

# 国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

## 2021年年度报告

### 2021年12月31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：二〇二二年三月三十一日

## §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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2021年1月1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
<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 过去三年基金的利润分配情况.....	9
<b>§4 管理人报告</b> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	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.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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 审计意见.....	15
6.2 形成审计意见的基础.....	16
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	16
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	16
<b>§7 年度财务报表</b> .....	17
7.1 资产负债表.....	17
7.2 利润表.....	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	20
7.4 报表附注.....	22
<b>§8 投资组合报告</b> .....	47
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61

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 .....	62
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.....	62
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.....	62
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 .....	62
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	62
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12	投资组合报告附注 .....	62
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>63</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	64
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
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的情况 .....	64
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>64</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>65</b>
11.1	基金份额持有人大会决议.....	65
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 .....	65
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4	基金投资策略的改变.....	65
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	66
11.8	其他重大事件 .....	68
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>70</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>70</b>
13.1	备查文件目录.....	70
13.2	存放地点.....	70
13.3	查阅方式.....	70

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)
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
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
报告期末基金份额总额	5,379,887.77 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年5月20日

## 2.2 基金产品说明

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。

## 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	国联安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李华	李申
	联系电话	021-38992888	021-60637102
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	021-60637111
传真		021-50151582	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区闹市口大街1号 院1号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		于业明	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、深交所网站
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

## 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	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

## §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	2021 年	2020 年	2019 年
---------------	--------	--------	--------

本期已实现收益	403,361.59	379,216.60	-679,908.39
本期利润	535,580.74	1,887,864.67	2,285,257.26
加权平均基金份额本期利润	0.0904	0.2228	0.2022
本期加权平均净值利润率	8.13%	22.02%	24.18%
本期基金份额净值增长率	7.89%	23.40%	28.12%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>
期末可供分配利润	1,322,147.35	1,119,606.57	-527,244.01
期末可供分配基金份额利润	0.2458	0.1591	-0.0500
期末基金资产净值	6,394,852.05	7,753,955.24	9,409,550.56
期末基金份额净值	1.189	1.102	0.893
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2021 年末</b>	<b>2020 年末</b>	<b>2019 年末</b>
基金份额累计净值增长率	16.58%	8.05%	-12.44%

注：1、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；

2、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；

3、对期末可供分配利润，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。

### 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	7.70%	0.80%	8.22%	0.80%	-0.52%	0.00%
过去六个月	5.69%	0.97%	8.14%	0.99%	-2.45%	-0.02%
过去一年	7.89%	1.04%	13.51%	1.06%	-5.62%	-0.02%
过去三年	70.59%	1.32%	92.19%	1.34%	-21.60%	-0.02%
过去五年	12.92%	1.25%	25.81%	1.26%	-12.89%	-0.01%
自基金份额转换日次日起至	16.58%	1.60%	34.72%	1.59%	-18.14%	0.01%

今						
---	--	--	--	--	--	--

注：1、本基金份额转换日为 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、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

#### 国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

自基金转型以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2012 年 3 月 23 日至 2021 年 12 月 31 日)



注：1、本基金份额转换日为 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、本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小板综指收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

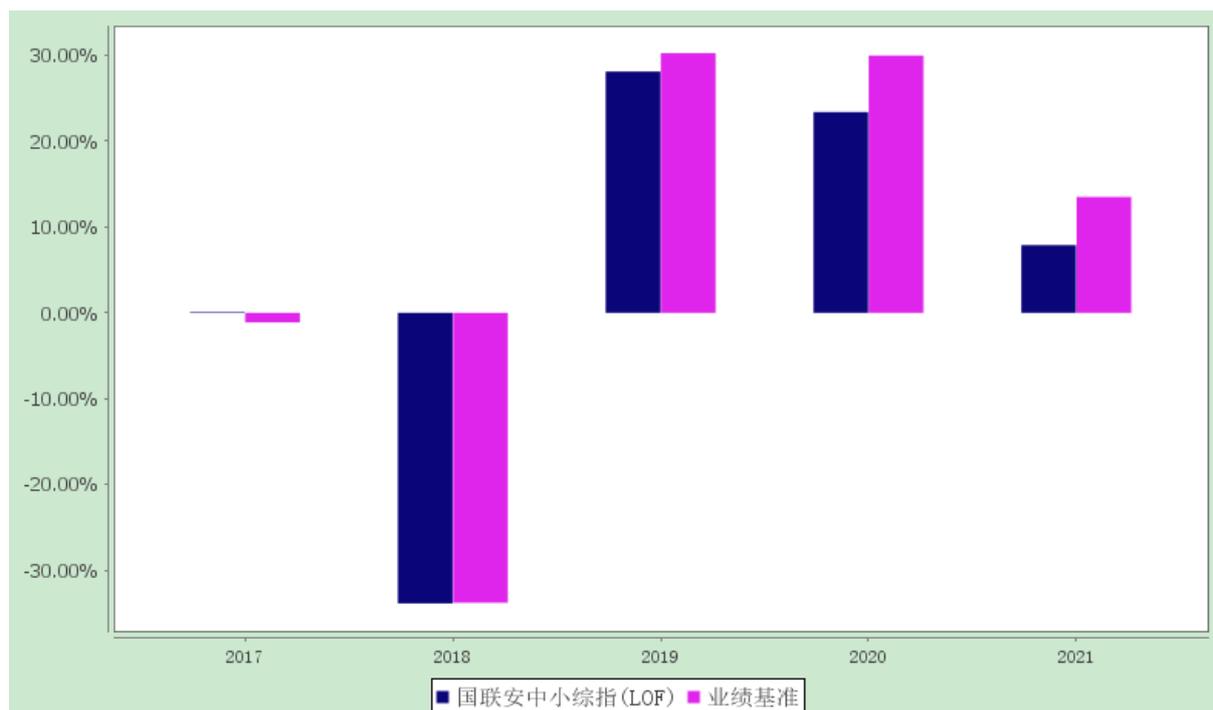
3、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于 2012 年 3 月 23 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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。

### 3.2.3 自基金转型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

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

自基金转型以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、本基金份额转换日为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、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。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021	-	-	-	-	-

2020	-	-	-	-	-
2019	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## §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

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
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	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

	<p>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、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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经理、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基金经理、国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理。</p>				<p>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, 2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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》(原《国联安双力中小板综指证券投资基金(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 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。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度，分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台，不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，通过投资交易管理系统的权限设置确保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均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度，投资交易指令统一通过交易室下达，严格遵守公平交易原则，启用交易系统中的公平交易模块，按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据投资需要独立申报价格和数量，交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配；对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易，以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认，确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应，并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理部对银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

### 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。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。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超过该证券当日成交量 5%的交易次数为 3 次，发生原因是为了满足产品合同中相关投资比例的限制要求。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，执行了 95%置信区间、假设溢价率为 0 的 T 分布检验，同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析，未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 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 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

2021 年，新冠病毒的不断变异导致短期内生活难以完全恢复至正常状态，国外的防疫政策不断在放开-收紧-再放开之间摇摆，全球范围的经济复苏仍旧受到疫情的较大拖累。其中，餐饮、旅游、航空等行业受到疫情冲击较大，而半导体等相关科技产业由于需求旺盛且供给受到疫情影响导致供不应求，从而价格持续走高，处于景气高位。

2021 年，A 股市场大小盘股表现分化较大，小盘股表现较好。全年沪深 300 指数下跌约 5.2%，中小综指上涨约 14.17%，创业板综指上涨约 17.93%。

依据本基金基金合同的约定，本基金始终保持较高的仓位，采用抽样复制的方法跟踪中小综指，将跟踪误差控制在合理范围。

#### 4.4.2 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 1.189 元，本报告期份额净值增长率为 7.89%，同期业绩比较基准收益率为 13.51%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.12%，年化跟踪误差为 2.45%，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。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

多名专家表示新冠疫情有望在今年内结束，各国经济有望恢复到正轨上。关于投资我们认为还

是要围绕科技发展这条主线，长期关注半导体、环保、新能源等方向，同时关注疫情发展的情况，结合估值水平，兼顾一些消费、金融股超跌所带来的投资机会。

#### 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，基金管理人在内部监察工作中本着一切合法合规运作的指导思想、以保障基金份额持有人利益为宗旨，由独立于各业务部门的内部监察人员对公司的经营管理、基金的投资运作及员工的行为规范等方面进行定期和不定期检查，发现问题及时督促有关部门进行整改，并定期制作报告上报公司管理层。具体来说，报告期内基金管理人的内部监察工作重点集中于以下几个方面：

(1) 报告期内，公司密切关注监管部门所颁布的各项最新的法律法规，及时进行法律法规及监管政策的通报和解读。此外，公司还通过组织各项专题合规培训，使投研、市场、中后台的各条线人员加深对法律法规及公司制度的理解，加强员工的合规意识。

(2) 报告期内，公司在监管机构的指导下，持续推动合规经营和风险防范，多次通过邮件和培训等多种形式对公司员工加强教育、引导和监督，并加大了各项稽核力度。

(3) 通过组织各部门认真贯彻落实法规政策、定期自查、监察部门的定期/不定期的抽查，对公司业务的各个方面进行监督检查，包括基金投资、运作、销售等领域，以实现公司的合法合规经营，维护基金份额持有人、公司股东和公司的合法权益。

(4) 加强与托管人的日常联系。公司与托管人的基金日常监督部门加强联系，确定了日常监督的工作方式、业务合作等，并完善日常监督方面的沟通与联系。

基金管理人将继续致力于维护一个有效率、效果的内部控制体系，以风险防范为核心，提高内部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

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据法律法规的规定和本基金基金合同的约定,以及本基金实际运作情况,本基金本报告期末进行利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

#### 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

本报告期内本基金资产净值低于 5000 万元。

基金管理人拟加大营销力度,提升基金规模。

### §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,中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定,不存在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,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内,本基金未实施利润分配。

#### 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

本托管人复核审查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。

### 6 审计报告

普华永道中天审字(2022)第 25597 号

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))全体基金份额持有人:

#### 6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了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)，以下简称“国联安中小综指基金(LOF)”)的财务报表，包括2021年12月31日的资产负债表，2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

## (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，公允反映了国联安中小综指基金(LOF)2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

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。

按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国联安中小综指基金(LOF)，并履行了职业道德方面的其他责任。

## 6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

国联安中小综指基金(LOF)的基金管理人国联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。

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国联安中小综指基金(LOF)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国联安中小综指基金(LOF)、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督国联安中小综指基金(LOF)的财务报告过程。

## 6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

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。

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：

(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。

(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。

(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。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国联安中小综指基金(LOF)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国联安中小综指基金(LOF)不能持续经营。

(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。

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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

魏佳亮 郭劲扬

中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2022 年 3 月 25 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2021年12月31日	2020年12月31日
资产:		-	-
银行存款	7.4.7.1	331,824.91	745,232.86
结算备付金		-	-
存出保证金		171.13	478.78
交易性金融资产	7.4.7.2	6,130,059.61	7,079,358.64
其中: 股票投资		6,044,042.41	7,079,358.64
基金投资		-	-
债券投资		86,017.20	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	2,011.26	85.95
应收股利		-	-
应收申购款		7,391.12	1,097.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>6,471,458.03</b>	<b>7,826,254.08</b>
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
负债:		-	-
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		20,864.18	14,731.30

应付管理人报酬		4,031.99	4,986.85
应付托管费		1,182.72	1,462.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	136.89	698.00
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	50,390.20	50,419.89
<b>负债合计</b>		<b>76,605.98</b>	<b>72,298.84</b>
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	7.4.7.9	5,072,704.70	6,634,348.67
未分配利润	7.4.7.10	1,322,147.35	1,119,606.57
<b>所有者权益合计</b>		<b>6,394,852.05</b>	<b>7,753,955.24</b>
<b>负债和所有者权益总计</b>		<b>6,471,458.03</b>	<b>7,826,254.08</b>

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.189 元，基金份额总额 5,379,887.77 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>913,874.18</b>	<b>2,289,795.87</b>
1.利息收入		2,793.56	3,890.48
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,740.07	3,890.48
债券利息收入		1,053.49	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		775,550.39	773,996.62
其中：股票投资收益	7.4.7.12	710,406.57	689,114.40
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	65,143.82	84,882.22
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	132,219.15	1,508,648.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,311.08	3,260.70
<b>减：二、费用</b>		<b>378,293.44</b>	<b>401,931.20</b>
1. 管理人报酬		49,479.05	64,335.10
2. 托管费		14,513.83	18,871.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	3,762.78	7,934.38
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.19	310,537.78	310,790.12
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>535,580.74</b>	<b>1,887,864.67</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>535,580.74</b>	<b>1,887,864.67</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,634,348.67	1,119,606.57	7,753,955.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	535,580.74	535,580.74
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,561,643.97	-333,039.96	-1,894,683.93
其中：1.基金申购款	1,338,072.85	249,126.70	1,587,199.55
2.基金赎回款	-2,899,716.82	-582,166.66	-3,481,883.48
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,072,704.70	1,322,147.35	6,394,852.05
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,936,794.57	-527,244.01	9,409,550.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本	-	1,887,864.67	1,887,864.67

期利润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-3,302,445.90	-241,014.09	-3,543,459.99
其中：1.基金申购款	1,588,535.67	82,787.03	1,671,322.70
2.基金赎回款	-4,890,981.57	-323,801.12	-5,214,782.69
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	6,634,348.67	1,119,606.57	7,753,955.24

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 王琤, 主管会计工作负责人: 叶培智, 会计机构负责人: 仲晓峰

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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分级证券投资基金、国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF))(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[2011]1593号《关于核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的批复》批准,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金,在基金合同生效后三年内(含三年)为基金分级运作期,基金分级运作期届满,本基金转为上市开放式基金(LOF),存续期不定。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 808,948,084.30 元,业经毕马威华振会计师事务所 KPMG-B(2012)CR No.0018 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 809,109,186.27 份基金份额,其中认购资金利息折合 161,101.97 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建

设银行”）。

根据《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》及本基金的基金管理人发布的《国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告》，本基金的分级运作期自2012年3月23日(基金合同生效日)起至2015年3月23日止。自2015年3月24日起，国联安双力中小板综指分级证券投资基金自动转换为上市开放式基金(LOF)，并更名为“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”。于基金分级运作期届满日2015年3月23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、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之B份额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。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，转型后首日基金规模为18,332,807.68份基金份额。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]207号核准，本基金11,000,077.00份基金份额于2015年5月20日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据深圳证券交易所《关于合并主板与中小板相关安排的通知》及本基金的基金管理人发布的《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)更名的公告》。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)更名为“国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)”，将国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的标的指数名称由“中小板综合指数”调整为“中小企业综合指数”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含原中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货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)。基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。本基金业绩比较基准为：95%×中小企业综合指数收益率+5%×活期存款利率(税后)。

本财务报表由本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司于本基金的审计报告日批准报出。

#### 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》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,开放式基金在基金合同生效后,连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的,基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案,如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等,并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021 年 12 月 31 日,本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形,本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案,故本财务报表仍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 2021 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 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值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

###### (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、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,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

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或资产支持证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、债券投资和衍生工具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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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

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逐日确认。

其他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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 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股票投资和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：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)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

估值业务的指导意见》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(可转换债券和私募债券除外),按照中证指数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 14 号—收入》,本基金于 2021 年 1 月 1 日起执行。本基金在编制 2021 年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再

缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	331,824.91	745,232.86
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	331,824.91	745,232.86

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		4,153,279.18	6,044,042.41	1,890,763.23
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	86,086.00	86,017.20	-68.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	86,086.00	86,017.20	-68.80
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,239,365.18	6,130,059.61	1,890,694.43
项目		上年度末 2020年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		5,320,883.36	7,079,358.64	1,758,475.28
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		5,320,883.36	7,079,358.64	1,758,475.28

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金均未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

本报告期末及上年度末，本基金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

本报告期末及上年度末，本基金均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	35.86	85.73
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	1,975.29	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	0.11	0.22
合计	2,011.26	85.95

注：此处其他列示的是基金深交所的结算保证金利息。

#### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	136.89	698.00
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	136.89	698.00

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2021年12月31日	2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	74.91	12.38
预提审计费	50,000.00	50,000.00
应付指数使用费	315.29	407.51
合计	50,390.20	50,419.89

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,035,908.86	6,634,348.67
本期申购	1,419,106.37	1,338,072.85
本期赎回（以“-”号填列）	-3,075,127.46	-2,899,716.82
本期末	5,379,887.77	5,072,704.70

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	2,368,604.15	-1,248,997.58	1,119,606.57
本期利润	403,361.59	132,219.15	535,580.74
本期基金份额交易产生的变动数	-603,928.08	270,888.12	-333,039.96
其中：基金申购款	544,687.71	-295,561.01	249,126.70
基金赎回款	-1,148,615.79	566,449.13	-582,166.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,168,037.66	-845,890.31	1,322,147.35

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	1,734.43	3,882.52
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	0.60	-
其他	5.04	7.96
合计	1,740.07	3,890.48

注：其他列示的是结算保证金利息收入和直销申购款滞留利息。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	1,881,086.13	3,966,303.65
减：卖出股票成本总额	1,170,679.56	3,277,189.25
买卖股票差价收入	710,406.57	689,114.40

#### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本报告期内本基金无债券投资收益。

#### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益买卖差价收入。

#### 7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益赎回差价收入。

#### 7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益申购差价收入。

#### 7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	65,143.82	84,882.22
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	65,143.82	84,882.22

#### 7.4.7.16 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
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
1.交易性金融资产	132,219.15	1,508,648.07
——股票投资	132,287.95	1,508,648.07
——债券投资	-68.80	-
——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	132,219.15	1,508,648.07

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
基金赎回费收入	3,310.56	3,260.70
转换费收入	0.52	-
合计	3,311.08	3,260.70

#### 7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
交易所市场交易费用	3,762.78	7,934.38
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	3,762.78	7,934.38

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	-	-
上市费	60,000.00	60,000.00
银行汇划费用	580.00	845.00
指数使用费	199,907.78	199,945.12
其他	50.00	-
合计	310,537.78	310,790.12

注：此处其他列示的是托管户名变更费。

#### 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
国联安基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司（“太平洋资管”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无应支付关联方佣金。

#### 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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	49,479.05	64,335.10
其中：支付销售机构的客户维护费	14,237.71	22,926.62

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.75% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	14,513.83	18,871.60

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

#### 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

本报告期内及上年度可比期间，本基金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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行转融通出借业务。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

##### 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

本报告期末及上年度末，除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

#### 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日	2020年1月1日至2020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
中国建设银行	331,824.91	1,734.43	745,232.86	3,882.52

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

本基金通过“中国建设银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2021 年 12 月 31 日：414.32 元(2020 年 12 月 31 日：无)。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金均无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021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

本报告期末本基金无因认购新发/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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021-12-20	重大事项	30.12	2022-01-04	31.00	800.00	10,272.80	24,096.00	

##### 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

本报告期末本基金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为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

##### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金未持有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

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 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。

本基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

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

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 0.00%（2020 年 12 月 31 日：0.00%）。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指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基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品

种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。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。

本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本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未超过该上市公司可流通股票的 30%。

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。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%。

本基金管理人每日对基金组合资产中 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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 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现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	331,824.91	-	-	-	-	-	331,824.91
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	171.13	-	-	-	-	-	171.13
交易性金融资产	86,017.20	-	-	-	-	6,044,042.41	6,130,059.61
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	2,011.26	2,011.26
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	7,391.12	7,391.12
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	418,013.24	-	-	-	-	6,053,444.79	6,471,458.03
负债							

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	20,864.18	20,864.18
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,031.99	4,031.99
应付托管费	-	-	-	-	-	1,182.72	1,182.72
应付交易费用	-	-	-	-	-	136.89	136.89
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	50,390.20	50,390.20
负债总计	-	-	-	-	-	76,605.98	76,605.98
利率敏感度缺口	418,013.24	-	-	-	-	5,976,838.8 1	6,394,852.0 5
上年度末 2020年12月 31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	745,232.86	-	-	-	-	-	745,232.86
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	478.78	-	-	-	-	-	478.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,079,358.6 4	7,079,358.6 4
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	85.95	85.95
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,097.85	1,097.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	745,711.64	-	-	-	-	7,080,542.4 4	7,826,254.0 8
负债							
卖出回购金融	-	-	-	-	-	-	-

资产款							
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,731.30	14,731.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,986.85	4,986.85
应付托管费	-	-	-	-	-	1,462.80	1,462.80
应付交易费用	-	-	-	-	-	698.00	698.00
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	50,419.89	50,419.89
负债总计	-	-	-	-	-	72,298.84	72,298.84
利率敏感度缺口	745,711.64	-	-	-	-	7,008,243.60	7,753,955.24

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的债券、同业存单和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 1.35%(上年度 2020 年 12 月 31 日：0.00%)，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，因而未进行敏感性分析(上年度 2020 年 12 月 31 日：同)。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

#### 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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用抽样复制标的指数的方法跟踪标的指数，即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，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资

组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2021年12月31日		上年度末 2020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	6,044,042.41	94.51	7,079,358.64	91.30
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	-	-	-	-
合计	6,044,042.41	94.51	7,079,358.64	91.30

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加 310,185.49	增加 389,131.50
	业绩比较基准下降 5%	减少 310,185.49	减少 389,131.50

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 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。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，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中属于第一层次的余额为 6,019,946.41 元，属于第二层次的余额为 110,113.20 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 7,073,908.09 元，第二层次 5,450.55 元，无第三层次)。

##### (ii) 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日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公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 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(2020 年 12 月 31 日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《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》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12

月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值执行新金融工具准则外，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	6,044,042.41	93.40
	其中：股票	6,044,042.41	93.40
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	86,017.20	1.33
	其中：债券	86,017.20	1.33
	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	331,824.91	5.13
8	其他各项资产	9,573.51	0.15
9	合计	6,471,458.03	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。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	113,374.39	1.77
B	采矿业	46,149.99	0.72
C	制造业	4,824,153.83	75.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,579.66	0.42
E	建筑业	60,929.35	0.95
F	批发和零售业	107,731.87	1.68
G	交通运输、仓储和邮政业	86,996.10	1.36
H	住宿和餐饮业	4,476.78	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	497,136.60	7.77
J	金融业	147,316.86	2.30
K	房地产业	29,024.41	0.45
L	租赁和商务服务业	39,269.25	0.61
M	科学研究和技术服务业	4,224.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	25,280.32	0.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	9,376.80	0.15
Q	卫生和社会工作	6,280.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	15,742.20	0.25
S	综合	-	-
	合计	6,044,042.41	94.51

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 8.2.2 积极投资期末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。

#### 8.2.3 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。

## 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	占基金资产净值比例(%)
1	002594	比亚迪	754	202,162.48	3.16
2	002049	紫光国微	800	180,000.00	2.81
3	002371	北方华创	500	173,510.00	2.71
4	002304	洋河股份	762	125,524.26	1.96
5	002415	海康威视	2,367	123,841.44	1.94
6	002821	凯莱英	200	87,000.00	1.36
7	002179	中航光电	800	80,448.00	1.26
8	002475	立讯精密	1,298	63,861.60	1.00
9	002025	航天电器	688	57,757.60	0.90
10	002311	海大集团	781	57,247.30	0.90
11	002459	晶澳科技	600	55,620.00	0.87
12	002352	顺丰控股	800	55,136.00	0.86
13	002142	宁波银行	1,399	53,553.72	0.84
14	002410	广联达	800	51,184.00	0.80
15	002129	中环股份	1,148	47,929.00	0.75
16	002271	东方雨虹	909	47,886.12	0.75
17	002714	牧原股份	875	46,690.00	0.73
18	002557	洽洽食品	736	45,160.96	0.71
19	002268	卫士通	800	44,752.00	0.70
20	002230	科大讯飞	850	44,633.50	0.70
21	002493	荣盛石化	2,413	43,820.08	0.69
22	002008	大族激光	800	43,200.00	0.68
23	002240	盛新锂能	729	42,245.55	0.66
24	002326	永太科技	821	42,043.41	0.66
25	002568	百润股份	700	41,881.00	0.65
26	002032	苏泊尔	672	41,825.28	0.65
27	002241	歌尔股份	772	41,765.20	0.65
28	002028	思源电气	806	39,663.26	0.62
29	002648	卫星化学	920	36,827.60	0.58
30	002597	金禾实业	700	35,945.00	0.56
31	002180	纳思达	750	35,820.00	0.56
32	002432	九安医疗	691	34,239.05	0.54
33	002407	多氟多	750	33,742.50	0.53
34	002541	鸿路钢构	600	32,124.00	0.50
35	002353	杰瑞股份	785	31,400.00	0.49
36	002507	涪陵榨菜	800	30,240.00	0.47

37	002508	老板电器	835	30,076.70	0.47
38	002138	顺络电子	750	28,635.00	0.45
39	002050	三花智控	1,127	28,513.10	0.45
40	002223	鱼跃医疗	750	28,350.00	0.44
41	002080	中材科技	821	27,930.42	0.44
42	002736	国信证券	2,400	27,552.00	0.43
43	002626	金达威	836	26,191.88	0.41
44	002001	新和成	818	25,456.16	0.40
45	002153	石基信息	873	25,090.02	0.39
46	002444	巨星科技	806	24,591.06	0.38
47	002534	杭锅股份	766	24,274.54	0.38
48	002683	广东宏大	800	24,096.00	0.38
49	002258	利尔化学	700	23,611.00	0.37
50	002430	杭氧股份	784	23,527.84	0.37
51	002497	雅化集团	800	22,928.00	0.36
52	002439	启明星辰	800	22,824.00	0.36
53	002601	龙佰集团	783	22,385.97	0.35
54	002389	航天彩虹	800	22,240.00	0.35
55	002245	蔚蓝锂芯	800	22,008.00	0.34
56	002402	和而泰	800	21,944.00	0.34
57	002007	华兰生物	750	21,855.00	0.34
58	002294	信立泰	798	21,801.36	0.34
59	002585	双星新材	800	21,664.00	0.34
60	002384	东山精密	799	21,652.90	0.34
61	002555	三七互娱	800	21,616.00	0.34
62	002484	江海股份	778	21,254.96	0.33
63	002414	高德红外	858	20,772.18	0.32
64	002041	登海种业	805	20,760.95	0.32
65	002236	大华股份	872	20,474.56	0.32
66	002368	太极股份	740	20,379.60	0.32
67	002372	伟星新材	825	20,064.00	0.31
68	002013	中航机电	1,100	19,998.00	0.31
69	002603	以岭药业	1,011	19,815.60	0.31
70	002595	豪迈科技	700	19,432.00	0.30
71	002182	云海金属	836	19,177.84	0.30
72	002643	万润股份	800	18,912.00	0.30
73	002338	奥普光电	800	18,896.00	0.30
74	002006	精功科技	698	18,762.24	0.29
75	002202	金风科技	1,139	18,759.33	0.29
76	002690	美亚光电	500	18,730.00	0.29
77	002158	汉钟精机	700	18,641.00	0.29
78	002281	光迅科技	800	18,632.00	0.29
79	002299	圣农发展	770	18,610.90	0.29
80	002242	九阳股份	800	18,560.00	0.29

81	002287	奇正藏药	605	18,488.80	0.29
82	002518	科士达	731	18,348.10	0.29
83	002572	索菲亚	800	17,760.00	0.28
84	002151	北斗星通	450	17,662.50	0.28
85	002625	光启技术	720	17,287.20	0.27
86	002624	完美世界	850	17,263.50	0.27
87	002544	杰赛科技	726	17,235.24	0.27
88	002916	深南电路	140	17,054.80	0.27
89	002030	达安基因	847	16,990.82	0.27
90	002396	星网锐捷	713	16,805.41	0.26
91	002216	三全食品	816	16,491.36	0.26
92	002048	宁波华翔	759	16,417.17	0.26
93	002773	康弘药业	800	16,280.00	0.25
94	002531	天顺风能	831	16,113.09	0.25
95	002201	正威新材	756	15,891.12	0.25
96	002056	横店东磁	832	15,699.84	0.25
97	002156	通富微电	808	15,699.44	0.25
98	002727	一心堂	400	15,404.00	0.24
99	002212	天融信	800	15,336.00	0.24
100	002139	拓邦股份	800	14,952.00	0.23
101	002250	联化科技	827	14,861.19	0.23
102	002254	泰和新材	756	14,825.16	0.23
103	002646	青青稞酒	687	14,420.13	0.23
104	002399	海普瑞	841	14,381.10	0.22
105	002318	久立特材	800	14,304.00	0.22
106	002653	海思科	700	14,280.00	0.22
107	002422	科伦药业	746	14,121.78	0.22
108	002019	亿帆医药	800	14,096.00	0.22
109	002463	沪电股份	843	13,976.94	0.22
110	002273	水晶光电	800	13,912.00	0.22
111	002184	海得控制	967	13,828.10	0.22
112	002232	启明信息	607	13,511.82	0.21
113	002581	未名医药	622	13,279.70	0.21
114	002123	梦网科技	770	13,244.00	0.21
115	002511	中顺洁柔	784	13,100.64	0.20
116	002335	科华数据	353	12,835.08	0.20
117	002405	四维图新	805	12,815.60	0.20
118	002851	麦格米特	400	12,808.00	0.20
119	002088	鲁阳节能	490	12,740.00	0.20
120	002938	鹏鼎控股	300	12,729.00	0.20
121	002675	东诚药业	801	12,639.78	0.20
122	002617	露笑科技	821	12,479.20	0.20
123	002262	恩华药业	793	12,410.45	0.19
124	002739	万达电影	800	12,384.00	0.19

125	002174	游族网络	800	12,192.00	0.19
126	002408	齐翔腾达	1,142	11,991.00	0.19
127	002373	千方科技	800	11,960.00	0.19
128	002191	劲嘉股份	784	11,861.92	0.19
129	002082	万邦德	800	11,832.00	0.19
130	002434	万里扬	800	11,792.00	0.18
131	002777	久远银海	420	11,613.00	0.18
132	002695	煌上煌	712	11,612.72	0.18
133	002340	格林美	1,120	11,592.00	0.18
134	002925	盈趣科技	340	11,570.20	0.18
135	002733	雄韬股份	500	11,565.00	0.18
136	002011	盾安环境	844	11,562.80	0.18
137	002737	葵花药业	700	11,522.00	0.18
138	002346	柘中股份	600	11,502.00	0.18
139	002091	江苏国泰	828	11,368.44	0.18
140	002222	福晶科技	600	11,358.00	0.18
141	002293	罗莱生活	781	11,191.73	0.18
142	002128	电投能源	753	11,182.05	0.17
143	002332	仙琚制药	842	11,114.40	0.17
144	002023	海特高新	810	11,024.10	0.17
145	002275	桂林三金	649	10,974.59	0.17
146	002382	蓝帆医疗	672	10,946.88	0.17
147	002171	楚江新材	818	10,846.68	0.17
148	002612	朗姿股份	342	10,844.82	0.17
149	002782	可立克	600	10,722.00	0.17
150	002436	兴森科技	764	10,696.00	0.17
151	002185	华天科技	841	10,689.11	0.17
152	002152	广电运通	897	10,674.30	0.17
153	002120	韵达股份	520	10,639.20	0.17
154	002017	东信和平	700	10,619.00	0.17
155	002745	木林森	700	10,591.00	0.17
156	002203	海亮股份	849	10,553.07	0.17
157	002039	黔源电力	500	10,540.00	0.16
158	002221	东华能源	836	10,525.24	0.16
159	002312	川发龙蟒	800	10,464.00	0.16
160	002556	辉隆股份	813	10,463.31	0.16
161	002079	苏州固锝	774	10,449.00	0.16
162	002639	雪人股份	700	10,409.00	0.16
163	002747	埃斯顿	400	10,380.00	0.16
164	002078	太阳纸业	900	10,341.00	0.16
165	002140	东华科技	692	10,165.48	0.16
166	002386	天原股份	797	10,145.81	0.16
167	002022	科华生物	682	10,120.88	0.16
168	002145	中核钛白	800	10,072.00	0.16

169	002428	云南锗业	834	10,008.00	0.16
170	002411	延安必康	800	9,960.00	0.16
171	002664	长鹰信质	500	9,925.00	0.16
172	002705	新宝股份	400	9,880.00	0.15
173	002698	博实股份	750	9,780.00	0.15
174	002237	恒邦股份	835	9,761.15	0.15
175	002003	伟星股份	760	9,743.20	0.15
176	002043	兔宝宝	800	9,664.00	0.15
177	002169	智光电气	800	9,648.00	0.15
178	002385	大北农	916	9,608.84	0.15
179	002558	巨人网络	800	9,576.00	0.15
180	002465	海格通信	874	9,544.08	0.15
181	002317	众生药业	778	9,406.02	0.15
182	002635	安洁科技	550	9,366.50	0.15
183	002673	西部证券	1,144	9,232.08	0.14
184	002416	爱施德	800	9,104.00	0.14
185	002024	苏宁易购	2,200	9,064.00	0.14
186	002349	精华制药	800	9,024.00	0.14
187	002374	中锐股份	820	8,938.00	0.14
188	002135	东南网架	771	8,912.76	0.14
189	002926	华西证券	900	8,865.00	0.14
190	002449	国星光电	818	8,818.04	0.14
191	002233	塔牌集团	832	8,802.56	0.14
192	002456	欧菲光	900	8,730.00	0.14
193	002106	莱宝高科	758	8,724.58	0.14
194	002092	中泰化学	913	8,710.02	0.14
195	002157	正邦科技	900	8,694.00	0.14
196	002539	云图控股	652	8,652.04	0.14
197	002100	天康生物	800	8,560.00	0.13
198	002458	益生股份	750	8,482.50	0.13
199	002038	双鹭药业	784	8,475.04	0.13
200	002064	华峰化学	810	8,456.40	0.13
201	002045	国光电器	562	8,430.00	0.13
202	002063	远光软件	843	8,379.42	0.13
203	002797	第一创业	1,140	8,344.80	0.13
204	002538	司尔特	800	8,232.00	0.13
205	002010	传化智联	944	8,212.80	0.13
206	002841	视源股份	100	8,140.00	0.13
207	002602	世纪华通	962	8,071.18	0.13
208	002440	闰土股份	839	8,046.01	0.13
209	002726	龙大美食	760	7,949.60	0.12
210	002249	大洋电机	900	7,911.00	0.12
211	002746	仙坛股份	750	7,867.50	0.12
212	002068	黑猫股份	748	7,854.00	0.12

213	002155	湖南黄金	753	7,801.08	0.12
214	002488	金固股份	887	7,787.86	0.12
215	002020	京新药业	817	7,769.67	0.12
216	002425	凯撒文化	800	7,712.00	0.12
217	002670	国盛金控	800	7,680.00	0.12
218	002101	广东鸿图	650	7,657.00	0.12
219	002520	日发精机	734	7,640.94	0.12
220	002364	中恒电气	800	7,616.00	0.12
221	002649	博彦科技	650	7,592.00	0.12
222	002097	山河智能	776	7,503.92	0.12
223	002376	新北洋	792	7,468.56	0.12
224	002283	天润工业	790	7,457.60	0.12
225	002647	仁东控股	761	7,351.26	0.11
226	002055	得润电子	500	7,305.00	0.11
227	002096	南岭民爆	569	7,288.89	0.11
228	002590	万安科技	686	7,251.02	0.11
229	002545	东方铁塔	795	7,250.40	0.11
230	002461	珠江啤酒	796	7,243.60	0.11
231	002455	百川股份	540	7,155.00	0.11
232	002099	海翔药业	868	7,152.32	0.11
233	002206	海利得	805	7,148.40	0.11
234	002276	万马股份	781	7,036.81	0.11
235	002065	东华软件	900	7,020.00	0.11
236	002614	奥佳华	539	6,942.32	0.11
237	002111	威海广泰	560	6,854.40	0.11
238	002322	理工环科	571	6,846.29	0.11
239	002945	华林证券	500	6,830.00	0.11
240	002481	双塔食品	800	6,816.00	0.11
241	002483	润邦股份	839	6,779.12	0.11
242	002108	沧州明珠	855	6,686.10	0.10
243	002600	领益智造	908	6,682.88	0.10
244	002302	西部建设	832	6,680.96	0.10
245	002605	姚记科技	293	6,659.89	0.10
246	002331	皖通科技	788	6,642.84	0.10
247	002189	中光学	300	6,642.00	0.10
248	002167	东方锆业	837	6,612.30	0.10
249	002130	沃尔核材	800	6,600.00	0.10
250	002095	生意宝	400	6,592.00	0.10
251	002187	广百股份	755	6,583.60	0.10
252	002301	齐心集团	783	6,553.71	0.10
253	002261	拓维信息	790	6,517.50	0.10
254	002939	长城证券	500	6,475.00	0.10
255	002057	中钢天源	700	6,440.00	0.10
256	002300	太阳电缆	790	6,438.50	0.10

257	002540	亚太科技	830	6,391.00	0.10
258	002274	华昌化工	500	6,335.00	0.10
259	002443	金洲管道	800	6,328.00	0.10
260	002378	章源钨业	758	6,306.56	0.10
261	002607	中公教育	800	6,288.00	0.10
262	002126	银轮股份	500	6,280.00	0.10
262	002044	美年健康	800	6,280.00	0.10
264	002584	西陇科学	585	6,201.00	0.10
265	002266	浙富控股	869	6,187.28	0.10
266	002014	永新股份	710	6,091.80	0.10
267	002567	唐人神	815	6,088.05	0.10
268	002424	贵州百灵	800	6,080.00	0.10
269	002563	森马服饰	786	6,075.78	0.10
270	002107	沃华医药	811	6,001.40	0.09
271	002004	华邦健康	823	5,958.52	0.09
272	002183	怡亚通	900	5,958.00	0.09
273	002267	陕天然气	808	5,954.96	0.09
274	002073	软控股份	755	5,949.40	0.09
275	002390	信邦制药	800	5,936.00	0.09
276	002661	克明食品	500	5,920.00	0.09
277	002498	汉缆股份	1,140	5,893.80	0.09
278	002672	东江环保	800	5,888.00	0.09
279	002701	奥瑞金	841	5,887.00	0.09
280	002631	德尔未来	800	5,880.00	0.09
281	002433	太安堂	787	5,871.02	0.09
282	002127	南极电商	850	5,865.00	0.09
283	002327	富安娜	682	5,824.28	0.09
284	002573	清新环境	800	5,824.00	0.09
285	002117	东港股份	696	5,797.68	0.09
286	002413	雷科防务	780	5,795.40	0.09
287	002051	中工国际	810	5,791.50	0.09
288	002119	康强电子	400	5,768.00	0.09
289	002533	金杯电工	669	5,760.09	0.09
290	002313	日海智能	500	5,700.00	0.09
291	002309	中利集团	842	5,691.92	0.09
292	002423	中粮资本	700	5,670.00	0.09
293	002243	力合科创	500	5,645.00	0.09
294	002375	亚厦股份	753	5,639.97	0.09
295	002537	海联金汇	794	5,637.40	0.09
296	002429	兆驰股份	1,155	5,613.30	0.09
297	002608	江苏国信	800	5,600.00	0.09
298	002522	浙江众成	788	5,594.80	0.09
299	002678	珠江钢琴	777	5,594.40	0.09
300	002559	亚威股份	648	5,566.32	0.09

301	002636	金安国纪	368	5,538.40	0.09
302	002251	步步高	805	5,490.10	0.09
303	002339	积成电子	665	5,472.95	0.09
304	002218	拓日新能	808	5,462.08	0.09
305	002002	鸿达兴业	900	5,454.00	0.09
306	002320	海峡股份	907	5,442.00	0.09
307	002226	江南化工	909	5,408.55	0.08
308	002752	昇兴股份	800	5,400.00	0.08
309	002208	合肥城建	692	5,369.92	0.08
310	002398	垒知集团	734	5,358.20	0.08
311	002543	万和电气	706	5,344.42	0.08
312	002081	金螳螂	876	5,326.08	0.08
313	002565	顺灏股份	778	5,298.18	0.08
314	002912	中新赛克	160	5,294.40	0.08
315	002170	芭田股份	789	5,294.19	0.08
316	002441	众业达	518	5,283.60	0.08
316	002012	凯恩股份	888	5,283.60	0.08
318	002197	证通电子	600	5,262.00	0.08
319	002419	天虹股份	837	5,256.36	0.08
320	002298	中电兴发	688	5,221.92	0.08
321	002516	旷达科技	800	5,192.00	0.08
322	002053	云南能投	546	5,170.62	0.08
323	002610	爱康科技	1,100	5,170.00	0.08
324	002367	康力电梯	642	5,155.26	0.08
325	002104	恒宝股份	759	5,153.61	0.08
326	002234	民和股份	300	5,148.00	0.08
327	002146	荣盛发展	1,183	5,146.05	0.08
328	002292	奥飞娱乐	812	5,139.96	0.08
329	002075	沙钢股份	880	5,130.40	0.08
330	002536	飞龙股份	600	5,118.00	0.08
331	002667	鞍重股份	256	5,109.76	0.08
332	002215	诺普信	800	5,104.00	0.08
333	002110	三钢闽光	750	5,100.00	0.08
334	002383	合众思壮	700	5,068.00	0.08
335	002238	天威视讯	801	5,046.30	0.08
336	002657	中科金财	400	5,044.00	0.08
337	002393	力生制药	231	4,991.91	0.08
338	002696	百洋股份	844	4,988.04	0.08
339	002177	御银股份	751	4,971.62	0.08
340	002369	卓翼科技	667	4,962.48	0.08
341	002093	国脉科技	753	4,962.27	0.08
342	002506	协鑫集成	1,300	4,940.00	0.08
343	002355	兴民智通	800	4,888.00	0.08
344	002029	七匹狼	786	4,857.48	0.08

345	002446	盛路通信	800	4,840.00	0.08
346	002141	贤丰控股	746	4,834.08	0.08
347	002035	华帝股份	759	4,827.24	0.08
348	002059	云南旅游	800	4,808.00	0.08
349	002085	万丰奥威	872	4,787.28	0.07
350	002115	三维通信	795	4,785.90	0.07
351	002474	榕基软件	685	4,774.45	0.07
352	002452	长高集团	500	4,765.00	0.07
353	002577	雷柏科技	400	4,764.00	0.07
354	002060	粤水电	858	4,761.90	0.07
355	002362	汉王科技	272	4,686.56	0.07
356	002665	首航高科	908	4,676.20	0.07
357	002395	双象股份	450	4,666.50	0.07
358	002588	史丹利	780	4,641.00	0.07
359	002839	张家港行	800	4,608.00	0.07
360	002345	潮宏基	834	4,595.34	0.07
361	002505	鹏都农牧	1,200	4,584.00	0.07
362	002468	申通快递	500	4,545.00	0.07
363	002462	嘉事堂	323	4,544.61	0.07
364	002479	富春环保	755	4,484.70	0.07
365	002186	全聚德	462	4,476.78	0.07
366	002611	东方精工	800	4,464.00	0.07
367	002798	帝欧家居	300	4,461.00	0.07
368	002244	滨江集团	956	4,454.96	0.07
369	002412	汉森制药	700	4,445.00	0.07
370	002451	摩恩电气	615	4,434.15	0.07
371	002548	金新农	755	4,431.85	0.07
372	002583	海能达	800	4,416.00	0.07
373	002016	世荣兆业	766	4,335.56	0.07
374	002435	长江健康	820	4,321.40	0.07
375	002674	兴业科技	381	4,278.63	0.07
376	002641	公元股份	778	4,263.44	0.07
377	002697	红旗连锁	800	4,256.00	0.07
378	002328	新朋股份	709	4,254.00	0.07
379	002154	报喜鸟	843	4,240.29	0.07
380	002178	延华智能	800	4,224.00	0.07
381	002165	红宝丽	666	4,189.14	0.07
382	002392	北京利尔	818	4,122.72	0.06
383	002400	省广集团	800	4,104.00	0.06
384	002570	贝因美	800	4,096.00	0.06
385	002161	远望谷	800	4,064.00	0.06
386	002381	双箭股份	500	4,040.00	0.06
386	002391	长青股份	500	4,040.00	0.06
388	002550	千红制药	832	4,018.56	0.06

389	002521	齐峰新材	634	3,968.84	0.06
390	002546	新联电子	937	3,935.40	0.06
391	002160	常铝股份	800	3,904.00	0.06
392	002609	捷顺科技	400	3,900.00	0.06
393	002406	远东传动	636	3,898.68	0.06
394	002204	大连重工	894	3,888.90	0.06
395	002344	海宁皮城	793	3,885.70	0.06
396	002492	恒基达鑫	652	3,879.40	0.06
397	002564	天沃科技	818	3,877.32	0.06
398	002467	二六三	800	3,856.00	0.06
399	002682	龙洲股份	650	3,763.50	0.06
400	002360	同德化工	401	3,729.30	0.06
401	002491	通鼎互联	748	3,680.16	0.06
402	002404	嘉欣丝绸	638	3,674.88	0.06
403	002239	奥特佳	1,000	3,650.00	0.06
404	002510	天汽模	800	3,632.00	0.06
404	002547	春兴精工	800	3,632.00	0.06
406	002083	孚日股份	782	3,605.02	0.06
407	002627	三峡旅游	675	3,591.00	0.06
408	002042	华孚时尚	785	3,587.45	0.06
409	002519	银河电子	810	3,555.90	0.06
410	002587	奥拓电子	650	3,542.50	0.06
411	002662	京威股份	830	3,535.80	0.06
412	002676	顺威股份	798	3,495.24	0.05
413	002365	永安药业	329	3,490.69	0.05
414	002181	粤传媒	767	3,489.85	0.05
415	002308	威创股份	756	3,485.16	0.05
416	002478	常宝股份	800	3,464.00	0.05
417	002148	北纬科技	640	3,449.60	0.05
418	002574	明牌珠宝	696	3,424.32	0.05
419	002476	宝莫股份	759	3,407.91	0.05
420	002343	慈文传媒	580	3,358.20	0.05
421	002394	联发股份	408	3,349.68	0.05
422	002366	台海核电	692	3,349.28	0.05
423	002457	青龙管业	400	3,348.00	0.05
424	002307	北新路桥	780	3,330.60	0.05
425	002622	融钰集团	754	3,317.60	0.05
426	002589	瑞康医药	825	3,242.25	0.05
427	002285	世联行	811	3,179.12	0.05
428	002685	华东重机	828	3,154.68	0.05
429	002580	圣阳股份	385	3,149.30	0.05
430	002217	合力泰	900	3,141.00	0.05
431	002485	雪松发展	672	3,138.24	0.05
432	002596	海南瑞泽	832	3,136.64	0.05

433	002047	宝鹰股份	792	3,128.40	0.05
434	002054	德美化工	331	3,118.02	0.05
435	002578	闽发铝业	794	3,096.60	0.05
436	002621	美吉姆	780	3,088.80	0.05
437	002421	达实智能	800	3,088.00	0.05
438	002554	惠博普	806	3,070.86	0.05
439	002303	美盈森	852	3,058.68	0.05
440	002062	宏润建设	753	3,057.18	0.05
441	002195	二三四五	1,306	3,056.04	0.05
442	002654	万润科技	700	2,968.00	0.05
443	002694	顾地科技	660	2,956.80	0.05
444	002037	保利联合	363	2,925.78	0.05
445	002528	英飞拓	778	2,894.16	0.05
446	002087	新野纺织	782	2,815.20	0.04
447	002228	合兴包装	764	2,788.60	0.04
448	002628	成都路桥	768	2,764.80	0.04
449	002717	岭南股份	800	2,760.00	0.04
450	002689	远大智能	836	2,742.08	0.04
451	002131	利欧股份	1,100	2,706.00	0.04
452	002489	浙江永强	751	2,681.07	0.04
453	002593	日上集团	646	2,642.14	0.04
454	002431	棕榈股份	807	2,638.89	0.04
455	002118	紫鑫药业	754	2,586.22	0.04
456	002310	东方园林	860	2,562.80	0.04
457	002277	友阿股份	786	2,562.36	0.04
458	002347	泰尔股份	496	2,524.64	0.04
459	002796	世嘉科技	300	2,472.00	0.04
460	002314	南山控股	782	2,439.84	0.04
461	002231	奥维通信	400	2,412.00	0.04
462	002325	洪涛股份	833	2,382.38	0.04
463	002542	中化岩土	800	2,360.00	0.04
464	002437	誉衡药业	800	2,328.00	0.04
465	002316	亚联发展	476	2,251.48	0.04
466	002377	国创高新	666	2,211.12	0.03
467	002523	天桥起重	756	2,207.52	0.03
468	002620	瑞和股份	340	2,196.40	0.03
469	002471	中超控股	800	2,192.00	0.03
470	002495	佳隆股份	760	2,052.00	0.03
471	002211	宏达新材	499	2,025.94	0.03
472	002295	精艺股份	285	2,006.40	0.03
473	002482	广田集团	815	1,980.45	0.03
474	002494	华斯股份	446	1,966.86	0.03
475	002417	深南股份	386	1,964.74	0.03
476	002630	华西能源	790	1,911.80	0.03

477	002305	南国置业	912	1,887.84	0.03
478	002031	巨轮智能	834	1,768.08	0.03
479	002348	高乐股份	800	1,744.00	0.03
480	002591	恒大高新	300	1,710.00	0.03
481	002663	普邦股份	800	1,528.00	0.02
482	002503	搜于特	826	1,305.08	0.02
483	002807	江阴银行	300	1,155.00	0.02
484	002144	宏达高科	100	1,013.00	0.02
485	002209	达意隆	100	683.00	0.01

### 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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

## 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	002142	宁波银行	3,075.38	0.04

### 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 (%)
1	002415	海康威视	222,455.00	2.87
2	002475	立讯精密	113,611.00	1.47
3	002142	宁波银行	101,834.00	1.31
4	002027	分众传媒	93,403.00	1.20
5	002493	荣盛石化	77,212.00	1.00
6	002714	牧原股份	74,638.00	0.96
7	002594	比亚迪	50,561.00	0.65
8	002736	国信证券	44,711.00	0.58
9	002129	中环股份	44,247.00	0.57
10	002049	紫光国微	41,348.00	0.53
11	002304	洋河股份	41,255.00	0.53
12	002241	歌尔股份	36,463.00	0.47

13	002074	国轩高科	29,450.00	0.38
14	002050	三花智控	26,981.00	0.35
15	002311	海大集团	21,939.00	0.28
16	002202	金风科技	20,372.00	0.26
17	002271	东方雨虹	20,070.00	0.26
18	002024	苏宁易购	19,824.00	0.26
19	002001	新和成	19,699.00	0.25
20	002007	华兰生物	18,719.00	0.24

#### 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

买入股票的成本（成交）总额	3,075.38
卖出股票的收入（成交）总额	1,881,086.13

注：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	86,017.20	1.35
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	86,017.20	1.35

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 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	019649	21 国债 01	860	86,017.20	1.35

### 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

本报告期末本基金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

本报告期末本基金未持有贵金属。

### 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

本报告期末本基金未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 8.10.1 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。

#### 8.10.2 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。

### 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

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

#### 8.11.2 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。

#### 8.11.3 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴

责、处罚的情形。

8.12.2 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。

### 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	171.13
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,011.26
5	应收申购款	7,391.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,573.51

### 8.12.4 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。

### 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

本报告期末本基金前十名指数投资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

本报告期末本基金未持有积极投资，不存在前五名积极投资中流通受限情况。

## §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

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
602	8,936.69	-	-	5,379,887.77	100.00%

### 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	郑淑女	932,651.00	17.34%
2	李锦山	543,778.00	10.11%
3	朱洪宏	348,595.00	6.48%
4	许海燕	188,278.00	3.50%
5	陈春宁	188,269.00	3.50%
6	肖瑞华	137,044.00	2.55%
7	李桂荣	123,542.00	2.30%
8	李跃	81,122.00	1.51%
9	刘正能	79,713.93	1.48%
10	黎秀香	72,301.92	1.34%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2012 年 3 月 23 日)基金份额总额	809,109,186.27
本报告期期初基金份额总额	7,035,908.86
本报告期基金总申购份额	1,419,106.37
减：本报告期基金总赎回份额	3,075,127.46
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期末基金份额总额	5,379,887.77
-------------	--------------

注：1、本基金份额转换日为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、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。

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 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

1、2021年2月18日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，李柯女士不再担任公司副总经理（财务总监、首席运营官）及首席信息官职务。

2、2021年7月24日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，叶培智先生担任公司副总经理（财务总监兼首席运营官）职务。

3、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

本基金报告年度支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为5万元人民币。目前该事务所已向本基金提供连续4年的审计服务。

### 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

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

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	
国信证券国信证券股份有限公司	1	1,881,086.13	100.00%	-	-	1
东北证券东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

A 提供的研究报告质量和数量；

B 研究报告被基金采纳的情况；

- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

**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		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
国信证券国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券安信证券股份有限公司	86,086.00	100.00%	-	-	-	-
第一创业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	国联安基金管理有限公司关于终止杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-01-05
2	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2020年第4季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-01-22
3	国联安基金管理有限公司旗下全部基金2020年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2021-01-22
4	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书更新(2021年第1号)	规定网站、深圳证券交易所	2021-02-08
5	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-02-18
6	国联安基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-05
7	国联安基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-05
8	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启富为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-30
9	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2020年年度报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-03-31
10	国联安基金管理有限公司旗下全部基金2020年年度报告提示性公告	规定报刊	2021-03-31
11	国联安基金管理有限公司关于旗下指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	规定报刊、规定网站、上海证券交易所、深圳证券交易所	2021-03-31
12	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同	规定网站、深圳证券交易所	2021-03-31
13	国联安基金管理有限公司关于国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)更名的公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2021-04-02
14	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-02
15	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)托管协议	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-02
16	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-06
17	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-06
18	国联安基金管理有限公司关于在网上直销平	规定报刊、规定网站	2021-04-09

	台开展货币基金转认/申购业务、网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动的公告		
19	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-09
20	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-09
21	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)2021 年第 1 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-22
22	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2021-04-22
23	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书更新(2021 年第 4 号)	规定网站、深圳证券交易所	2021-05-20
24	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2021-05-20
25	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-06-29
26	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国人寿相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-07-06
27	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	规定网站、深圳证券交易所	2021-07-21
28	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2021-07-21
29	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-07-24
30	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浦发银行相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-07-30
31	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加招商证券相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-08-02
32	国联安基金管理有限公司关于旗下深交所基金新增扩位简称的公告	规定网站、规定报刊、深圳证券交易所	2021-08-21
33	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)2021 年中期报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-08-31
34	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年中期报告提示性公告	规定报刊	2021-08-31
35	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加基煜基金为代销机构的公告	规定网站、规定报刊	2021-10-22
36	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加宁波银行相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-10-22
37	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)2021 年第 3 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-10-27
38	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2021-10-27
39	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加新时代证券相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-11-15

40	国联安基金管理有限公司关于在网上直销平台开展银行卡自动扣款申购基金费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-12-02
41	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与工商银行前端费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-12-24

## §12 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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安双力中小板综指分级证券投资基金（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

### 13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

### 13.3 查阅方式

网址：[www.cpicfunds.com](http://www.cpicfunds.com)

国联安基金管理有限公司  
二〇二二年三月三十一日