华能国际	18,700	142,307.00	0.17
143	603986	兆易创新	1,388	142,228.36	0.17
144	300759	康龙化成	2,050	139,400.00	0.16

145	605117	德业股份	420	139,104.00	0.16
146	600015	华夏银行	26,800	139,092.00	0.16
147	603369	今世缘	2,700	137,430.00	0.16
148	601336	新华保险	4,500	135,360.00	0.16
149	300763	锦浪科技	750	135,037.50	0.16
150	600845	宝信软件	3,007	134,713.60	0.16
151	000661	长春高新	800	133,160.00	0.16
152	300142	沃森生物	3,300	132,627.00	0.16
153	600958	东方证券	14,824	132,526.56	0.16
154	600745	闻泰科技	2,500	131,450.00	0.15
155	300999	金龙鱼	3,000	130,680.00	0.15
156	688223	晶科能源	8,900	130,385.00	0.15
157	300661	圣邦股份	750	129,450.00	0.15
158	601689	拓普集团	2,200	128,876.00	0.15
159	600115	中国东航	23,100	127,743.00	0.15
160	600132	重庆啤酒	1,000	127,380.00	0.15
161	688036	传音控股	1,600	127,232.00	0.15
162	300782	卓胜微	1,105	126,301.50	0.15
163	300408	三环集团	4,100	125,911.00	0.15
164	000733	振华科技	1,100	125,653.00	0.15
165	600085	同仁堂	2,800	125,104.00	0.15
166	600875	东方电气	5,900	124,018.00	0.15
167	601127	赛力斯	3,100	123,969.00	0.15
168	603833	欧派家居	1,020	123,960.60	0.15
169	601788	光大证券	8,300	123,421.00	0.14
170	601600	中国铝业	27,600	123,372.00	0.14
171	600256	广汇能源	13,600	122,672.00	0.14
172	000876	新希望	9,500	122,645.00	0.14
173	002001	新和成	6,520	122,250.00	0.14
174	601021	春秋航空	1,900	122,075.00	0.14
175	601877	正泰电器	4,400	121,880.00	0.14
176	300413	芒果超媒	4,040	121,280.80	0.14
177	002241	歌尔股份	7,200	121,176.00	0.14
178	000425	徐工机械	23,900	121,173.00	0.14
179	601618	中国中冶	37,700	119,886.00	0.14
180	002736	国信证券	13,500	119,880.00	0.14
181	000938	紫光股份	6,098	118,971.98	0.14
182	688012	中微公司	1,200	117,612.00	0.14
183	601865	福莱特	3,500	116,585.00	0.14
184	601838	成都银行	7,600	116,280.00	0.14
185	002920	德赛西威	1,100	115,874.00	0.14
186	688396	华润微	2,200	115,830.00	0.14
187	300628	亿联网络	1,900	115,121.00	0.13

188	601825	沪农商行	19,500	114,660.00	0.13
189	600741	华域汽车	6,600	114,378.00	0.13
190	601939	建设银行	20,200	113,726.00	0.13
191	688348	昱能科技	200	113,700.00	0.13
192	601615	明阳智能	4,500	113,670.00	0.13
193	600176	中国巨石	8,287	113,614.77	0.13
194	600522	中天科技	7,000	113,050.00	0.13
195	600039	四川路桥	10,100	112,312.00	0.13
196	600702	舍得酒业	700	111,426.00	0.13
197	601238	广汽集团	10,100	111,403.00	0.13
198	601901	方正证券	17,400	111,012.00	0.13
199	600754	锦江酒店	1,900	110,865.00	0.13
200	603899	晨光股份	2,000	109,960.00	0.13
201	002938	鹏鼎控股	4,000	109,760.00	0.13
202	000100	TCL 科技	29,500	109,740.00	0.13
203	300433	蓝思科技	10,400	109,512.00	0.13
204	002648	卫星化学	7,040	109,120.00	0.13
205	300033	同花顺	1,100	108,471.00	0.13
206	000301	东方盛虹	8,300	108,232.00	0.13
207	601699	潞安环能	6,400	107,840.00	0.13
208	600763	通策医疗	700	107,093.00	0.13
209	601727	上海电气	26,900	105,986.00	0.12
210	601607	上海医药	5,900	105,197.00	0.12
211	600018	上港集团	19,500	104,130.00	0.12
212	601916	浙商银行	35,300	103,782.00	0.12
213	002603	以岭药业	3,460	103,661.60	0.12
214	002821	凯莱英	700	103,600.00	0.12
215	601117	中国化学	12,900	102,426.00	0.12
216	300454	深信服	900	101,295.00	0.12
217	002074	国轩高科	3,500	100,905.00	0.12
218	000983	山西焦煤	8,630	100,539.50	0.12
219	601319	中国人保	19,200	100,224.00	0.12
220	601377	兴业证券	17,430	100,048.20	0.12
221	603290	斯达半导	300	98,790.00	0.12
222	601360	三六零	15,100	98,754.00	0.12
223	000999	华润三九	2,100	98,301.00	0.12
224	600027	华电国际	16,700	98,196.00	0.12
225	688126	沪硅产业	5,572	98,122.92	0.12
226	600383	金地集团	9,500	97,185.00	0.11
227	603345	安井食品	600	97,128.00	0.11
228	000799	酒鬼酒	700	96,558.00	0.11
229	601155	新城控股	4,700	96,350.00	0.11
230	601872	招商轮船	17,100	95,589.00	0.11

231	601995	中金公司	2,500	95,325.00	0.11
232	600460	士兰微	2,900	95,091.00	0.11
233	603606	东方电缆	1,400	94,962.00	0.11
234	688363	华熙生物	700	94,696.00	0.11
235	688063	派能科技	300	94,695.00	0.11
236	688122	西部超导	1,000	94,690.00	0.11
237	002601	龙佰集团	5,000	94,600.00	0.11
238	600674	川投能源	7,700	94,171.00	0.11
239	603939	益丰药房	1,462	93,334.08	0.11
240	000786	北新建材	3,600	93,168.00	0.11
241	000069	华侨城 A	17,300	92,209.00	0.11
242	603688	石英股份	700	91,924.00	0.11
243	603613	国联股份	1,037	91,712.28	0.11
244	688301	奕瑞科技	200	91,576.00	0.11
245	603260	合盛硅业	1,100	91,234.00	0.11
246	603737	三棵树	800	91,064.00	0.11
247	688777	中控技术	1,000	90,830.00	0.11
248	688390	固德威	280	90,465.20	0.11
249	300496	中科创达	900	90,270.00	0.11
250	002252	上海莱士	14,200	90,028.00	0.11
251	300957	贝泰妮	600	89,544.00	0.11
252	002007	华兰生物	3,940	89,162.20	0.10
253	002384	东山精密	3,600	89,028.00	0.10
254	002120	韵达股份	6,170	88,724.60	0.10
255	600160	巨化股份	5,700	88,407.00	0.10
256	600026	中远海能	7,312	88,109.60	0.10
257	603198	迎驾贡酒	1,400	87,892.00	0.10
258	600584	长电科技	3,800	87,590.00	0.10
259	603486	科沃斯	1,200	87,528.00	0.10
260	300003	乐普医疗	3,800	87,286.00	0.10
261	600061	国投资本	13,636	87,134.04	0.10
262	600732	爱旭股份	2,300	86,986.00	0.10
263	600332	白云山	2,900	86,391.00	0.10
264	000629	钒钛股份	18,100	85,613.00	0.10
265	688561	奇安信	1,300	85,501.00	0.10
266	603185	上机数控	800	84,680.00	0.10
267	601881	中国银河	9,100	84,539.00	0.10
268	600779	水井坊	1,000	84,420.00	0.10
269	002568	百润股份	2,256	84,284.16	0.10
270	300347	泰格医药	800	83,840.00	0.10
271	600884	杉杉股份	4,600	83,720.00	0.10
272	002013	中航机电	8,300	83,415.00	0.10
273	600153	建发股份	6,100	83,265.00	0.10

274	002555	三七互娱	4,600	83,260.00	0.10
275	000408	藏格矿业	3,200	83,104.00	0.10
276	002430	杭氧股份	2,100	82,656.00	0.10
276	002841	视源股份	1,400	82,656.00	0.10
277	601878	浙商证券	8,300	82,419.00	0.10
278	600219	南山铝业	25,130	82,175.10	0.10
279	300146	汤臣倍健	3,600	82,152.00	0.10
280	688536	思瑞浦	298	82,072.18	0.10
281	600096	云天化	3,900	82,056.00	0.10
282	600489	中金黄金	10,000	81,900.00	0.10
283	688187	时代电气	1,500	81,855.00	0.10
284	000157	中联重科	15,000	81,600.00	0.10
285	600298	安琪酵母	1,800	81,396.00	0.10
286	688180	君实生物	1,300	81,380.00	0.10
287	600079	人福医药	3,400	81,226.00	0.10
288	000723	美锦能源	9,000	81,180.00	0.10
289	000807	云铝股份	7,300	81,176.00	0.10
290	600023	浙能电力	23,200	80,968.00	0.09
291	603233	大参林	2,044	80,942.40	0.09
292	002916	深南电路	1,116	80,519.40	0.09
293	002202	金风科技	7,300	80,300.00	0.09
293	300144	宋城演艺	5,500	80,300.00	0.09
294	300832	新产业	1,600	80,224.00	0.09
295	600563	法拉电子	500	79,940.00	0.09
296	300724	捷佳伟创	700	79,814.00	0.09
297	600803	新奥股份	4,900	78,890.00	0.09
298	002294	信立泰	2,400	78,840.00	0.09
299	600161	天坛生物	3,316	78,688.68	0.09
300	002625	光启技术	4,600	78,292.00	0.09
301	600918	中泰证券	12,200	78,202.00	0.09
302	002385	大北农	8,700	77,430.00	0.09
303	002422	科伦药业	2,900	77,169.00	0.09
304	688385	复旦微电	1,100	76,791.00	0.09
305	600362	江西铜业	4,400	76,692.00	0.09
306	601799	星宇股份	600	76,422.00	0.09
307	300207	欣旺达	3,600	76,140.00	0.09
308	002414	高德红外	6,845	75,295.00	0.09
309	600004	白云机场	5,000	75,050.00	0.09
310	002080	中材科技	3,500	75,005.00	0.09
311	600536	中国软件	1,270	74,079.10	0.09
312	002756	永兴材料	800	73,736.00	0.09
313	300769	德方纳米	320	73,468.80	0.09
314	603517	绝味食品	1,200	73,308.00	0.09

315	600487	亨通光电	4,860	73,191.60	0.09
316	688009	中国通号	15,257	73,081.03	0.09
317	002340	格林美	9,800	72,814.00	0.09
318	002791	坚朗五金	700	72,765.00	0.09
319	002236	大华股份	6,400	72,384.00	0.08
320	300699	光威复材	1,000	72,250.00	0.08
320	601233	桐昆股份	5,000	72,250.00	0.08
321	603456	九洲药业	1,700	72,131.00	0.08
322	603596	伯特利	900	71,820.00	0.08
323	603658	安图生物	1,160	71,746.00	0.08
324	600157	永泰能源	46,800	71,604.00	0.08
325	600348	华阳股份	5,000	71,250.00	0.08
326	603816	顾家家居	1,660	70,898.60	0.08
327	300223	北京君正	1,000	70,440.00	0.08
328	603882	金域医学	900	70,380.00	0.08
329	000933	神火股份	4,700	70,312.00	0.08
330	601216	君正集团	17,600	70,224.00	0.08
331	300438	鹏辉能源	900	70,191.00	0.08
332	601933	永辉超市	19,200	70,080.00	0.08
333	002064	华峰化学	10,300	70,040.00	0.08
334	600141	兴发集团	2,400	69,600.00	0.08
335	002372	伟星新材	3,260	69,568.40	0.08
336	688169	石头科技	280	69,370.00	0.08
337	000630	铜陵有色	22,200	69,264.00	0.08
338	603589	口子窖	1,200	69,204.00	0.08
339	600183	生益科技	4,800	69,168.00	0.08
340	002518	科士达	1,200	69,120.00	0.08
341	000831	中国稀土	2,100	69,048.00	0.08
342	601555	东吴证券	10,539	68,819.67	0.08
343	688005	容百科技	1,000	68,750.00	0.08
344	300601	康泰生物	2,180	68,735.40	0.08
345	600109	国金证券	7,900	68,730.00	0.08
346	000066	中国长城	6,700	68,340.00	0.08
347	000932	华菱钢铁	14,540	68,338.00	0.08
348	600521	华海药业	3,100	67,766.00	0.08
349	600859	王府井	2,400	67,536.00	0.08
350	002240	盛新锂能	1,800	67,482.00	0.08
351	600352	浙江龙盛	6,800	67,320.00	0.08
352	300390	天华超净	1,200	67,056.00	0.08
353	002223	鱼跃医疗	2,100	66,906.00	0.08
354	000738	航发控制	2,600	66,664.00	0.08
355	603568	伟明环保	3,580	66,337.40	0.08
356	002078	太阳纸业	5,700	65,664.00	0.08

357	601077	渝农商行	18,600	65,658.00	0.08
358	000009	中国宝安	5,400	65,286.00	0.08
359	600985	淮北矿业	5,100	65,280.00	0.08
360	000975	银泰黄金	5,900	65,136.00	0.08
361	688188	柏楚电子	300	65,124.00	0.08
362	000977	浪潮信息	3,024	65,076.48	0.08
363	601636	旗滨集团	5,700	64,923.00	0.08
364	688567	孚能科技	2,400	64,872.00	0.08
365	601108	财通证券	9,060	64,507.20	0.08
366	002739	万达电影	4,600	64,400.00	0.08
367	600873	梅花生物	6,300	64,134.00	0.08
368	002299	圣农发展	2,700	63,963.00	0.08
369	300595	欧普康视	1,790	63,903.00	0.07
370	688052	纳芯微	200	63,520.00	0.07
371	601966	玲珑轮胎	3,100	63,488.00	0.07
372	300037	新宙邦	1,460	63,466.20	0.07
373	688099	晶晨股份	900	63,459.00	0.07
374	600988	赤峰黄金	3,500	63,175.00	0.07
375	600655	豫园股份	8,300	63,163.00	0.07
376	601058	赛轮轮胎	6,300	63,126.00	0.07
377	002831	裕同科技	1,900	62,833.00	0.07
378	002176	江特电机	3,600	62,820.00	0.07
379	600872	中炬高新	1,700	62,679.00	0.07
380	002738	中矿资源	940	62,660.40	0.07
381	002600	领益智造	13,800	62,652.00	0.07
382	601958	金钼股份	5,400	62,370.00	0.07
383	000783	长江证券	11,700	62,361.00	0.07
384	600486	扬农化工	600	62,340.00	0.07
385	600177	雅戈尔	9,840	62,287.20	0.07
386	601880	辽港股份	38,400	62,208.00	0.07
387	000027	深圳能源	9,780	62,200.80	0.07
388	601990	南京证券	7,800	61,854.00	0.07
389	002056	横店东磁	3,300	61,842.00	0.07
390	600705	中航产融	18,800	61,664.00	0.07
391	603707	健友股份	3,410	61,516.40	0.07
392	600415	小商品城	11,700	61,308.00	0.07
393	000683	远兴能源	7,800	61,152.00	0.07
393	002028	思源电气	1,600	61,152.00	0.07
394	002532	天山铝业	7,900	60,988.00	0.07
395	000729	燕京啤酒	5,700	60,534.00	0.07
396	605358	立昂微	1,416	60,321.60	0.07
397	601696	中银证券	5,700	60,249.00	0.07
398	600399	抚顺特钢	4,200	60,102.00	0.07

399	603885	吉祥航空	3,700	59,866.00	0.07
400	002850	科达利	500	59,405.00	0.07
401	600606	绿地控股	19,849	59,150.02	0.07
402	002602	世纪华通	15,500	59,055.00	0.07
403	600848	上海临港	4,920	58,646.40	0.07
404	000591	太阳能	8,000	58,640.00	0.07
405	000728	国元证券	9,230	58,425.90	0.07
406	688516	奥特维	290	58,290.00	0.07
407	002497	雅化集团	2,500	58,125.00	0.07
408	600546	山煤国际	4,000	57,960.00	0.07
409	300373	扬杰科技	1,100	57,860.00	0.07
410	002673	西部证券	9,500	57,855.00	0.07
411	600418	江淮汽车	4,400	57,772.00	0.07
412	002966	苏州银行	7,400	57,572.00	0.07
413	002531	天顺风能	3,800	57,494.00	0.07
414	601577	长沙银行	8,500	57,460.00	0.07
415	002939	长城证券	6,900	57,132.00	0.07
416	600021	上海电力	5,700	57,057.00	0.07
417	600258	首旅酒店	2,300	57,040.00	0.07
418	603156	养元饮品	2,560	57,011.20	0.07
419	600583	海油工程	9,400	56,964.00	0.07
420	000519	中兵红箭	2,900	56,956.00	0.07
421	688779	长远锂科	3,900	56,901.00	0.07
422	600499	科达制造	4,000	56,840.00	0.07
423	600549	厦门钨业	2,900	56,695.00	0.07
424	600642	申能股份	10,300	56,547.00	0.07
425	603077	和邦生物	18,600	56,544.00	0.07
426	300073	当升科技	1,000	56,400.00	0.07
427	000739	普洛药业	2,600	56,004.00	0.07
428	603712	七一二	1,600	55,872.00	0.07
429	002353	杰瑞股份	2,000	55,820.00	0.07
430	600038	中直股份	1,200	55,692.00	0.07
431	002405	四维图新	5,050	55,651.00	0.07
432	002244	滨江集团	6,300	55,629.00	0.07
433	002185	华天科技	6,700	55,543.00	0.07
434	002865	钧达股份	300	55,530.00	0.07
435	002508	老板电器	2,000	55,520.00	0.07
436	000155	川能动力	3,100	55,304.00	0.06
437	300357	我武生物	1,000	55,100.00	0.06
438	300395	菲利华	1,000	55,000.00	0.06
439	002268	电科网安	1,800	54,954.00	0.06
440	300251	光线传媒	6,300	54,558.00	0.06
441	002032	苏 泊 尔	1,100	54,406.00	0.06

442	600977	中国电影	4,000	54,400.00	0.06
443	600733	北汽蓝谷	9,100	54,145.00	0.06
444	600497	驰宏锌锗	10,700	54,142.00	0.06
445	600056	中国医药	3,140	54,102.20	0.06
446	002624	完美世界	4,250	54,060.00	0.06
447	600673	东阳光	6,200	53,878.00	0.06
448	000703	恒逸石化	7,650	53,779.50	0.06
449	300529	健帆生物	1,730	53,578.10	0.06
450	300604	长川科技	1,200	53,496.00	0.06
451	002153	石基信息	3,560	53,364.40	0.06
452	002407	多氟多	1,600	53,312.00	0.06
453	300568	星源材质	2,495	53,043.70	0.06
454	000423	东阿阿胶	1,300	52,910.00	0.06
454	600704	物产中大	11,000	52,910.00	0.06
455	601162	天风证券	18,400	52,808.00	0.06
456	300919	中伟股份	800	52,488.00	0.06
457	603826	坤彩科技	1,000	52,410.00	0.06
458	600143	金发科技	5,400	52,326.00	0.06
459	301035	润丰股份	600	52,260.00	0.06
460	603858	步长制药	2,476	52,020.76	0.06
461	601666	平煤股份	4,800	51,888.00	0.06
462	600392	盛和资源	3,700	51,800.00	0.06
463	600369	西南证券	13,800	51,750.00	0.06
464	601198	东兴证券	6,700	51,724.00	0.06
465	002152	广电运通	5,200	51,688.00	0.06
466	000893	亚钾国际	1,900	51,642.00	0.06
467	000987	越秀资本	8,553	51,232.47	0.06
468	002432	九安医疗	1,000	51,110.00	0.06
469	601168	西部矿业	5,000	51,000.00	0.06
470	688538	和辉光电	19,000	50,920.00	0.06
471	600598	北大荒	3,700	50,912.00	0.06
472	600998	九州通	3,900	50,856.00	0.06
473	000830	鲁西化工	4,100	50,799.00	0.06
474	600416	湘电股份	2,700	50,760.00	0.06
475	603127	昭衍新药	868	50,699.88	0.06
476	603267	鸿远电子	500	50,580.00	0.06
477	601866	中远海发	20,900	50,578.00	0.06
478	000825	太钢不锈	11,700	50,544.00	0.06
479	000709	河钢股份	22,300	50,398.00	0.06
480	000800	一汽解放	6,500	50,245.00	0.06
481	002044	美年健康	8,140	49,898.20	0.06
482	600516	方大炭素	8,147	49,859.64	0.06
483	002797	第一创业	8,800	49,544.00	0.06

484	000960	锡业股份	3,500	49,350.00	0.06
485	601179	中国西电	10,700	49,327.00	0.06
486	600481	双良节能	3,800	49,172.00	0.06
487	688256	寒武纪	900	49,104.00	0.06
488	600566	济川药业	1,800	48,996.00	0.06
489	002507	涪陵榨菜	1,900	48,963.00	0.06
490	002192	融捷股份	500	48,950.00	0.06
491	600170	上海建工	18,800	48,880.00	0.06
492	601456	国联证券	4,300	48,375.00	0.06
493	600390	五矿资本	9,500	48,260.00	0.06
494	002128	电投能源	3,900	48,126.00	0.06
495	600637	东方明珠	7,190	47,813.50	0.06
496	002463	沪电股份	3,980	47,362.00	0.06
497	603605	珀莱雅	280	46,894.40	0.05
498	601991	大唐发电	16,700	46,593.00	0.05
499	300676	华大基因	900	46,521.00	0.05
500	600208	新湖中宝	18,100	45,974.00	0.05
501	300308	中际旭创	1,700	45,951.00	0.05
502	300034	钢研高纳	1,000	45,840.00	0.05
503	000937	冀中能源	7,200	45,792.00	0.05
504	002487	大金重工	1,100	45,507.00	0.05
505	600909	华安证券	9,910	45,486.90	0.05
506	002409	雅克科技	900	45,333.00	0.05
507	600380	健康元	4,008	45,250.32	0.05
508	002030	达安基因	2,904	45,186.24	0.05
509	603160	汇顶科技	900	45,180.00	0.05
510	300363	博腾股份	1,100	44,935.00	0.05
511	600511	国药股份	1,600	44,640.00	0.05
512	600315	上海家化	1,400	44,590.00	0.05
513	002138	顺络电子	1,700	44,506.00	0.05
514	002156	通富微电	2,700	44,496.00	0.05
515	000401	冀东水泥	5,400	44,442.00	0.05
516	002408	齐翔腾达	6,300	44,352.00	0.05
517	601992	金隅集团	17,400	44,196.00	0.05
518	002266	浙富控股	11,300	44,183.00	0.05
519	000050	深天马 A	5,100	44,166.00	0.05
520	603338	浙江鼎力	920	44,022.00	0.05
521	688598	金博股份	200	43,896.00	0.05
522	600008	首创环保	15,450	43,723.50	0.05
523	600338	西藏珠峰	1,900	43,548.00	0.05
524	601997	贵阳银行	7,800	42,822.00	0.05
525	601106	中国一重	14,600	42,778.00	0.05
525	688202	美迪西	200	42,778.00	0.05

526	603218	日月股份	2,100	42,630.00	0.05
527	002926	华西证券	5,600	42,168.00	0.05
528	603866	桃李面包	2,720	41,888.00	0.05
529	000998	隆平高科	2,600	41,782.00	0.05
530	000513	丽珠集团	1,278	41,509.44	0.05
531	600827	百联股份	3,400	41,208.00	0.05
532	600801	华新水泥	2,780	41,199.60	0.05
533	603876	鼎胜新材	1,000	41,040.00	0.05
534	600271	航天信息	3,900	40,599.00	0.05
535	600688	上海石化	13,000	40,430.00	0.05
536	600867	通化东宝	4,400	40,392.00	0.05
537	600739	辽宁成大	3,200	40,288.00	0.05
538	002092	中泰化学	5,400	40,284.00	0.05
539	002500	山西证券	7,520	39,856.00	0.05
540	300726	宏达电子	900	39,726.00	0.05
541	300558	贝达药业	800	39,416.00	0.05
542	688006	杭可科技	900	39,393.00	0.05
543	002145	中核钛白	6,390	39,362.40	0.05
544	002326	永太科技	1,800	39,294.00	0.05
545	600699	均胜电子	2,780	39,059.00	0.05
546	601118	海南橡胶	8,900	38,982.00	0.05
547	601016	节能风电	10,150	38,671.50	0.05
548	601975	招商南油	9,800	38,612.00	0.05
549	688116	天奈科技	500	38,570.00	0.05
550	002465	海格通信	4,724	38,358.88	0.04
551	000750	国海证券	11,510	38,328.30	0.04
552	002065	东华软件	6,700	37,922.00	0.04
553	300776	帝尔激光	300	37,800.00	0.04
554	002541	鸿路钢构	1,270	37,198.30	0.04
555	688002	睿创微纳	1,000	37,190.00	0.04
556	603026	胜华新材	400	36,920.00	0.04
557	601099	太平洋	14,300	36,751.00	0.04
558	300070	碧水源	7,700	36,421.00	0.04
559	600297	广汇汽车	17,300	36,330.00	0.04
560	300850	新强联	680	36,230.40	0.04
561	002506	协鑫集成	12,400	36,084.00	0.04
562	600295	鄂尔多斯	2,340	35,544.60	0.04
563	600885	宏发股份	1,060	35,414.60	0.04
564	688521	芯原股份	800	35,256.00	0.04
565	600711	盛屯矿业	5,900	34,751.00	0.04
566	000988	华工科技	2,100	34,461.00	0.04
567	002456	欧菲光	6,800	32,028.00	0.04
568	603444	吉比特	100	31,284.00	0.04

569	002557	洽洽食品	500	25,000.00	0.03
-----	--------	------	-----	-----------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.10
2	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.08
3	688163	赛伦生物	2,324	49,013.16	0.06
4	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.01
5	001333	光华股份	426	12,332.70	0.01
6	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.01
7	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.01
8	688298	东方生物	20	1,542.20	0.00

### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,983,021.00	0.80
2	300750	宁德时代	557,017.00	0.22
3	000651	格力电器	513,920.00	0.21
4	300919	中伟股份	383,033.00	0.15
5	002371	北方华创	353,125.00	0.14
6	000596	古井贡酒	350,552.00	0.14
7	000792	盐湖股份	301,321.00	0.12
8	000661	长春高新	280,066.00	0.11
9	000568	泸州老窖	269,436.00	0.11
10	000858	五粮液	258,222.00	0.10
11	688223	晶科能源	250,688.35	0.10
12	600436	片仔癀	245,336.00	0.10
13	002920	德赛西威	243,055.00	0.10
14	002049	紫光国微	234,932.00	0.09
15	600036	招商银行	226,742.00	0.09
16	002304	洋河股份	212,208.00	0.09
17	603596	伯特利	211,927.00	0.09
18	603392	万泰生物	208,095.00	0.08
19	002756	永兴材料	204,136.00	0.08
20	300496	中科创达	191,623.00	0.08

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

	码			
1	300750	宁德时代	3,717,519.00	1.49
2	000858	五粮液	2,187,471.00	0.88
3	002594	比亚迪	1,641,608.00	0.66
4	600519	贵州茅台	1,272,653.00	0.51
5	300760	迈瑞医疗	1,225,933.09	0.49
6	000568	泸州老窖	1,168,940.06	0.47
7	000001	平安银行	1,022,317.00	0.41
8	300059	东方财富	968,737.60	0.39
9	002352	顺丰控股	934,554.00	0.38
10	002714	牧原股份	931,871.00	0.37
11	002304	洋河股份	906,793.00	0.36
12	002142	宁波银行	836,888.00	0.34
13	002475	立讯精密	815,275.00	0.33
14	002371	北方华创	785,075.00	0.32
15	002812	恩捷股份	715,611.65	0.29
16	000002	万科 A	635,934.00	0.26
17	300015	爱尔眼科	622,859.00	0.25
18	000596	古井贡酒	611,881.00	0.25
19	002049	紫光国微	578,764.00	0.23
20	300122	智飞生物	578,118.00	0.23

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	29,809,743.89
卖出股票收入（成交）总额	76,909,747.92

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	15,775.85	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	15,775.85	0.02
----	----	-----------	------

## 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	8,813.53	0.01
2	113059	福莱转债	60	6,962.32	0.01

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

## 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期无国债期货投资。

### 8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期无国债期货投资。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字〔2022〕21 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、不良贷款余额 EAST 数据存在偏差；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、未报送权益类投资业务 EAST 数据；五、未报送投资资产管理产品业务 EAST 数据；六、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；七、漏报委托贷款业务 EAST 数据；八、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；九、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十、EAST 系统分户账与总账比对不一致；十一、漏报分户账 EAST 数据；十二、EAST 系统《个人活期存款分户账明细记录》表错报；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报，根据中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对招商银行股份有限公司罚款 300 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 3 月 21 日作出银保监罚决字〔2022〕22 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：一、漏报贸易融资业务 EAST 数据；二、漏报贷款核销业务 EAST 数据；三、漏报信贷资产转让业务 EAST 数据；四、漏报权益类投资业务 EAST 数据；五、漏报投资资产管理产品业务 EAST 数据；六、未报送跟单信用证业务 EAST 数据；七、漏报贷款承诺业务 EAST 数据；八、未报送委托贷款业务 EAST 数据；九、EAST 系统理财产品销售端与产品端数据核对不一致；十、EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；十一、EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；十二、漏报分户账 EAST 数据；十三、EAST 系统《个人信贷业务借据》表错报；十四、EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报，根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，对兴业银行股份有限公司罚款 350 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 9 月 28 日作出银保监罚决字〔2022〕50 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司存在以下违法违规行为：一、老产品规模在部分时点出现反弹；二、未按规定开展理财业务内部审计；三、同业理财产品未持续压降；四、单独使用区间数值展示业绩比较基准；五、理财托管业务违反资产独立性原则要求，依据相关规定，对其处以罚款 450 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 9 月 9 日作出银保监罚决字〔2022〕48 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司个人经营贷款挪用至房地产市场，个人经营贷款“三查”不到位，总行对分支机构管控不力承担管理责任，依据相关规定，对其处以罚款 460 万元。

中国银行保险监督管理委员会于 2022 年 9 月 9 日作出银保监罚决字〔2022〕41 号处罚决定，由于兴业银行股份有限公司债券承销业务严重违反审慎经营规则，依据相关规定，对其处以罚款 150 万元。

中国人民银行于 2022 年 8 月 31 日作出银罚决字〔2022〕1 号处罚决定，由于招商银行股份有限公司存在以下违法违规情况：1. 违反账户管理规定；2. 违反清算管理规定；3. 违反特约商户实名制管理规定；4. 违反支付机构备付金管理规定；5. 违反人民币反假有关规定；6. 占压财政存款或者资金；7. 违反国库科目设置和使用规定；8. 违反信用信息采集、提供、查询及相关管理规定；9. 未按规定履行客户身份识别义务；10. 未按规定报送大额交易报告或者可疑交易报告；11. 与身份不明的客户进行交易或者为客户开立匿名账户、假名账户；12. 违反个人金融信息保护规定；13. 违反金融营销宣传管理规定，依据相关规定，对其提出警告，没收违法所得 5.692641 万元，罚款 3423.5 万元。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数基金，为有效跟踪标的指数，控制跟踪偏

离和跟踪误差，对该证券的投资属于按照指数成份股的权重进行配置，符合指数基金的管理规定，该证券的投资已执行内部严格的投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

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

### 8.12.2 基金投资的前十名股票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。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,142.07
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	-
8	其他	-
9	合计	1,142.07

### 8.12.4 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	113059	福莱转债	6,962.32	0.01

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

#### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中无流通受限的股票。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计可能有尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 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 (%)
305	187,992.47	51,583,271.00	89.96	5,754,433.00	10.04

### 9.1.2 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	48,056,297.00	83.81

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例 (%)
1	海通证券股份有限公司	3,128,276.00	5.46
2	李莉	1,000,000.00	1.74
3	华泰证券股份有限公司	395,400.00	0.69
4	叶意琴	290,000.00	0.51
5	戴和平	254,900.00	0.44
6	徐翠华	250,708.00	0.44
7	曹洪祥	230,000.00	0.40
8	黄思宁	196,000.00	0.34
9	纪远升	140,981.00	0.25
10	梁维灿	135,900.00	0.24
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	48,056,297.00	83.81

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：无。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管 理的产品情况

注：本基金基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 6 月 15 日）	323,337,704.00
基金份额总额	
本报告期期初基金份额总额	135,337,704.00
本报告期基金总申购份额	9,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	87,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	57,337,704.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人—平安基金管理有限公司（以下简称“公司”）董事陈宁先生因工作变动，经公司 2022 年 1 月 19 日召开的 2022 年第一次股东会审议，不再出任公司第四届董事会董事，并由李佩锋先生接替陈宁先生任职公司的董事。

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。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未更换会计师事务所，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 5 年。报告期内应支付给该事务所的报酬为 42,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成 交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金 总量的比例 (%)	
平安证券	2	82,777,726.5 6	79.89	59,434.76	79.88	-
中泰证券	2	17,271,677.4 5	16.67	12,394.89	16.66	-
中信建投 证券	2	2,198,156.81	2.12	1,585.57	2.13	-
长江证券	1	1,369,661.50	1.32	988.21	1.33	-
东方财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	4	-	-	-	-	-
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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名 称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债 券 成交总额 的比例 (%)	成交金额	占当期债券 回购成交总 额的比例 (%)	成交金额	占当期权 证 成交总额 的比例 (%)
平安证	118,295.80	100.00	7,000,000.00	100.00	-	-

券						
中泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
新时代	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于旗下证券投资基金实施新会计准则等相关事宜的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 01 日
2	平安基金管理有限公司关于提醒投资者警惕不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 12 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管理 2021 年第 4 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 21 日
4	平安基金管理有限公司关于旗下基金参与中信证券股份有限公司 A 股配股的关联交易公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 01 月 28 日
5	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增华安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	2022 年 03 月 22 日
6	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金管理 2021 年年度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 03 月 31 日
7	平安基金管理有限公司关于调整公司旗下公募基金产品风险评级相关事项的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 02 日

8	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增东吴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	2022 年 04 月 07 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 2022 年第 1 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 04 月 21 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招募说明书(更新)	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 30 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基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 05 月 30 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更新	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 21 日
13	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	2022 年 06 月 24 日
14	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	2022 年 06 月 24 日
15	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 06 月 24 日
16	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	2022 年 06 月 30 日
17	平安基金管理有限公司关于暂停乾道基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 07 月 18 日
18	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 2 季度报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 07 月 20 日
19	平安基金管理有限公司关于终止与北京懒猫基金销售有限公司销售业务合作的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 08 月 19 日
20	平安基金管理有限公司关于设立上海分公司的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 08 月 24 日
21	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 08 月 31 日
22	平安基金管理有限公司关于新增湘财证券股份有限公司为我司 ETF 产品申购赎回代办机构的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 10 月 24 日
23	平安基金管理有限公司关于提醒投资者防范不法分子冒用“平安基金”名义进行诈骗的风险提示	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 10 月 25 日
24	平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式	中国证监会规定报刊及	2022 年 10 月 25 日

	指数证券投资基金管理有限公司 2022 年第 3 季度报告	网站	
25	平安基金管理有限公司关于终止与国开证券股份有限公司相关销售业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 11 月 11 日
26	平安基金管理有限公司关于终止与深圳信诚基金销售有限公司销售业务合作的公告	中国证监会规定报刊及网站	2022 年 11 月 14 日
27	平安基金管理有限公司关于旗下基金新增华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	2022 年 11 月 17 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2022/01/01-- 2022/12/31	128,514,3 35.00	93,457,2 62.00	173,915,3 00.00	48,056,297.00	83.81

#### 产品特有风险

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

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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管理注册的文件
- (2) 平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金管理合同
- (3) 平安 MSCI 中国 A 股国际交易型开放式指数证券投资基金管理协议

- (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

### 13.2 存放地点

深圳市福田区福田街道益田路 5033 号平安金融中心 34 层

### 13.3 查阅方式

- (1) 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：4008004800（免长途话费）

平安基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日