

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

2021年第2季度报告

2021年6月30日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年七月二十一日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年7月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国联安中小综指(LOF) |
| 场内简称 | 国安中小 |
| 基金主代码 | 162510 |
| 交易代码 | 162510 |
| 基金运作方式 | 上市契约型开放式(LOF) |
| 基金合同生效日 | 2012年3月23日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,934,947.35份 |
| 投资目标 | 本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%，为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。 |
| 投资策略 | 本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来 |

| | |
|--------|---|
| | 复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。 |
| 业绩比较基准 | 95%×中小综指收益率+5%×活期存款利率(税后) |
| 风险收益特征 | 本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 |
|----------------|------------------------|
| | (2021年4月1日-2021年6月30日) |
| 1.本期已实现收益 | 26,491.33 |
| 2.本期利润 | 515,776.91 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0828 |
| 4.期末基金资产净值 | 6,674,148.31 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.125 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长 | 净值增长 | 业绩比较 | 业绩比较 | ①-③ | ②-④ |
|----|------|------|------|------|-----|-----|
|----|------|------|------|------|-----|-----|

| | 率① | 率标准差 ② | 基准收益 率③ | 基准收益 率标准差 ④ | | |
|-----------------------|--------|-----------|------------|-------------------|---------|--------|
| 过去三个月 | 7.97% | 0.82% | 9.37% | 0.84% | -1.40% | -0.02% |
| 过去六个月 | 2.09% | 1.12% | 4.97% | 1.14% | -2.88% | -0.02% |
| 过去一年 | 12.05% | 1.27% | 19.22% | 1.27% | -7.17% | 0.00% |
| 过去三年 | 26.69% | 1.40% | 39.25% | 1.42% | -12.56% | -0.02% |
| 过去五年 | 8.38% | 1.24% | 15.52% | 1.26% | -7.14% | -0.02% |
| 自基金份额 转换日次日 起至今 | 10.31% | 1.64% | 24.59% | 1.63% | -14.28% | 0.01% |

注：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。

3.2.2 自基金转型以来基金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

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月24日至2021年6月30日)



注：1、本基金转换日为2015年3月23日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之A份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额（基

金代码：150070)的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金份额。自2015年3月24日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”，原“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”于2021年4月6日更名为“国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)”；

2、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小企业综合指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

3、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于2012年3月23日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

4、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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-------------|------|--------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 黄欣 | 本基金基金经理、兼任国联安中证100指数证券投资基金(LOF)基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金 | 2016-08-19 | - | 19年（自2002年起） | 黄欣先生，硕士研究生。2003年10月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、债券投资助理、基金经理助理。现任量化投资部总监助理。2010年4月起担任国联安中证100指数证券投资基金(LOF)的基金经理，2010年5月至2012年9月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理，2010年11月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2010年12月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2013年6 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | <p>经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证医药100指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理</p> | | | | <p>月至2017年3月兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金的基金经理，2016年8月起兼任国联安中证医药100指数证券投资基金和国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)（原国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)）的基金经理，2018年3月至2019年7月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2019年5月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019年6月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2019年11月起兼任国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2019年12月起兼任国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2021年2月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021年5月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021年6月起兼任国联安上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> |
|--|--|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | <p>理、国 联安沪 深 300 交易型 开放式 指数证 券投资 基金基 金基 金经 理、国 联安沪 深 300 交易型 开放式 指数证 券投资 基金联 接基金 基金经 理、国 联安中 证全指 证券公 司交易 型开放 式指数 证券投 资基金 基金经 理、国 联安中 证新材 料主题 交易型 开放式 指数证 券投资 基金基 金基 金经 理、国 联安上 证科创 板 50 成份交</p> | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|--------------------|--|--|--|--|
| | 易型开放式指数证券投资基金基金经理。 | | | | |
|--|--------------------|--|--|--|--|

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

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》、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》(以下简称“公平交易制度”)，用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下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发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021年二季度,经过春节后的股价较大幅度的回调之后,A股市场出现了较大的分化,以半导体为代表的科技类公司,在全球“缺芯”的大环境下,盈利水平有了大幅的提升,伴随而来的也是股价的大幅度反弹。疫情方面,虽然多国大力推进疫苗接种,但全球范围内疫苗分配不均,且各类病毒变种的出现,使经济恢复正常的预期再次推迟。我们依旧强调,由于中国政府疫情管控得当,社会全面复工复产,A股的资产在可预见的未来,应该还是全球范围内资产配置的首选投资标的之一。

二季度大小盘股表现分化较大,小盘股表现较好。分行业来看,科技类的股票涨幅较大。整个二季度沪深300指数上涨约3.48%,中小板综指上涨9.87%,创业板综指上涨26.05%。

依据基金合同的约定,本基金始终保持较高的仓位,采用抽样复制的方法跟踪标的指数,将跟踪误差控制在合理范围。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,本基金份额净值为1.125元,本报告期份额净值增长率为7.97%,同期业绩比较基准收益率为9.37%。本报告期内,日均跟踪偏离度为0.10%,年化跟踪误差为1.94%,分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过0.35%,以及年化跟踪误差不超过4.0%的限制。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内本基金资产净值低于5000万元。

拟通过持续营销活动,增加基金规模。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|--------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 6,226,635.88 | 87.97 |
| | 其中:股票 | 6,226,635.88 | 87.97 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 86,060.20 | 1.22 |

| | | | |
|---|-------------------|--------------|--------|
| | 其中：债券 | 86,060.20 | 1.22 |
| | 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 | 555,047.98 | 7.84 |
| 8 | 其他各项资产 | 210,488.35 | 2.97 |
| 9 | 合计 | 7,078,232.41 | 100.00 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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 | 119,718.13 | 1.79 |
| B | 采矿业 | 40,003.58 | 0.60 |
| C | 制造业 | 4,838,968.85 | 72.50 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 23,426.81 | 0.35 |
| E | 建筑业 | 60,396.23 | 0.90 |
| F | 批发和零售业 | 114,879.89 | 1.72 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 99,200.61 | 1.49 |
| H | 住宿和餐饮业 | 4,832.52 | 0.07 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 477,238.28 | 7.15 |
| J | 金融业 | 225,470.47 | 3.38 |
| K | 房地产业 | 38,356.75 | 0.57 |
| L | 租赁和商务服务业 | 112,886.01 | 1.69 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 3,056.00 | 0.05 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 22,061.55 | 0.33 |

| | | | |
|---|---------------|--------------|-------|
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 20,807.00 | 0.31 |
| Q | 卫生和社会工作 | 8,199.00 | 0.12 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 17,134.20 | 0.26 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 6,226,635.88 | 93.29 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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前十名股票投资明细

| 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 | 002415 | 海康威视 | 4,367 | 281,671.50 | 4.22 |
| 2 | 002594 | 比亚迪 | 854 | 214,354.00 | 3.21 |
| 3 | 002304 | 洋河股份 | 862 | 178,606.40 | 2.68 |
| 4 | 002049 | 紫光国微 | 900 | 138,771.00 | 2.08 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 500 | 138,690.00 | 2.08 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 2,798 | 128,708.00 | 1.93 |
| 7 | 002142 | 宁波银行 | 2,645 | 103,075.65 | 1.54 |
| 8 | 002493 | 荣盛石化 | 4,513 | 77,939.51 | 1.17 |
| 9 | 002821 | 凯莱英 | 200 | 74,520.00 | 1.12 |
| 10 | 002027 | 分众传媒 | 7,700 | 72,457.00 | 1.09 |

5.3.2 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前五名股票投资明细

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

本基金本报告期末未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|-----------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 86,060.20 | 1.29 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 86,060.20 | 1.29 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-------|-----------|--------------|
| 1 | 019649 | 21 国债 01 | 860 | 86,060.20 | 1.29 |

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，没有相关投资政策。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除宁波银行外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

宁波银行（002142）的发行主体宁波银行股份有限公司，因作为债务融资工具主承销商，在相关债务融资工具承销及发行工作开展中存在以不正当手段承揽业务、发行工作程序执行不到位、未按照规定开展询价工作等违反银行间市场相关自律管理规则的行为，于2020年12月31日被交易商协会采取警告、暂停债务融资工具相关业务、责令整改的行政监管措施。本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 345.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | 207,769.49 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 976.51 |
| 5 | 应收申购款 | 1,397.25 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 210,488.35 |

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票，不存在积极投资前五名股票流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|--------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 6,218,595.37 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 311,621.98 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 595,270.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - |

| | |
|-------------|--------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 5,934,947.35 |
|-------------|--------------|

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

2021年3月12日国联安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）发布了《关于修改国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同的公告》，根据深圳证券交易所合并（简称“深交所”）主板与中小板工作安排，深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司2021年2月5日的相关公告及相应基金合同的有关规定，基金管理人经与相应基金的基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证券监督管理委员会备案，对旗下国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金合同和托管协议相关条款进行修改。

自2021年4月6日起，国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)正式更名为国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)，修改后的基金合同、托管协议自主板与中小板两板合并日起生效。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)（现国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)）发行及募集的文件
- 2、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- 3、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 4、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二一年七月二十一日