

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

2022 年中期报告

2022 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：二〇二二年八月三十一日

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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	17
7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	56
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	56
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	56
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	56
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
7.12 投资组合报告附注.....	57
8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58

8.2 期末上市基金前十名持有人	58
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	59
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	59
9 开放式基金份额变动	59
10 重大事件揭示	60
10.1 基金份额持有人大会决议	60
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	60
10.4 基金投资策略的改变	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	60
10.8 其他重大事件	62
11 备查文件目录	63
11.1 备查文件目录	63
11.2 存放地点	63
11.3 查阅方式	63

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	5,367,463.20 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%×中小企业综合指数收益率+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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-290,573.03
本期利润	-874,044.21
加权平均基金份额本期利润	-0.1610
本期加权平均净值利润率	-15.91%
本期基金份额净值增长率	-13.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	439,505.76
期末可供分配基金份额利润	0.0819
期末基金资产净值	5,500,416.74
期末基金份额净值	1.025
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	0.50%

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
过去一个月	8.01%	1.13%	9.62%	1.13%	-1.61%	0.00%
过去三个月	2.81%	1.68%	6.39%	1.69%	-3.58%	-0.01%
过去六个月	-13.79%	1.58%	-10.19%	1.58%	-3.60%	0.00%
过去一年	-8.89%	1.30%	-2.88%	1.31%	-6.01%	-0.01%
过去三年	23.79%	1.31%	45.02%	1.32%	-21.23%	-0.01%
自基金份额转换日次日起至今	0.50%	1.60%	21.00%	1.59%	-20.50%	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)

份额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2022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	2016-08-19	-	20 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

	<p>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、国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)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、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</p>			<p>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 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)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, 2022 年 5 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联接基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--

	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、国联安上 证科创板 50 成份交易型开 放式指数证券 投资基金联接 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 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本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 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

2022 年上半年，新冠病毒的奥米克戎变种在国内开始传播，对经济增长带来一定的影响，俄乌战争的爆发更是为全球经济复苏蒙上了一层阴影。全球范围内大宗商品价格大幅上涨，多国的通胀水平创了近十年来的新高。

在这样的宏观环境下，2022 年上半年 A 股市场普遍下跌，但在 4 月底之后出现一波较大的反弹。整个上半年来看，沪深 300 指数下跌约 9.22%，中小板综指下跌 10.77%，创业板综指下跌 15.91%。

依据基金合同的约定，双力中小企业指数基金始终保持较高的仓位，采用抽样复制的方法跟踪中小企业综指，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 1.0250 元，本报告期份额净值增长率为-13.79%，同期业绩比较基准收益率为-10.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

新冠疫情的发展以及俄乌战争的进程还存在很多不确定性，展望下半年，在投资上还需谨慎，以风险控制为主，适当关注疫情控制后带来的消费、旅游等板块的机会，长期来看，继续关注科技发展这条主线，包括半导体、环保、新能源等方向。

4.6 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。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金资产净值低于 5000 万元。

拟通过持续营销活动做大基金资产规模。

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，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	405,470.77	331,824.91
结算备付金		-	-
存出保证金		50.99	171.13
交易性金融资产	6.4.7.2	5,157,810.17	6,130,059.61
其中：股票投资		5,157,810.17	6,044,042.41
基金投资		-	-
债券投资		-	86,017.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		40,728.63	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,996.40	7,391.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	2,011.26
资产总计		5,607,056.96	6,471,458.03
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		44,611.58	20,864.18
应付管理人报酬		3,383.80	4,031.99
应付托管费		992.61	1,182.72
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	57,652.23	50,527.09
负债合计		106,640.22	76,605.98
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,060,910.98	5,072,704.70
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	439,505.76	1,322,147.35
净资产合计		5,500,416.74	6,394,852.05
负债和净资产总计		5,607,056.96	6,471,458.03

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.025 元，基金份额总额 5,367,463.20 份。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-694,098.05	378,123.41
1.利息收入		724.90	1,059.46
其中：存款利息收入	6.4.7.9	724.90	1,059.46
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-112,607.35	455,957.10
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-157,496.44	411,216.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	28.51	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	44,860.58	44,740.74
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.14	-583,471.18	-80,016.53
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	1,255.58	1,123.38
减：二、营业总支出		179,946.16	190,459.41
1. 管理人报酬		20,446.61	25,675.69
2. 托管费		5,997.70	7,531.49
3. 销售服务费		-	-
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. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	153,501.85	157,252.23
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-874,044.21	187,664.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-874,044.21	187,664.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-874,044.21	187,664.00

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	5,072,704.70	-	1,322,147.35	6,394,852.05
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）	5,072,704.70	-	1,322,147.35	6,394,852.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,793.72	-	-882,641.59	-894,435.31
（一）、综合收益总额	-	-	-874,044.21	-874,044.21
（二）、本期基金份额交易产生的	-11,793.72	-	-8,597.38	-20,391.10

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中：1.基金申购 款	716,928.22	-	49,709.78	766,638.00
2.基金赎回 款	-728,721.94	-	-58,307.16	-787,029.10
(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)	5,060,910.98	-	439,505.76	5,500,416.74
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资 产(基金净值)	6,634,348.67	-	1,119,606.57	7,753,955.24
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)	6,634,348.67	-	1,119,606.57	7,753,955.24
三、本期增减变动 额(减少以“-” 号填列)	-1,038,264.93	-	-41,542.00	-1,079,806.93
(一)、综合收益 总额	-	-	187,664.00	187,664.00
(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)	-1,038,264.93	-	-229,206.00	-1,267,470.93
其中：1.基金申购 款	598,333.03	-	95,650.99	693,984.02
2.基金赎回 款	-1,636,597.96	-	-324,856.99	-1,961,454.95
(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)	5,596,083.74	-	1,078,064.57	6,674,148.31

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 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： $95\% \times \text{中小企业综合指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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 6.4.4 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 2022 年 6 月 30 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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、资产支持证券投资，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卖出回购金融资产款和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)

(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。

6.4.4.4 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，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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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,以及因级别调整而引起的 A、B 级基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。债券投资和资产支持证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和资产支持证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。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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净资产转出。

6.4.4.12 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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》(以下合称“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，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年度可比期间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。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、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 331,824.91 元、171.13 元、2,011.26 元和 7,391.12 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、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 331,860.77 元、171.24 元、0.00 元和 7,391.12 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 6,130,059.61 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 6,132,034.90 元。原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 20,864.18 元、4,031.99 元、1,182.72 元、136.89 元和 390.20 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付赎回款、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 20,864.18 元、4,031.99 元、1,182.72 元、136.89 元和 390.20 元。

于 2021 年 12 月 31 日，“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，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，本基金无期初留存收益影响。

(b)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>》根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个

人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 日
活期存款	405,470.77
等于：本金	405,427.97
加：应计利息	42.80
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	405,470.77

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,850,586.92	-	5,157,810.17	1,307,223.25
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	3,850,586.92	-	5,157,810.17	1,307,223.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	166.48
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,768.61
其中：交易所市场	3,768.61
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	258.19
预提审计费	24,795.19
预提上市费	28,663.76
合计	57,652.23

6.4.7.7 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6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,379,887.77	5,072,704.70
本期申购	760,374.66	716,928.22
本期赎回（以“-”号填列）	-772,799.23	-728,721.94
本期末	5,367,463.20	5,060,910.98

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 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	2,168,037.66	-845,890.31	1,322,147.35
本期利润	-290,573.03	-583,471.18	-874,044.21
本期基金份额交易产生的变动数	5,788.77	-14,386.15	-8,597.38
其中：基金申购款	295,595.80	-245,886.02	49,709.78
基金赎回款	-289,807.03	231,499.87	-58,307.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,883,253.40	-1,443,747.64	439,505.76

6.4.7.9 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6月30日
活期存款利息收入	724.19
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	-
其他	0.71
合计	724.90

注：此处其他列示的是基金深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	2,154,928.43
减：卖出股票成本总额	2,306,111.26
减：交易费用	6,313.61
买卖股票差价收入	-157,496.44

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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6月30日
债券投资收益——利息收入	114.51

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-86.00
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	28.51

6.4.7.11.2 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6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	88,089.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	86,086.00
减：应计利息总额	2,089.80
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-86.00

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	44,860.58
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	44,860.58

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日

1.交易性金融资产	-583,471.18
——股票投资	-583,539.98
——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	-583,471.18

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	1,226.78
转换费收入	28.80
合计	1,255.58

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
上市费	28,663.76
指数使用费	99,942.90
银行汇划费用	100.00
合计	153,501.85

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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

6.4.10 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。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 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的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月 30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月 30日

当期发生的基金应支付的管理费	20,446.61	25,675.69
其中：支付销售机构的客户维护费	2,555.61	7,749.64

注：在本基金分级运作期到期后，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% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,997.70	7,531.49

注：支付基金托管人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：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方发生转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2022年1月1日至2022年6月30日		2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	405,470.77	724.19	555,047.98	1,055.93

注：本基金通过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 2022 年 6 月 30 日无相关余额（2021 年 6 月 30 日无相关余额）。

6.4.10.7 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购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2022年6月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 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
002411	延安必康	2022-05-05	未在法定期限内披露定期报告	6.55	2022-07-01	6.22	800.00	14,603.08	5,240.00	-
002670	国盛金控	2022-06-01	重大事项	9.60	2022-07-14	9.99	800.00	8,823.48	7,680.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本报告期末本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、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 2022 年 6 月 30 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%（2021 年 12 月 31 日：0.00%）。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金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 6.4.12。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年6月 30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	405,470.77	-	-	-	-	-	405,470.77
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	50.99	-	-	-	-	-	50.99
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	5,157,810.17	5,157,810.17
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	40,728.63	40,728.63
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	2,996.40	2,996.40
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	405,521.76	-	-	-	-	5,201,535.20	5,607,056.96
负债							
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	44,611.58	44,611.58
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	3,383.80	3,383.80
应付托管费	-	-	-	-	-	992.61	992.61
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	57,652.23	57,652.23

负债总计	-	-	-	-	-	106,640.22	106,640.22
利率敏感度缺口	405,521.76	-	-	-	-	5,094,894.98	5,500,416.74
上年度末 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	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	7,391.12	7,391.12
其他资产	-	-	-	-	-	2,011.26	2,011.26
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
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	50,527.09	50,527.09
负债总计	-	-	-	-	-	76,605.98	76,605.98
利率敏感度缺口	418,013.24	-	-	-	-	5,976,838.81	6,394,852.05

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 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 0.00%(2021 年 12 月 31 日: 1.35%), 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(2021 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 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	5,157,810.17	93.77	6,044,042.41	94.51
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,157,810.17	93.77	6,044,042.41	94.51

6.4.13.4.3.2 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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 273,743.91	增加 310,185.49
	业绩比较基准下降 5%	减少 273,743.91	减少 310,185.49

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	5,144,890.17	6,019,946.41
第二层次	12,920.00	110,113.20
第三层次	-	-
合计	5,157,810.17	6,130,059.61

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 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：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

除公允价值和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。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,157,810.17	91.99
	其中：股票	5,157,810.17	91.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	405,470.77	7.23
8	其他各项资产	43,776.02	0.78

9	合计	5,607,056.96	100.00
---	----	--------------	--------

注：1、本报告期末本基金未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

2、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	147,312.08	2.68
B	采矿业	48,096.66	0.87
C	制造业	3,832,153.97	69.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,009.32	0.95
E	建筑业	54,269.02	0.99
F	批发和零售业	51,661.29	0.94
G	交通运输、仓储和邮政业	205,049.50	3.73
H	住宿和餐饮业	593.96	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	278,614.54	5.07
J	金融业	323,558.67	5.88
K	房地产业	21,082.11	0.38
L	租赁和商务服务业	84,347.94	1.53
M	科学研究和技术服务业	5,715.00	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	18,154.11	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,104.40	0.11
Q	卫生和社会工作	12,254.00	0.22
R	文化、体育和娱乐业	16,833.60	0.31
S	综合	-	-
	合计	5,157,810.17	93.77

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 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。

7.2.3 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。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	654	218,102.46	3.97
2	002415	海康威视	5,067	183,425.40	3.33
3	002352	顺丰控股	2,700	150,687.00	2.74
4	002475	立讯精密	3,898	131,713.42	2.39
5	002142	宁波银行	3,599	128,880.19	2.34
6	002304	洋河股份	662	121,245.30	2.20
7	002714	牧原股份	1,975	109,158.25	1.98
8	002129	TCL 中环	1,748	102,939.72	1.87
9	002812	恩捷股份	400	100,180.00	1.82
10	002466	天齐锂业	800	99,840.00	1.82
11	002371	北方华创	300	83,136.00	1.51
12	002493	荣盛石化	5,313	81,767.07	1.49
13	002460	赣锋锂业	500	74,350.00	1.35
14	002271	东方雨虹	1,109	57,080.23	1.04
15	002049	紫光国微	300	56,916.00	1.03
16	002241	歌尔股份	1,672	56,179.20	1.02
17	002027	分众传媒	8,000	53,840.00	0.98
18	002179	中航光电	840	53,188.80	0.97
19	002050	三花智控	1,927	52,953.96	0.96
20	002311	海大集团	881	52,868.81	0.96
21	002709	天赐材料	800	49,648.00	0.90
22	002230	科大讯飞	1,150	47,403.00	0.86
23	002736	国信证券	4,900	46,893.00	0.85
24	002920	德赛西威	300	44,400.00	0.81
25	002459	晶澳科技	560	44,184.00	0.80
26	002001	新和成	1,681	38,343.61	0.70
27	002938	鹏鼎控股	1,200	36,252.00	0.66
28	002648	卫星化学	1,287	33,268.95	0.60
29	002180	纳思达	650	32,903.00	0.60
30	002410	广联达	600	32,664.00	0.59

31	002074	国轩高科	700	31,920.00	0.58
32	002756	永兴材料	200	30,442.00	0.55
33	002821	凯莱英	100	28,900.00	0.53
34	002202	金风科技	1,839	27,217.20	0.49
35	002013	中航机电	2,200	27,170.00	0.49
36	002032	苏泊尔	472	26,592.48	0.48
37	002120	韵达股份	1,520	25,931.20	0.47
38	002240	盛新锂能	429	25,894.44	0.47
39	002080	中材科技	921	25,327.50	0.46
40	002056	横店东磁	932	24,809.84	0.45
41	002340	格林美	2,620	23,842.00	0.43
42	002945	华林证券	1,500	22,875.00	0.42
43	002916	深南电路	240	22,490.40	0.41
44	002268	卫士通	500	21,455.00	0.39
45	002025	航天电器	288	20,108.16	0.37
46	002372	伟星新材	825	19,833.00	0.36
47	002603	以岭药业	811	19,707.30	0.36
48	002405	四维图新	1,305	19,666.35	0.36
49	002497	雅化集团	600	19,590.00	0.36
50	002007	华兰生物	850	19,380.00	0.35
51	002414	高德红外	1,501	19,317.87	0.35
52	002508	老板电器	535	19,276.05	0.35
53	002600	领益智造	3,808	19,116.16	0.35
54	002555	三七互娱	900	19,107.00	0.35
55	002738	中矿资源	200	18,522.00	0.34
56	002078	太阳纸业	1,500	18,465.00	0.34
57	002384	东山精密	799	18,321.07	0.33
58	002430	杭氧股份	584	18,255.84	0.33
59	002601	龙佰集团	883	17,704.15	0.32
60	002236	大华股份	1,072	17,602.24	0.32
61	002432	九安医疗	291	17,477.46	0.32
62	002939	长城证券	1,700	17,272.00	0.31
63	002507	涪陵榨菜	500	17,260.00	0.31
64	002407	多氟多	350	17,118.50	0.31
65	002531	天顺风能	1,031	17,001.19	0.31
66	002294	信立泰	598	16,803.80	0.31
67	002008	大族激光	500	16,565.00	0.30
68	002739	万达电影	1,200	16,380.00	0.30
69	002185	华天科技	1,741	16,330.58	0.30
70	002850	科达利	100	15,900.00	0.29
71	002353	杰瑞股份	385	15,515.50	0.28
72	002463	沪电股份	1,043	15,394.68	0.28
73	002192	融捷股份	100	15,370.00	0.28
74	003816	中国广核	5,400	15,120.00	0.27

75	002624	完美世界	1,050	15,088.50	0.27
76	002841	视源股份	200	15,064.00	0.27
77	002797	第一创业	2,340	14,999.40	0.27
78	002673	西部证券	2,244	14,675.76	0.27
79	002602	世纪华通	2,962	14,276.84	0.26
80	002015	协鑫能科	800	14,192.00	0.26
81	002385	大北农	1,816	14,182.96	0.26
82	002625	光启技术	820	14,161.40	0.26
83	002223	鱼跃医疗	550	14,113.00	0.26
84	002326	永太科技	421	13,863.53	0.25
85	002608	江苏国信	2,100	13,650.00	0.25
86	002128	电投能源	953	13,646.96	0.25
87	002906	华阳集团	300	13,593.00	0.25
88	002557	洽洽食品	236	13,435.48	0.24
89	002399	海普瑞	741	13,026.78	0.24
90	002597	金禾实业	300	12,999.00	0.24
91	002791	坚朗五金	100	12,972.00	0.24
92	002299	圣农发展	670	12,850.60	0.23
93	002030	达安基因	747	12,840.93	0.23
94	002472	双环传动	400	12,736.00	0.23
95	002568	百润股份	420	12,616.80	0.23
96	002244	滨江集团	1,456	12,594.40	0.23
97	002487	大金重工	300	12,519.00	0.23
98	002408	齐翔腾达	1,542	12,505.62	0.23
99	002506	协鑫集成	3,300	12,276.00	0.22
100	002138	顺络电子	450	12,262.50	0.22
101	002044	美年健康	2,200	12,254.00	0.22
102	002203	海亮股份	1,049	12,115.95	0.22
103	002312	川发龙蟒	700	12,082.00	0.22
104	002422	科伦药业	646	12,080.20	0.22
105	002152	广电运通	1,297	12,023.19	0.22
106	002505	鹏都农牧	3,500	11,865.00	0.22
107	002926	华西证券	1,500	11,760.00	0.21
108	002245	蔚蓝锂芯	500	11,605.00	0.21
109	002465	海格通信	1,274	11,580.66	0.21
110	002500	山西证券	2,000	11,480.00	0.21
111	002153	石基信息	722	11,458.14	0.21
112	002444	巨星科技	606	11,417.04	0.21
113	002484	江海股份	478	11,156.52	0.20
114	002683	广东宏大	400	11,132.00	0.20
115	002409	雅克科技	200	11,102.00	0.20
116	002572	索菲亚	400	11,000.00	0.20
117	002705	新宝股份	500	10,995.00	0.20
118	002092	中泰化学	1,413	10,964.88	0.20

119	002028	思源电气	306	10,911.96	0.20
120	002156	通富微电	708	10,903.20	0.20
121	002456	欧菲光	1,600	10,736.00	0.20
122	002041	登海种业	505	10,650.45	0.19
123	002643	万润股份	500	10,430.00	0.19
124	002895	川恒股份	300	10,143.00	0.18
125	002461	珠江啤酒	1,196	10,142.08	0.18
126	002518	科士达	331	10,128.60	0.18
127	002065	东华软件	1,600	10,112.00	0.18
128	002558	巨人网络	1,100	10,065.00	0.18
129	002610	爱康科技	2,400	9,936.00	0.18
130	002010	传化智联	1,544	9,927.92	0.18
131	002291	星期六	500	9,880.00	0.18
132	002747	埃斯顿	400	9,800.00	0.18
133	002273	水晶光电	800	9,688.00	0.18
134	002865	钧达股份	100	9,536.00	0.17
134	002468	申通快递	800	9,536.00	0.17
136	002925	盈趣科技	440	9,468.80	0.17
137	002429	兆驰股份	2,455	9,427.20	0.17
138	002183	怡亚通	1,300	9,373.00	0.17
139	002064	华峰化学	1,110	9,368.40	0.17
140	002867	周大生	600	9,318.00	0.17
141	002761	浙江建投	300	9,261.00	0.17
142	002036	联创电子	600	9,216.00	0.17
143	002389	航天彩虹	500	9,180.00	0.17
144	002936	郑州银行	3,400	9,146.00	0.17
145	002585	双星新材	500	9,045.00	0.16
146	002145	中核钛白	1,260	8,983.80	0.16
147	002258	利尔化学	380	8,975.60	0.16
148	002958	青农商行	2,700	8,964.00	0.16
149	002091	江苏国泰	828	8,901.00	0.16
150	002373	千方科技	800	8,896.00	0.16
151	002831	裕同科技	300	8,865.00	0.16
152	002006	精功科技	298	8,859.54	0.16
153	002847	盐津铺子	100	8,794.00	0.16
154	002541	鸿路钢构	260	8,684.00	0.16
155	002250	联化科技	527	8,626.99	0.16
156	002436	兴森科技	764	8,610.28	0.16
157	002511	中顺洁柔	684	8,563.68	0.16
158	002266	浙富控股	1,769	8,473.51	0.15
159	002182	云海金属	336	8,426.88	0.15
160	002191	劲嘉股份	784	8,404.48	0.15
161	002110	三钢闽光	1,350	8,221.50	0.15
162	002617	露笑科技	721	8,168.93	0.15

163	002626	金达威	336	8,010.24	0.15
164	002318	久立特材	500	7,995.00	0.15
165	002439	启明星辰	400	7,972.00	0.14
166	002155	湖南黄金	653	7,927.42	0.14
167	002151	北斗星通	250	7,890.00	0.14
168	002157	正邦科技	1,300	7,878.00	0.14
169	002287	奇正藏药	305	7,853.75	0.14
170	002901	大博医疗	200	7,828.00	0.14
171	002498	汉缆股份	1,840	7,820.00	0.14
172	002335	科华数据	253	7,805.05	0.14
173	002221	东华能源	836	7,783.16	0.14
174	002100	天康生物	800	7,776.00	0.14
175	002670	国盛金控	800	7,680.00	0.14
176	002402	和而泰	400	7,624.00	0.14
177	002349	精华制药	500	7,545.00	0.14
178	002081	金螳螂	1,476	7,498.08	0.14
179	002701	奥瑞金	1,441	7,493.20	0.14
180	002544	普天科技	326	7,416.50	0.13
181	002139	拓邦股份	600	7,362.00	0.13
182	002242	九阳股份	400	7,344.00	0.13
183	002810	山东赫达	200	7,278.00	0.13
184	002396	星网锐捷	313	7,086.32	0.13
185	002079	苏州固锟	474	7,072.08	0.13
186	002928	华夏航空	600	7,062.00	0.13
187	002281	光迅科技	400	7,032.00	0.13
188	002019	亿帆医药	500	6,990.00	0.13
189	002195	二三四五	3,106	6,988.50	0.13
190	002158	汉钟精机	300	6,975.00	0.13
191	002061	浙江交科	1,000	6,960.00	0.13
192	002320	海峡股份	1,207	6,867.83	0.12
193	002545	东方铁塔	595	6,771.10	0.12
194	002262	恩华药业	493	6,704.80	0.12
195	002595	豪迈科技	300	6,702.00	0.12
196	002171	楚江新材	718	6,698.94	0.12
197	002011	盾安环境	544	6,685.76	0.12
198	003022	联泓新科	200	6,646.00	0.12
199	002201	正威新材	256	6,643.20	0.12
200	002146	荣盛发展	2,183	6,614.49	0.12
201	002706	良信股份	400	6,612.00	0.12
202	002645	华宏科技	300	6,546.00	0.12
203	002368	太极股份	340	6,531.40	0.12
204	002416	爱施德	700	6,510.00	0.12
205	002946	新乳业	500	6,495.00	0.12
206	002563	森马服饰	1,086	6,429.12	0.12

207	002293	罗莱生活	481	6,334.77	0.12
208	002002	鸿达兴业	1,700	6,307.00	0.11
209	002085	万丰奥威	1,172	6,293.64	0.11
210	002068	黑猫股份	448	6,249.60	0.11
211	002984	森麒麟	200	6,222.00	0.11
212	002131	利欧股份	3,200	6,208.00	0.11
213	002941	新疆交建	400	6,200.00	0.11
214	002216	三全食品	316	6,190.44	0.11
215	002948	青岛银行	1,700	6,154.00	0.11
216	002127	南极电商	1,150	6,141.00	0.11
217	002249	大洋电机	1,000	6,140.00	0.11
218	002839	张家港行	1,160	6,136.40	0.11
219	002088	鲁阳节能	290	6,104.50	0.11
220	002966	苏州银行	1,000	6,100.00	0.11
221	002212	天融信	600	6,090.00	0.11
222	002124	天邦食品	900	6,048.00	0.11
223	002099	海翔药业	868	6,015.24	0.11
224	002556	辉隆股份	513	6,002.10	0.11
225	002434	万里扬	700	5,985.00	0.11
226	002773	康弘药业	400	5,976.00	0.11
227	002726	龙大美食	560	5,969.60	0.11
228	002534	西子洁能	366	5,962.14	0.11
229	002985	北摩高科	100	5,858.00	0.11
230	002324	普利特	400	5,792.00	0.11
231	002607	中公教育	1,000	5,790.00	0.11
232	002048	宁波华翔	359	5,751.18	0.10
233	002060	粤水电	658	5,718.02	0.10
234	002053	云南能投	446	5,717.72	0.10
235	003035	南网能源	900	5,715.00	0.10
236	002004	华邦健康	1,023	5,708.34	0.10
237	002163	海南发展	400	5,708.00	0.10
238	002302	西部建设	732	5,680.32	0.10
239	002537	海联金汇	694	5,676.92	0.10
240	002075	沙钢股份	1,180	5,675.80	0.10
241	002539	云图控股	352	5,628.48	0.10
242	002233	塔牌集团	632	5,593.20	0.10
243	002538	司尔特	500	5,580.00	0.10
244	002390	信邦制药	800	5,528.00	0.10
245	002859	洁美科技	200	5,504.00	0.10
246	002646	天佑德酒	287	5,496.05	0.10
247	002239	奥特佳	1,800	5,490.00	0.10
248	002317	众生药业	378	5,484.78	0.10
249	002135	东南网架	571	5,464.47	0.10
250	002382	蓝帆医疗	572	5,462.60	0.10

251	002190	成飞集成	200	5,440.00	0.10
252	002759	天际股份	200	5,436.00	0.10
252	002807	江阴银行	1,200	5,436.00	0.10
254	002549	凯美特气	300	5,430.00	0.10
255	002690	美亚光电	250	5,420.00	0.10
256	002675	东诚药业	401	5,413.50	0.10
257	002051	中工国际	610	5,331.40	0.10
258	002698	博实股份	450	5,323.50	0.10
259	002332	仙琚制药	542	5,322.44	0.10
260	002217	合力泰	1,700	5,321.00	0.10
261	002851	麦格米特	200	5,252.00	0.10
262	002237	恒邦股份	535	5,243.00	0.10
263	002411	*ST 必康	800	5,240.00	0.10
264	002567	唐人神	615	5,233.65	0.10
265	002782	可立克	300	5,112.00	0.09
265	002125	湘潭电化	300	5,112.00	0.09
267	002481	双塔食品	600	5,094.00	0.09
268	002832	比音勒芬	200	5,040.00	0.09
269	002517	恺英网络	900	5,022.00	0.09
270	002837	英维克	200	4,948.00	0.09
271	002174	游族网络	500	4,885.00	0.09
271	002745	木林森	500	4,885.00	0.09
273	002274	华昌化工	500	4,870.00	0.09
274	002653	海思科	300	4,833.00	0.09
275	002204	大连重工	1,094	4,780.78	0.09
276	002218	拓日新能	808	4,759.12	0.09
277	002755	奥赛康	500	4,740.00	0.09
278	002038	双鹭药业	484	4,699.64	0.09
279	002423	中粮资本	700	4,697.00	0.09
280	002108	沧州明珠	755	4,696.10	0.09
281	002737	葵花药业	300	4,692.00	0.09
282	002003	伟星股份	488	4,636.00	0.08
283	002057	中钢天源	400	4,620.00	0.08
284	002424	贵州百灵	600	4,614.00	0.08
285	002727	一心堂	200	4,586.00	0.08
286	002532	天山铝业	700	4,571.00	0.08
287	002121	科陆电子	700	4,557.00	0.08
288	002276	万马股份	581	4,543.42	0.08
289	002419	天虹股份	637	4,541.81	0.08
290	002911	佛燃能源	500	4,540.00	0.08
291	002226	江南化工	809	4,538.49	0.08
292	002063	远光软件	643	4,520.29	0.08
293	002678	珠江钢琴	777	4,514.37	0.08
294	002378	章源钨业	558	4,508.64	0.08

295	002323	雅博股份	1,200	4,476.00	0.08
296	002665	首航高科	1,408	4,392.96	0.08
297	002386	天原股份	397	4,374.94	0.08
298	002440	闰土股份	539	4,344.34	0.08
299	002428	云南锗业	334	4,315.28	0.08
300	002267	陕天然气	608	4,249.92	0.08
301	002453	华软科技	300	4,239.00	0.08
302	002034	旺能环境	200	4,106.00	0.07
303	002930	宏川智慧	200	3,954.00	0.07
304	002400	省广集团	800	3,944.00	0.07
305	002489	浙江永强	1,051	3,825.64	0.07
306	002433	太安堂	787	3,659.55	0.07
307	002913	奥士康	100	3,165.00	0.06
308	002960	青鸟消防	100	2,739.00	0.05
309	002118	紫鑫药业	754	2,179.06	0.04
310	002605	姚记科技	93	1,548.45	0.03
311	002912	中新赛克	60	1,479.60	0.03
312	002612	朗姿股份	42	1,187.76	0.02
313	002101	广东鸿图	50	1,140.00	0.02
314	002667	鞍重股份	56	1,092.56	0.02
315	002362	汉王科技	72	995.04	0.02
316	002674	兴业科技	81	991.44	0.02
317	002254	泰和新材	56	938.00	0.02
318	002140	东华科技	92	931.96	0.02
319	002096	南岭民爆	69	828.69	0.02
320	002208	合肥城建	92	824.32	0.01
321	002635	安洁科技	50	818.50	0.01
322	002184	海得控制	67	816.73	0.01
323	002123	梦网科技	70	814.80	0.01
324	002590	万安科技	86	794.64	0.01
325	002580	圣阳股份	85	714.85	0.01
326	002376	新北洋	92	711.16	0.01
327	002117	东港股份	96	701.76	0.01
328	002584	西陇科学	85	677.45	0.01
329	002777	久远银海	46	661.48	0.01
330	002393	力生制药	31	657.82	0.01
331	002300	太阳电缆	90	652.50	0.01
332	002327	富安娜	82	651.90	0.01
333	002331	皖通科技	88	639.76	0.01
334	002275	桂林三金	49	638.47	0.01
335	002322	理工能科	71	635.45	0.01
336	002283	天润工业	90	614.70	0.01
337	002636	金安国纪	68	614.04	0.01
338	002037	保利联合	63	601.02	0.01

339	002186	全聚德	62	593.96	0.01
340	002488	金固股份	87	585.51	0.01
341	002298	中电兴发	88	577.28	0.01
342	002261	拓维信息	90	576.90	0.01
343	002170	芭田股份	89	570.49	0.01
344	002295	精艺股份	85	565.25	0.01
345	002111	威海广泰	60	562.80	0.01
346	002588	史丹利	80	548.00	0.01
347	002301	齐心集团	83	547.80	0.01
348	002045	国光电器	62	530.10	0.01
349	002578	闽发铝业	94	527.34	0.01
350	002097	山河智能	76	516.04	0.01
351	002649	博彦科技	50	510.50	0.01
352	002474	榕基软件	85	502.35	0.01
353	002522	浙江众成	88	499.84	0.01
354	002347	泰尔股份	96	497.28	0.01
355	002533	金杯电工	69	489.21	0.01
356	002455	百川股份	40	485.20	0.01
357	002104	恒宝股份	59	480.26	0.01
358	002307	北新路桥	80	476.00	0.01
359	002106	莱宝高科	58	474.44	0.01
360	002627	三峡旅游	75	473.25	0.01
361	002012	凯恩股份	88	469.04	0.01
362	002458	益生股份	50	468.50	0.01
363	002574	明牌珠宝	96	467.52	0.01
364	002029	七匹狼	86	462.68	0.01
365	002187	广百股份	55	461.45	0.01
366	002746	仙坛股份	50	457.50	0.01
367	002343	慈文传媒	80	453.60	0.01
368	002395	双象股份	50	445.50	0.01
369	002413	雷科防务	80	444.00	0.01
370	002344	海宁皮城	93	434.31	0.01
371	002016	世荣兆业	66	422.40	0.01
372	002676	顺威股份	98	412.58	0.01
373	002647	仁东控股	61	409.92	0.01
374	002277	友阿股份	86	399.04	0.01
375	002115	三维通信	95	394.25	0.01
376	002073	软控股份	55	389.40	0.01
377	002083	孚日股份	82	387.04	0.01
378	002565	顺灏股份	78	380.64	0.01
379	002581	未名医药	22	379.28	0.01
380	002476	宝莫股份	59	378.78	0.01
381	002641	公元股份	78	375.96	0.01
382	002548	金新农	55	368.50	0.01

383	002062	宏润建设	53	367.82	0.01
384	002047	宝鹰股份	92	367.08	0.01
385	002339	积成电子	65	361.40	0.01
386	002365	永安药业	29	357.28	0.01
387	002559	亚威股份	48	352.80	0.01
388	002014	永新股份	52	347.88	0.01
389	002035	华帝股份	59	343.38	0.01
390	002314	南山控股	82	339.48	0.01
391	002614	奥佳华	39	337.74	0.01
392	002042	华孚时尚	85	321.30	0.01
393	002621	美吉姆	80	314.40	0.01
394	002367	康力电梯	42	313.74	0.01
395	002462	嘉事堂	23	310.27	0.01
396	002165	红宝丽	66	308.88	0.01
397	002528	英飞拓	78	307.32	0.01
398	002492	恒基达鑫	52	304.72	0.01
399	002093	国脉科技	53	302.63	0.01
400	002369	卓翼科技	67	299.49	0.01
401	002181	粤传媒	67	293.46	0.01
402	002630	华西能源	90	286.20	0.01
403	002694	顾地科技	60	272.40	0.00
404	002087	新野纺织	82	272.24	0.00
405	002167	东方锆业	37	270.84	0.00
406	002375	亚厦股份	53	265.53	0.00
407	002628	成都路桥	68	258.40	0.00
408	002696	百洋股份	44	258.28	0.00
409	002479	富春环保	55	257.40	0.00
410	002483	润邦股份	39	251.94	0.00
411	002491	通鼎互联	48	250.08	0.00
412	002054	德美化工	31	249.24	0.00
413	002141	贤丰控股	46	248.40	0.00
414	002587	奥拓电子	50	235.00	0.00
415	002620	瑞和股份	40	234.00	0.00
416	002682	龙洲股份	50	233.50	0.00
417	002228	合兴包装	64	231.68	0.00
418	002377	国创高新	66	219.12	0.00
419	002404	嘉欣丝绸	38	218.50	0.00
420	002398	垒知集团	34	218.28	0.00
421	002308	威创股份	56	215.60	0.00
422	002520	日发精机	34	207.40	0.00
423	002540	亚太科技	30	201.60	0.00
424	002148	北纬科技	40	196.40	0.00
425	002494	华斯股份	46	194.12	0.00
426	002406	远东传动	36	187.92	0.00

427	002154	报喜鸟	43	185.76	0.00
428	002550	千红制药	32	183.36	0.00
429	002521	齐峰新材	34	182.58	0.00
430	002689	远大智能	36	181.08	0.00
431	002303	美盈森	52	179.40	0.00
432	002622	融钰集团	54	172.80	0.00
433	002441	众业达	18	169.56	0.00
434	002495	佳隆股份	60	164.40	0.00
435	002593	日上集团	46	160.54	0.00
436	002345	潮宏基	34	156.06	0.00
437	002523	天桥起重	56	155.12	0.00
438	002020	京新药业	17	154.70	0.00
439	002695	煌上煌	12	148.44	0.00
440	002449	国星光电	18	145.62	0.00
441	002310	东方园林	60	144.60	0.00
442	002546	新联电子	37	138.75	0.00
443	002451	摩恩电气	15	115.65	0.00
444	002031	巨轮智能	34	111.86	0.00
445	002596	海南瑞泽	32	109.12	0.00
446	002662	京威股份	30	108.90	0.00
447	002023	海特高新	10	102.30	0.00
448	002685	华东重机	28	101.64	0.00
449	002232	启明信息	7	98.70	0.00
450	002435	长江健康	20	97.80	0.00
451	002589	瑞康医药	25	97.25	0.00
452	002374	中锐股份	20	82.20	0.00
453	002564	天沃科技	18	79.20	0.00
454	002325	洪涛股份	33	78.87	0.00
455	002107	沃华医药	11	68.31	0.00
456	002392	北京利尔	18	67.32	0.00
457	002394	联发股份	8	58.48	0.00
458	002292	奥飞娱乐	12	56.28	0.00
459	002328	新朋股份	9	52.83	0.00
460	002519	银河电子	10	44.60	0.00
461	002543	万和电气	6	42.12	0.00
462	002285	世联行	11	35.86	0.00
463	002503	搜于特	26	35.10	0.00
464	002251	步步高	5	34.65	0.00
465	002482	ST广田	15	34.35	0.00
466	002305	南国置业	12	32.04	0.00
467	002206	海利得	5	31.60	0.00
468	002431	棕榈股份	7	23.31	0.00
469	002554	惠博普	6	20.28	0.00
470	002360	同德化工	1	8.12	0.00

471	002238	天威视讯	1	5.72	0.00
-----	--------	------	---	------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	104,295.00	1.63
2	002352	顺丰控股	104,016.00	1.63
3	002475	立讯精密	98,716.00	1.54
4	002466	天齐锂业	97,803.00	1.53
5	002812	恩捷股份	92,101.00	1.44
6	002142	宁波银行	85,950.00	1.34
7	002714	牧原股份	66,417.00	1.04
8	002460	赣锋锂业	63,735.00	1.00
9	002027	分众传媒	53,088.00	0.83
10	002493	荣盛石化	50,624.00	0.79
11	002920	德赛西威	42,352.00	0.66
12	002241	歌尔股份	38,010.00	0.59
13	002709	天赐材料	35,600.00	0.56
14	002074	国轩高科	31,465.00	0.49
15	002129	TCL 中环	31,185.00	0.49
16	002192	融捷股份	30,058.00	0.47
17	002938	鹏鼎控股	28,801.00	0.45
18	002736	国信证券	28,214.00	0.44
19	002756	永兴材料	26,731.00	0.42
20	002120	韵达股份	18,872.00	0.30

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002049	紫光国微	93,207.00	1.46
2	002371	北方华创	52,970.00	0.83
3	002594	比亚迪	32,455.00	0.51
4	002557	洽洽食品	28,507.00	0.45
5	002025	航天电器	27,204.00	0.43
6	002821	凯莱英	26,588.00	0.42
7	002432	九安医疗	26,120.00	0.41
8	002459	晶澳科技	19,098.00	0.30

9	002353	杰瑞股份	17,988.00	0.28
10	002028	思源电气	17,640.00	0.28
11	002240	盛新锂能	17,583.00	0.27
12	002179	中航光电	17,217.00	0.27
13	002541	鸿路钢构	17,162.00	0.27
14	002304	洋河股份	17,086.00	0.27
15	002415	海康威视	15,942.00	0.25
16	002597	金禾实业	15,701.00	0.25
17	002407	多氟多	15,617.00	0.24
18	002192	融捷股份	14,778.00	0.23
19	002568	百润股份	14,432.00	0.23
20	002258	利尔化学	14,326.00	0.22

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,003,419.00
卖出股票的收入（成交）总额	2,154,928.43

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.11.2 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，因违规为存款人多头开立银行结算账户、超过期限或未向中国人民银行报送账户开立、变更、撤销等资料等违法违规行为，于 2021 年 7 月 13 日被中国人民银行宁波市中心支行给予警告，并处罚款 286.2 万元。因信贷资金违规流入房地产领域、违规向土地储备项目提供融资、非标投资业务资金支用审核不到位、房地产贷款授信管理不到位，于 2022 年 4 月 11 日被宁波银保监局处以罚款 220 万元。因薪酬管理不到位、关联交易管理不规范、绿色信贷政策执行不到位、授信管理不审慎、资金用途管控不严、贷款风险分类不准确、票据业务管控不严、非现场统计数据差错，于 2022 年 4 月 21 日被宁波银保监局处以罚款 270 万元。因非标投资业务管理不审慎、理财业务管理不规范、主承销债券管控不到位、违规办理衍生产品交易业务、信用证议付资金用于购买本行理财、违规办理委托贷款业务、非银融资业务开展不规范、内控管理不到位、数据治理存在欠缺，于 2022 年 5 月 27 日被宁波银保监局处以罚款 290 万元。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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	50.99
2	应收清算款	40,728.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	2,996.40
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,776.02

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
594	9,036.13	0.00	0.00%	5,367,463.20	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例

1	郑淑女	932,651.00	17.38%
2	李锦山	543,778.00	10.13%
3	朱洪宏	348,595.00	6.49%
4	许海燕	188,278.00	3.51%
5	陈春宁	188,269.00	3.51%
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	黎秀香	76,143.74	1.42%
10	李春笋	75,565.28	1.41%

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。

8.3 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。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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。

9 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	5,379,887.77
本报告期基金总申购份额	760,374.66
减：本报告期基金总赎回份额	772,799.23
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,367,463.20

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）”，自 2021 年 4 月 6 日起，原“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)”；

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。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	4,158,347.43	100.00%	3,830.43	100.00%	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
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务。

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

报告期内本基金租用证券公司的交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
安信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
第一创业证券 股份有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)2021 年第 4 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2022-01-24
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2022-01-24
3	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股份有限公司相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2022-01-25
4	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参与第一创业证券相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2022-02-10
5	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中植基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2022-03-08
6	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)2021 年年度报告	规定网站、深圳证券交易所	2022-03-31
7	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年年度报告提示性公告	规定报刊	2022-03-31
8	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)2022 年 1 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2022-04-22
9	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2022-04-22
10	国联安基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯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	2022-04-28
11	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(2022 年第 1 号)	规定网站、深圳证券交易所	2022-05-18
12	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2022-05-18
13	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财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	2022-06-10

11 备查文件目录

11.1 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

11.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

11.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二二年八月三十一日