

# 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

**2023 年中期报告**

**2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

## 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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 3 月 6 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	14
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	14
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	18
<b>7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51
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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>53</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	54
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.....	54
<b>9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>54</b>
<b>10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	55
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	57
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
<b>12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联安 ESG300ETF
场内简称	ESG300ETF
基金主代码	159653
交易代码	159653
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 6 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	61,972,068.00 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股或增发；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。</p> <p>对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。为此，本基金将以市场利率趋势研判为主，基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风险可控的前提下，灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略、骑乘策略和利差套利策略等对高流动性、低风险的债券品种进行主动投资。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p>

	<p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和量的全方面分析，评估其相对投资价值后作出相应的投资决策。</p> <p>4、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券，根据基金资产组合情况可适度进行投资。</p> <p>5、金融衍生品投资策略</p> <p>为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。</p> <p>本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本，追求对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>6、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p> <p>参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。</p> <p>参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p>
业绩比较基准	国证 ESG300 指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	上海银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	周直毅
	联系电话	021-38992888	021-68475608
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	custody@bosce.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95594
传真		021-50151582	021-68476901
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路168号27层
邮政编码		200121	200120
法定代表人		于业明	金煜

## 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
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（2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	104,030.81
本期利润	-452,266.73
加权平均基金份额本期利润	-0.0054
本期加权平均净值利润率	-0.55%
本期基金份额净值增长率	-4.16%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-2,578,277.05
期末可供分配基金份额利润	-0.0416
期末基金资产净值	59,393,790.95
期末基金份额净值	0.9584
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-4.16%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

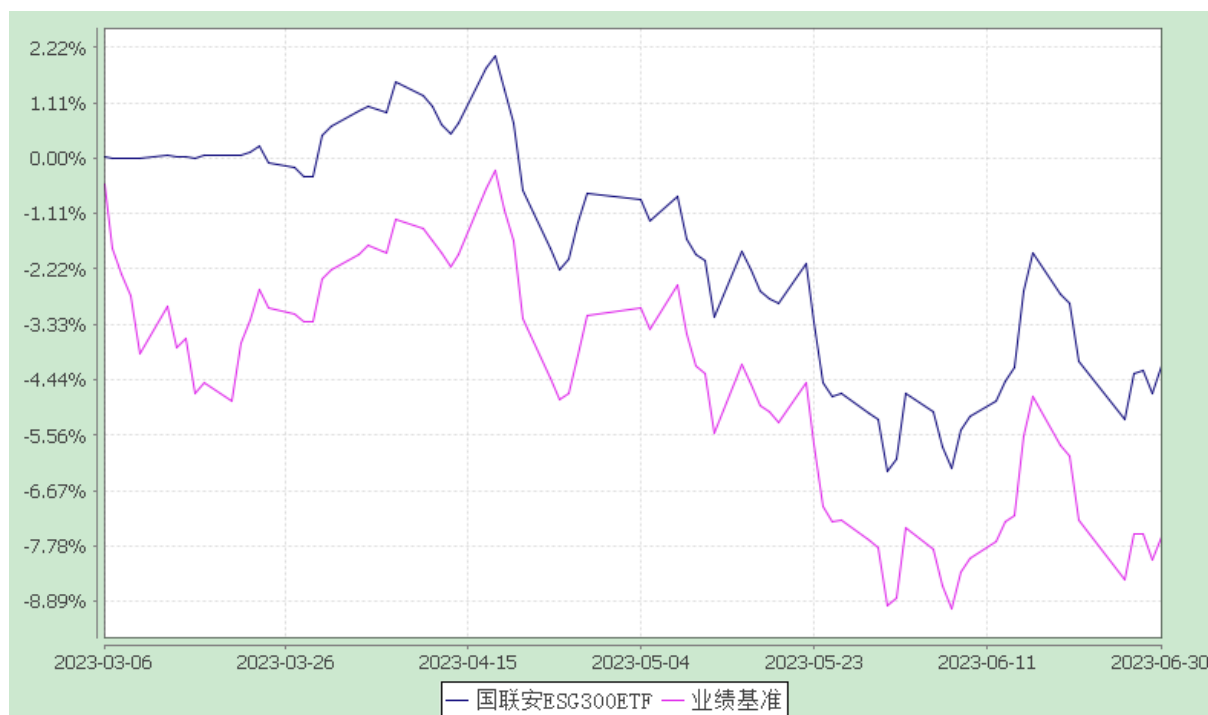
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.27%	0.80%	1.53%	0.87%	0.74%	-0.07%
过去三个月	-4.78%	0.71%	-5.48%	0.79%	0.70%	-0.08%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-4.16%	0.62%	-7.59%	0.77%	3.43%	-0.15%

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

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金  
 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  
 (2023 年 3 月 6 日至 2023 年 6 月 30 日)



- 注：1、本基金业绩比较基准为国证 ESG300 指数收益率；
- 2、本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；
- 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期；
- 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		
章堪元	本基金基金经理、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、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券	2023-03-06	-	15 年（自 2008 年起）	章堪元先生，硕士研究生。曾任建信基金管理有限公司任研究员，富国基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，融通基金管理有限公司专户投资经理、基金经理、指数与量化投资部总经理。2019 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，担任量化投资部总经理。2020 年 5 月起担任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 8 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、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、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；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

	<p>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、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安中证 1000 指数增强型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、国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、量化投资部总经理。</p>				<p>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；2021 年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 11 月起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；2022 年 12 月起兼任国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
黄欣	<p>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</p>	2023-03-06	-	21 年（自 2002 年起）	<p>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、债券投资助理、基金经理助理、基金经理、量化投资部总监助理等职。</p>

	<p>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</p>			<p>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 年 8 月起兼任国联安中证医药 100 指数证券投资基金的基金经理; 2016 年 8 月至 2023 年 1 月兼任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</p>
--	--	--	--	--

	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、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、国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。				放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	--	--

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》、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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

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，及时执行交易系统内的公平交易模块；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

年初，A 股市场出现了一波上扬，但根据此后的宏观数据来看，人民币兑美元汇率跌破 7，国内制造业 PMI 跌至 48.8%，再度不及预期，在之前的低基数基础上进一步小幅下滑。经济复苏不及预期加上人民币贬值，A 股市场在宏观经济数据不理想的影响之下也出现了一波下调，包括外资在内的一些资金出现流出的迹象。

2023 年上半年，A 股市场整体震荡下行。依据基金合同的约定，本基金始终保持较合理的仓位，采用完全复制的方法跟踪 ESG300 指数，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 0.9584 元，本报告期份额净值增长率为-4.16%，同期业绩比较基准收益率为-7.59%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

俄乌冲突仍在胶着之中，后续全球政治经济局势依旧存在较大的不确定性，短期内投资依然需要注重风险控制。

### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值委员会，对估值业务总体负责。估值委员会由公司营运总监/副总监(主席/副主席)、运营部、权益投资部、现金管理部、固定收益部、专户投资部、交易部、量化投资部、研究部、监察稽核部和风险管理部部门负责人组成，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

决策由估值委员会成员 1/2 以上多数票通过，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

2023 年 4 月 10 日至 2023 年 6 月 29 日，本基金资产净值低于 5000 万。已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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

### 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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，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，本基金的利润分配情况符合有关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的真实、准确和完整发表意见

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，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：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	2,858,988.67
结算备付金		208,388.12
存出保证金		172,076.07
交易性金融资产	6.4.7.2	51,059,901.35
其中：股票投资		51,059,901.35
基金投资		-
债券投资		-
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		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	21,823,921.98
资产总计		76,123,276.19
<b>负债和净资产</b>		<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>
<b>负 债：</b>		
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		16,524,077.63
应付赎回款		-
应付管理人报酬		17,789.63
应付托管费		2,134.76
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	185,483.22
负债合计		16,729,485.24
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	61,972,068.00
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-2,578,277.05
净资产合计		59,393,790.95
负债和净资产总计		76,123,276.19

注：1、报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9584 元，基金份额总额 61,972,068.00 份。

2、本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度末财务数据。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-253,431.48</b>
1.利息收入		132,592.29
其中：存款利息收入	6.4.7.9	98,964.83
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		33,627.46
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		-309,080.40
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-788,847.44
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
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	479,767.04
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	-556,297.54
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	479,354.17
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>198,835.25</b>
1. 管理人报酬		<b>121,625.50</b>
2. 托管费		14,595.06
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	62,614.69
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		<b>-452,266.73</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		<b>-452,266.73</b>
五、其他综合收益的税后净额		-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-452,266.73</b>

注：本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度可比期间数据。

### 6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合	未分配利润	净资产合计

		收益（若有）		
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
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）	232,972,068.00	-	-	232,972,068.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-171,000,000.00	-	-2,578,277.05	173,578,277.05
（一）、综合收益总额	-	-	-452,266.73	-452,266.73
（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）	-171,000,000.00	-	-2,126,010.32	173,126,010.32
其中：1.基金申购款	93,000,000.00	-	-3,349,981.90	89,650,018.10
2.基金赎回款	-264,000,000.00	-	1,223,971.58	262,776,028.42
（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）	61,972,068.00	-	-2,578,277.05	59,393,790.95

注：本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度可比期间数据。

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

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]1537 号《关于准予国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金证券投资基金注册的批复》注册,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《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 232,963,552.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 0146 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 3 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 232,972,068.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 8,516.00 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,基金托管人为上海银行股份有限公司(以下简称“上海银行”)。

根据《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定,基金合同生效后,本基金可以进行份额折算。基金管理人应事先确定基金份额折算日,并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告,并提前通知基金托管人。基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标,本基金还可投资于非成份股(包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务以及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

本基金的业绩比较基准为:国证 ESG300 指数收益率。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]209 号文审核同意,本基金 232,972,068.00 份基金份额于 2023 年 3 月 24 日在深交所挂牌交易。

## 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

### 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

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和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (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。

### 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

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发

生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够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。

#### 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基金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基金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

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(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券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投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及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。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 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

本报告期内本基金无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。



## 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	2,858,988.67
等于：本金	2,858,273.96
加：应计利息	714.71
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	2,858,988.67

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	51,616,198.89	-	51,059,901.35	-556,297.54
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	51,616,198.89	-	51,059,901.35	-556,297.54

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产/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

本报告期末本基金无买入返售金融资产。

##### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
ETF 申赎证券清算款	21,823,921.98
合计	21,823,921.98

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	123,289.53
其中：交易所市场	123,289.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	23,322.78
预提信息披露费	38,870.91
合计	185,483.22

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	232,972,068.00	232,972,068.00
本期申购	93,000,000.00	93,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-264,000,000.00	-264,000,000.00
本期末	61,972,068.00	61,972,068.00

#### 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
本期利润	104,030.81	-556,297.54	-452,266.73
本期基金份额交易产生的变动数	-102,052.45	-2,023,957.87	-2,126,010.32
其中：基金申购款	489,498.96	-3,839,480.86	-3,349,981.90
基金赎回款	-591,551.41	1,815,522.99	1,223,971.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,978.36	-2,580,255.41	-2,578,277.05

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	93,291.97
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	5,060.34
其他	612.52
合计	98,964.83

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,356,734.98
股票投资收益——赎回差价收入	567,887.54
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-788,847.44

**6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出股票成交总额	162,127,043.16
减：卖出股票成本总额	162,882,111.08
减：交易费用	601,667.06
买卖股票差价收入	-1,356,734.98

**6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	262,776,028.42
减：现金支付赎回款总额	171,674,372.42
减：赎回股票成本总额	90,533,768.46
减：交易费用	-
赎回差价收入	567,887.54

**6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入**

本报告期内本基金无股票申购差价收入。

**6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入**

本报告期内本基金无证券出借差价收入。

**6.4.7.11 债券投资收益**

本报告期内本基金无债券投资收益。

**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
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	479,767.04
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	479,767.04

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-556,297.54
——股票投资	-556,297.54
——债券投资	-
——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	-556,297.54

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	479,352.17
其他	2.00
合计	479,354.17

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	23,322.78
信息披露费	38,870.91
证券出借违约金	-
银行汇划费用	21.00
其他费用	400.00
合计	62,614.69

注：此处列示的“其他费用”是指证券账户开户费。

#### 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
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
国联安基金管理有限公司	基金管理人
上海银行股份有限公司(“上海银行”)	基金托管人

##### 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。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，无上年度可比期间数据。

##### 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

本报告期内本基金无支付关联方的佣金。

### 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
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	121,625.50
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，无上年度可比期间数据（下同）。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	14,595.06

注：支付基金托管人上海银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.06% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.06% / 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

本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度可比期间数据。

### 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

本报告期内本基金未与关联方进行转融通出借业务。本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度可比期间数据。

### 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自有资金投资本基金的情况

本报告期内，基金管理人未运用自有资金投资本基金。本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 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

本报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，



无上年末数据。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
上海银行	2,858,988.67	93,291.97

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“上海银行股份有限公司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 2023 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 208,388.12 元。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无其他关联交易事项。本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度可比期间数据。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

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

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。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，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，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，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 0.00 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。

#### 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 2023 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%。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，无上年度末数据。

### 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%。本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 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%。

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 2023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	2,858,988.67	-	-	-	-	-	2,858,988.67
结算备付金	208,388.12	-	-	-	-	-	208,388.12

存出保证金	172,076.07	-	-	-	-	-	172,076.07
交易性金融资产	-	-	-	-	-	51,059,901.35	51,059,901.35
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	21,823,921.98	21,823,921.98
资产总计	3,239,452.86	-	-	-	-	72,883,823.33	76,123,276.19
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	16,524,077.63	16,524,077.63
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	17,789.63	17,789.63
应付托管费	-	-	-	-	-	2,134.76	2,134.76
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	185,483.22	185,483.22
负债总计	-	-	-	-	-	16,729,485.24	16,729,485.24
利率敏感度缺口	3,239,452.86	-	-	-	-	56,154,338.09	59,393,790.95

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。本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，无上年度末数据。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 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%，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。本基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，无上年度末数据。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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的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 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	51,059,901.35	85.97
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	51,059,901.35	85.97

#### 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 2023 年 6 月 30 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 2,164,414.83
	业绩比较基准下降 5%	减少 2,164,414.83

注：本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，无上年度末数据。

### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	51,059,901.35
第二层次	-
第三层次	-
合计	51,059,901.35

##### 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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，无上年度末数据。

##### 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

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	51,059,901.35	67.08
	其中：股票	51,059,901.35	67.08
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	3,067,376.79	4.03
8	其他各项资产	21,995,998.05	28.90
9	合计	76,123,276.19	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	44,045.00	0.07
B	采矿业	2,433,119.00	4.10
C	制造业	29,993,660.20	50.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,629,667.00	2.74
E	建筑业	989,681.00	1.67



F	批发和零售业	394,691.80	0.66
G	交通运输、仓储和邮政业	1,306,197.00	2.20
H	住宿和餐饮业	76,212.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,390,087.35	2.34
J	金融业	9,316,113.00	15.69
K	房地产业	989,568.00	1.67
L	租赁和商务服务业	683,561.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	953,721.00	1.61
N	水利、环境和公共设施管理业	140,046.00	0.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	564,808.00	0.95
R	文化、体育和娱乐业	78,683.00	0.13
S	综合	76,041.00	0.13
	合计	51,059,901.35	85.97

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,200	3,720,200.00	6.26
2	300750	宁德时代	9,900	2,265,021.00	3.81
3	601318	中国平安	38,500	1,786,400.00	3.01
4	600036	招商银行	48,400	1,585,584.00	2.67
5	000858	五粮液	7,400	1,210,418.00	2.04
6	000333	美的集团	19,400	1,143,048.00	1.92
7	601166	兴业银行	65,000	1,017,250.00	1.71

8	600900	长江电力	39,200	864,752.00	1.46
9	600276	恒瑞医药	15,900	761,610.00	1.28
10	601012	隆基绿能	24,700	708,149.00	1.19
11	601899	紫金矿业	59,700	678,789.00	1.14
12	601398	工商银行	140,200	675,764.00	1.14
13	600887	伊利股份	23,600	668,352.00	1.13
14	002475	立讯精密	18,000	584,100.00	0.98
15	300760	迈瑞医疗	1,900	569,620.00	0.96
16	000063	中兴通讯	12,300	560,142.00	0.94
17	601328	交通银行	94,800	549,840.00	0.93
18	000725	京东方 A	127,000	519,430.00	0.87
19	002415	海康威视	15,200	503,272.00	0.85
20	603259	药明康德	7,900	492,249.00	0.83
21	300124	汇川技术	7,600	487,996.00	0.82
22	300274	阳光电源	4,000	466,520.00	0.79
23	601288	农业银行	127,400	449,722.00	0.76
24	002352	顺丰控股	9,400	423,846.00	0.71
25	601888	中国中免	3,800	420,014.00	0.71
26	601668	中国建筑	73,100	419,594.00	0.71
27	600031	三一重工	23,500	390,805.00	0.66
28	000001	平安银行	34,300	385,189.00	0.65
29	002129	TCL 中环	11,600	385,120.00	0.65
30	600028	中国石化	60,000	381,600.00	0.64
31	688981	中芯国际	7,550	381,426.00	0.64
32	600690	海尔智家	15,200	356,896.00	0.60
33	600438	通威股份	10,300	353,393.00	0.59
34	601138	工业富联	14,000	352,800.00	0.59
35	600048	保利发展	26,900	350,507.00	0.59
36	000002	万科 A	24,600	344,892.00	0.58
37	601088	中国神华	11,200	344,400.00	0.58
38	601857	中国石油	45,600	340,632.00	0.57
39	601988	中国银行	84,700	331,177.00	0.56
40	600406	国电南瑞	13,940	322,014.00	0.54
41	601601	中国太保	12,100	314,358.00	0.53
42	002304	洋河股份	2,300	302,105.00	0.51
43	600837	海通证券	32,700	301,494.00	0.51
44	300015	爱尔眼科	16,120	299,026.00	0.50
45	601688	华泰证券	21,500	296,055.00	0.50
46	600089	特变电工	13,187	293,938.23	0.49
47	600000	浦发银行	39,200	283,808.00	0.48
48	688111	金山办公	600	283,332.00	0.48
49	601390	中国中铁	36,700	278,186.00	0.47
50	603288	海天味业	5,820	272,667.00	0.46
51	000568	泸州老窖	1,300	272,441.00	0.46

52	600570	恒生电子	6,100	270,169.00	0.45
53	002027	分众传媒	38,700	263,547.00	0.44
54	002460	赣锋锂业	4,300	262,128.00	0.44
55	000338	潍柴动力	20,600	256,676.00	0.43
56	002371	北方华创	800	254,120.00	0.43
57	601225	陕西煤业	13,900	252,841.00	0.43
58	601211	国泰君安	17,500	244,825.00	0.41
59	600893	航发动力	5,500	232,430.00	0.39
60	600309	万华化学	2,600	228,384.00	0.38
61	600111	北方稀土	9,500	227,810.00	0.38
62	002050	三花智控	7,500	226,950.00	0.38
63	601985	中国核电	31,300	220,665.00	0.37
64	600104	上汽集团	15,200	215,384.00	0.36
65	002821	凯莱英	1,800	212,148.00	0.36
66	601658	邮储银行	42,700	208,803.00	0.35
67	601818	光大银行	67,800	208,146.00	0.35
68	600660	福耀玻璃	5,800	207,930.00	0.35
69	002271	东方雨虹	7,600	207,176.00	0.35
70	002555	三七互娱	5,900	205,792.00	0.35
71	601919	中远海控	21,800	204,920.00	0.35
72	600585	海螺水泥	8,400	199,416.00	0.34
73	002179	中航光电	4,260	193,191.00	0.33
74	300122	智飞生物	4,350	192,270.00	0.32
75	688599	天合光能	4,414	188,080.54	0.32
76	600019	宝钢股份	33,200	186,584.00	0.31
77	601186	中国铁建	18,900	186,165.00	0.31
78	002709	天赐材料	4,400	181,236.00	0.31
79	600426	华鲁恒升	5,900	180,717.00	0.30
80	600763	通策医疗	1,800	174,348.00	0.29
81	601939	建设银行	27,600	172,776.00	0.29
82	600436	片仔癀	600	171,816.00	0.29
83	000977	浪潮信息	3,500	169,750.00	0.29
84	601006	大秦铁路	22,700	168,661.00	0.28
85	300142	沃森生物	6,300	166,635.00	0.28
86	600011	华能国际	17,900	165,754.00	0.28
87	300316	晶盛机电	2,300	163,070.00	0.27
88	000166	申万宏源	35,100	162,162.00	0.27
89	603993	洛阳钼业	28,900	154,037.00	0.26
90	600547	山东黄金	6,400	150,272.00	0.25
91	001979	招商蛇口	11,300	147,239.00	0.25
92	600085	同仁堂	2,500	143,900.00	0.24
93	603659	璞泰来	3,690	141,031.80	0.24
94	002493	荣盛石化	12,000	139,680.00	0.24
95	300347	泰格医药	2,100	135,534.00	0.23

96	600176	中国巨石	9,500	134,520.00	0.23
97	300896	爱美客	300	133,485.00	0.22
98	002340	格林美	19,200	132,672.00	0.22
99	000425	徐工机械	19,400	131,338.00	0.22
100	000538	云南白药	2,500	131,200.00	0.22
101	000596	古井贡酒	500	123,690.00	0.21
102	601615	明阳智能	7,200	121,536.00	0.20
103	603501	韦尔股份	1,200	117,648.00	0.20
104	688036	传音控股	800	117,600.00	0.20
105	600989	宝丰能源	9,100	114,751.00	0.19
106	601877	正泰电器	4,100	113,365.00	0.19
107	600346	恒力石化	7,900	113,207.00	0.19
108	600809	山西汾酒	600	111,042.00	0.19
109	002202	金风科技	10,300	109,386.00	0.18
110	300012	华测检测	5,600	109,200.00	0.18
111	300676	华大基因	1,800	107,982.00	0.18
112	000807	云铝股份	8,200	104,386.00	0.18
113	000895	双汇发展	4,200	102,858.00	0.17
114	601066	中信建投	4,200	101,640.00	0.17
115	600741	华域汽车	5,500	101,530.00	0.17
116	603338	浙江鼎力	1,800	100,818.00	0.17
117	002601	龙佰集团	5,900	97,350.00	0.16
118	000876	新希望	8,300	96,944.00	0.16
119	002001	新和成	6,200	95,480.00	0.16
120	601111	中国国航	11,200	92,288.00	0.16
121	601336	新华保险	2,500	91,925.00	0.15
122	000786	北新建材	3,700	90,687.00	0.15
123	600233	圆通速递	6,200	90,272.00	0.15
124	601058	赛轮轮胎	7,900	89,981.00	0.15
125	300207	欣旺达	5,500	89,760.00	0.15
126	002007	华兰生物	4,000	89,640.00	0.15
127	601607	上海医药	4,000	89,640.00	0.15
128	601865	福莱特	2,300	88,573.00	0.15
129	300999	金龙鱼	2,200	87,978.00	0.15
130	003816	中国广核	27,600	85,836.00	0.14
131	300759	康龙化成	2,200	84,216.00	0.14
132	600383	金地集团	11,600	83,636.00	0.14
133	600674	川投能源	5,500	82,775.00	0.14
134	000661	长春高新	600	81,780.00	0.14
135	601233	桐昆股份	6,100	80,825.00	0.14
136	600066	宇通客车	5,400	79,596.00	0.13
137	300413	芒果超媒	2,300	78,683.00	0.13
138	600298	安琪酵母	2,155	78,032.55	0.13
139	603613	国联股份	2,095	77,368.35	0.13

140	600332	白云山	2,400	76,512.00	0.13
141	600754	锦江酒店	1,800	76,212.00	0.13
142	000009	中国宝安	6,300	76,041.00	0.13
143	000932	华菱钢铁	15,900	75,843.00	0.13
144	300390	天华新能	2,050	73,390.00	0.12
145	600873	梅花生物	8,200	73,226.00	0.12
146	601319	中国人保	12,200	71,248.00	0.12
147	600026	中远海能	5,500	69,520.00	0.12
148	600803	新奥股份	3,600	68,328.00	0.12
149	603605	珀莱雅	600	67,440.00	0.11
150	600153	建发股份	6,100	66,551.00	0.11
151	600521	华海药业	3,600	66,276.00	0.11
152	002410	广联达	2,000	64,980.00	0.11
153	600060	海信视像	2,600	64,350.00	0.11
154	600183	生益科技	4,500	63,900.00	0.11
155	600745	闻泰科技	1,300	63,570.00	0.11
156	300699	光威复材	2,020	62,317.00	0.10
157	600600	青岛啤酒	600	62,178.00	0.10
158	002430	杭氧股份	1,800	61,848.00	0.10
159	002311	海大集团	1,300	60,892.00	0.10
160	000960	锡业股份	3,800	59,090.00	0.10
161	600196	复星医药	1,900	58,710.00	0.10
162	300601	康泰生物	2,300	58,397.00	0.10
163	002353	杰瑞股份	2,300	57,799.00	0.10
164	600704	物产中大	11,700	57,798.00	0.10
165	000400	许继电气	2,400	55,320.00	0.09
166	600132	重庆啤酒	600	55,296.00	0.09
167	601636	旗滨集团	6,400	55,168.00	0.09
168	600271	航天信息	4,000	54,760.00	0.09
169	600580	卧龙电驱	3,700	54,057.00	0.09
170	600970	中材国际	4,200	53,550.00	0.09
171	600025	华能水电	7,500	53,475.00	0.09
172	600380	健康元	4,200	53,382.00	0.09
173	002080	中材科技	2,600	53,352.00	0.09
174	002236	大华股份	2,700	53,325.00	0.09
175	601898	中煤能源	6,300	53,172.00	0.09
176	600177	雅戈尔	8,400	53,004.00	0.09
177	002850	科达利	400	52,900.00	0.09
178	300408	三环集团	1,800	52,830.00	0.09
179	603233	大参林	1,880	52,658.80	0.09
180	600486	扬农化工	600	52,452.00	0.09
181	600170	上海建工	19,400	52,186.00	0.09
182	000963	华东医药	1,200	52,044.00	0.09
183	002120	韵达股份	5,400	51,624.00	0.09

184	600499	科达制造	4,500	51,120.00	0.09
185	000039	中集集团	7,400	50,986.00	0.09
186	600498	烽火通信	2,500	50,925.00	0.09
187	688180	君实生物	1,300	50,102.00	0.08
188	601799	星宇股份	400	49,440.00	0.08
189	603444	吉比特	100	49,111.00	0.08
190	300682	朗新科技	2,100	48,888.00	0.08
191	603129	春风动力	300	48,570.00	0.08
192	002508	老板电器	1,900	48,051.00	0.08
193	002414	高德红外	6,180	48,018.60	0.08
194	603806	福斯特	1,280	47,603.20	0.08
195	688009	中国通号	8,200	47,560.00	0.08
196	601717	郑煤机	3,800	47,310.00	0.08
197	002372	伟星新材	2,300	47,242.00	0.08
198	600909	华安证券	10,100	47,167.00	0.08
199	600008	首创环保	16,100	46,368.00	0.08
200	300244	迪安诊断	1,800	46,134.00	0.08
201	000877	天山股份	5,600	45,584.00	0.08
202	603882	金城医学	600	45,300.00	0.08
203	002916	深南电路	600	45,222.00	0.08
204	603185	弘元绿能	600	44,730.00	0.08
205	002299	圣农发展	2,300	44,045.00	0.07
206	600755	厦门国贸	5,600	43,344.00	0.07
207	000830	鲁西化工	4,000	42,240.00	0.07
208	601880	辽港股份	27,000	42,120.00	0.07
209	603260	合盛硅业	600	42,012.00	0.07
210	600985	淮北矿业	3,600	41,472.00	0.07
211	600885	宏发股份	1,300	41,405.00	0.07
212	000739	普洛药业	2,300	40,802.00	0.07
213	002841	视源股份	600	40,104.00	0.07
214	300677	英科医疗	1,800	39,600.00	0.07
215	601000	唐山港	11,200	39,536.00	0.07
216	000951	中国重汽	2,300	38,755.00	0.07
217	601100	恒立液压	600	38,598.00	0.06
218	601866	中远海发	15,600	38,532.00	0.06
219	002643	万润股份	2,200	38,302.00	0.06
220	002025	航天电器	600	38,280.00	0.06
221	002266	浙富控股	9,200	37,996.00	0.06
222	603568	伟明环保	2,100	36,771.00	0.06
223	000999	华润三九	600	36,396.00	0.06
224	600131	国网信通	1,800	36,342.00	0.06
225	600323	瀚蓝环境	1,900	35,967.00	0.06
226	600188	兖矿能源	1,200	35,904.00	0.06
227	300285	国瓷材料	1,300	35,620.00	0.06

228	300957	贝泰妮	400	35,552.00	0.06
229	600779	水井坊	600	35,394.00	0.06
230	600161	天坛生物	1,300	35,295.00	0.06
231	600282	南钢股份	10,300	34,711.00	0.06
232	603218	日月股份	1,800	34,182.00	0.06
233	600273	嘉化能源	3,600	33,912.00	0.06
234	603195	公牛集团	348	33,428.88	0.06
235	000581	威孚高科	2,100	33,075.00	0.06
236	600297	广汇汽车	15,700	32,656.00	0.05
237	603267	鸿远电子	500	32,650.00	0.05
238	002624	完美世界	1,900	32,091.00	0.05
239	300776	帝尔激光	480	31,152.00	0.05
240	001872	招商港口	1,800	31,086.00	0.05
241	688187	时代电气	740	30,976.40	0.05
242	002603	以岭药业	1,200	30,828.00	0.05
243	600517	国网英大	5,400	30,780.00	0.05
244	601231	环旭电子	2,000	29,920.00	0.05
245	000401	冀东水泥	4,000	29,480.00	0.05
246	603606	东方电缆	600	29,418.00	0.05
247	000035	中国天楹	6,400	29,312.00	0.05
248	601568	北元集团	5,500	28,985.00	0.05
249	600267	海正药业	2,500	28,450.00	0.05
250	600801	华新水泥	2,300	28,405.00	0.05
251	603899	晨光股份	600	26,784.00	0.05
252	603713	密尔克卫	300	26,727.00	0.04
253	002985	北摩高科	600	26,472.00	0.04
254	600216	浙江医药	2,400	26,280.00	0.04
255	300136	信维通信	1,300	26,104.00	0.04
256	600663	陆家嘴	2,600	25,662.00	0.04
257	600236	桂冠电力	4,600	25,622.00	0.04
258	002463	沪电股份	1,200	25,128.00	0.04
259	300888	稳健医疗	600	25,002.00	0.04
260	600549	厦门钨业	1,300	24,739.00	0.04
261	603127	昭衍新药	600	24,540.00	0.04
262	600409	三友化工	4,500	24,525.00	0.04
263	300725	药石科技	500	24,215.00	0.04
264	002056	横店东磁	1,300	23,673.00	0.04
265	000513	丽珠集团	600	23,346.00	0.04
266	603816	顾家家居	600	22,890.00	0.04
267	002281	光迅科技	600	22,254.00	0.04
268	002595	豪迈科技	600	21,078.00	0.04
269	603678	火炬电子	600	20,676.00	0.03
270	000708	中信特钢	1,300	20,592.00	0.03
271	000402	金融街	4,500	20,340.00	0.03

272	300357	我武生物	600	20,178.00	0.03
273	002032	苏泊尔	400	20,000.00	0.03
274	600535	天士力	1,300	18,863.00	0.03
275	600867	通化东宝	1,800	18,792.00	0.03
276	600377	宁沪高速	1,900	18,677.00	0.03
277	002064	华峰化学	2,700	18,522.00	0.03
278	600685	中船防务	600	17,970.00	0.03
279	300748	金力永磁	600	17,952.00	0.03
280	300726	宏达电子	400	17,888.00	0.03
281	300363	博腾股份	600	17,754.00	0.03
282	002110	三钢闽光	4,200	17,724.00	0.03
283	600566	济川药业	600	17,424.00	0.03
284	601155	新城控股	1,200	17,292.00	0.03
285	002690	美亚光电	660	16,995.00	0.03
286	300482	万孚生物	600	15,978.00	0.03
287	002831	裕同科技	600	14,634.00	0.02
288	002597	金禾实业	600	14,160.00	0.02
289	002653	海思科	600	14,160.00	0.02
290	002773	康弘药业	600	11,472.00	0.02
291	601869	长飞光纤	300	11,103.00	0.02
292	000598	兴蓉环境	2,000	10,860.00	0.02
293	000930	中粮科技	1,300	10,530.00	0.02
294	600062	华润双鹤	600	10,452.00	0.02
295	002216	三全食品	600	9,348.00	0.02
296	002242	九阳股份	600	8,970.00	0.02
297	601598	中国外运	1,800	8,388.00	0.01
298	603025	大豪科技	600	7,416.00	0.01
299	600956	新天绿能	600	5,232.00	0.01

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	20,714,012.00	34.88
2	601318	中国平安	10,317,849.00	17.37
3	600036	招商银行	9,431,808.00	15.88
4	300750	宁德时代	8,217,133.00	13.84
5	601166	兴业银行	6,141,998.00	10.34



6	000858	五 粮 液	5,784,133.00	9.74
7	601012	隆基绿能	4,819,676.00	8.11
8	600900	长江电力	4,674,476.00	7.87
9	600276	恒瑞医药	4,213,652.20	7.09
10	600887	伊利股份	4,023,665.00	6.77
11	000333	美的集团	4,015,028.00	6.76
12	601899	紫金矿业	4,010,595.00	6.75
13	601398	工商银行	3,664,819.00	6.17
14	601888	中国中免	3,592,628.00	6.05
15	000568	泸州老窖	3,313,349.00	5.58
16	600309	万华化学	3,276,083.00	5.52
17	603259	药明康德	3,275,720.00	5.52
18	601328	交通银行	2,862,449.00	4.82
19	601668	中国建筑	2,445,257.00	4.12
20	300760	迈瑞医疗	2,396,471.00	4.03
21	000725	京东方 A	2,340,837.00	3.94
22	601288	农业银行	2,325,647.00	3.92
23	600031	三一重工	2,308,090.00	3.89
24	688981	中芯国际	2,263,910.95	3.81
25	600438	通威股份	2,237,467.81	3.77
26	002475	立讯精密	2,198,785.00	3.70
27	600809	山西汾酒	2,117,722.00	3.57
28	600048	保利发展	2,088,286.00	3.52
29	300124	汇川技术	2,033,579.00	3.42
30	603288	海天味业	2,026,039.00	3.41
31	002352	顺丰控股	2,025,812.00	3.41
32	600690	海尔智家	2,014,647.00	3.39
33	002415	海康威视	1,976,336.00	3.33
34	601088	中国神华	1,859,922.00	3.13
35	601857	中国石油	1,841,386.00	3.10
36	000001	平安银行	1,808,756.00	3.05
37	600028	中国石化	1,803,217.00	3.04
38	600406	国电南瑞	1,748,846.00	2.94
39	601988	中国银行	1,735,679.00	2.92
40	002129	TCL 中环	1,728,771.00	2.91
41	600436	片仔癀	1,703,306.00	2.87
42	600000	浦发银行	1,678,063.00	2.83
43	600089	特变电工	1,608,710.02	2.71
44	000002	万 科 A	1,594,906.00	2.69
45	601390	中国中铁	1,593,729.00	2.68
46	601688	华泰证券	1,563,800.00	2.63
47	300274	阳光电源	1,552,246.00	2.61
48	601818	光大银行	1,537,230.00	2.59
49	601225	陕西煤业	1,531,188.00	2.58

50	600570	恒生电子	1,504,136.00	2.53
51	002304	洋河股份	1,502,627.00	2.53
52	601138	工业富联	1,442,095.00	2.43
53	300015	爱尔眼科	1,430,255.00	2.41
54	601211	国泰君安	1,409,473.00	2.37
55	601919	中远海控	1,385,715.00	2.33
56	600585	海螺水泥	1,354,066.00	2.28
57	603501	韦尔股份	1,336,635.00	2.25
58	600111	北方稀土	1,305,573.00	2.20
59	600104	上汽集团	1,229,494.00	2.07
60	601985	中国核电	1,206,658.00	2.03

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	16,974,674.00	28.58
2	601318	中国平安	8,370,392.00	14.09
3	600036	招商银行	7,658,128.00	12.89
4	601166	兴业银行	5,055,492.00	8.51
5	601012	隆基绿能	4,064,589.48	6.84
6	600900	长江电力	3,822,119.00	6.44
7	600276	恒瑞医药	3,519,669.00	5.93
8	601899	紫金矿业	3,365,869.00	5.67
9	600887	伊利股份	3,340,371.00	5.62
10	601888	中国中免	3,044,539.32	5.13
11	600309	万华化学	2,994,785.00	5.04
12	601398	工商银行	2,986,672.00	5.03
13	603259	药明康德	2,739,535.00	4.61
14	601328	交通银行	2,315,317.00	3.90
15	601668	中国建筑	1,953,355.00	3.29
16	600809	山西汾酒	1,922,908.00	3.24
17	600031	三一重工	1,902,860.00	3.20
18	601288	农业银行	1,894,691.00	3.19
19	688981	中芯国际	1,880,748.89	3.17
20	600438	通威股份	1,871,459.00	3.15
21	600048	保利发展	1,718,567.00	2.89
22	603288	海天味业	1,718,043.28	2.89
23	600690	海尔智家	1,654,111.00	2.78
24	601857	中国石油	1,572,333.00	2.65
25	600436	片仔癀	1,528,917.00	2.57
26	601088	中国神华	1,478,050.00	2.49

27	600406	国电南瑞	1,450,494.00	2.44
28	600028	中国石化	1,414,513.00	2.38
29	600000	浦发银行	1,389,628.00	2.34
30	601988	中国银行	1,388,379.00	2.34
31	600089	特变电工	1,321,969.00	2.23
32	600570	恒生电子	1,314,711.00	2.21
33	601688	华泰证券	1,294,589.00	2.18
34	601225	陕西煤业	1,285,411.00	2.16
35	601818	光大银行	1,281,030.00	2.16
36	601390	中国中铁	1,270,914.00	2.14
37	603501	韦尔股份	1,262,095.00	2.12
38	601138	工业富联	1,190,957.00	2.01

#### 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	273,913,547.43
卖出股票的收入（成交）总额	162,127,043.16

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

本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本，追求对标的指数的紧密跟踪。

## 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵州茅台酒股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到南宁市江南区人民法院的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海银保监局、中国银行间市场交易商协会、厦门证监局、银保监会、中国人民银行、湖北银保监局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海银保监局、福建证监局、重庆证监局、湖北银保监局、中国银行间市场交易商协会、厦门证监局、银保监会、中国人民银行大连市中心支行、邳州市公安局的处罚。

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，除上述主体外，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。

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	172,076.07
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	21,823,921.98

9	合计	21,995,998.05
---	----	---------------

### 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

本报告期末本基金前十名指数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，不存在前五名积极投资流通受限情况。

## 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
284	218,211.51	43,770,410.00	70.63%	18,201,658.00	29.37%

### 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	上海麦迪生利私募基金管理有限公司—麦迪生路遥4号私募证券投资基金	36,000,000.00	58.09%
2	方正证券股份有限公司	3,767,807.00	6.08%
3	吴秀菁	3,270,016.00	5.28%
4	上海惠澄资产管理有限公司—惠澄仲春五号私募证券投资基金	3,000,000.00	4.84%

5	王金艳	1,470,042.00	2.37%
6	陈婷	1,000,029.00	1.61%
7	上海通怡投资管理有限公司—通怡梧桐 8 号私募证券投资基金	1,000,019.00	1.61%
8	俞本银	999,992.00	1.61%
9	王金和	900,032.00	1.45%
10	王青	600,016.00	0.97%

### 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（2023 年 3 月 6 日）基金份额总额	232,972,068.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	93,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	264,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	61,972,068.00

## 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

1、本报告期内，本报告期内基金管理人无重大人事变动；

2、2023 年 3 月，项寅同志担任上海银行股份有限公司资产托管部副总经理职务，上述人事变动已进行备案、公告。

### 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

#### 10.6.1 管理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。

#### 10.6.2 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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
山西证券股份有限公司	1	231,134,646.70	53.01%	215,260.69	53.12%	-
方正证券股份有限公司	2	107,382,445.16	24.63%	100,008.92	24.68%	-
浙商证券股份有限公司	1	87,848,213.20	20.15%	80,934.96	19.97%	-
江海证券有限公司	1	9,675,285.53	2.22%	9,011.17	2.22%	-
中泰证券股份有限公司	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。

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

以上交易单元均为本报告期内新增。

**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
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	81,555,000.00	100.00%	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-



江海证券有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

## 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	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	规定报刊、规定网站	2023-01-13
2	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	规定网站	2023-01-13
3	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要	规定网站	2023-01-13
4	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	规定网站	2023-01-13
5	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	规定网站	2023-01-13
6	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	规定报刊	2023-01-13
7	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金增加中信建投证券为基金网下现金认购代理商的公告	规定报刊、规定网站	2023-02-27
8	国联安基金管理有限公司关于国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	规定报刊、规定网站	2023-02-28
9	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效的公告	规定报刊、规定网站	2023-03-07
10	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2023-03-21
11	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	规定网站、深圳证券交易所	2023-03-21
12	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书提示性公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2023-03-21
13	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2023-03-24
14	关于国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2023-04-04
15	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金增加海通证券为基金申购赎回代办券商的公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2023-04-14

16	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金及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增加中信建投证券为基金申购赎回代办券商的公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2023-04-17
----	---	-------------------	------------

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年5月26日至2023年6月29日	0.00	29,483,128.00	29,483,128.00	0.00	0.00%
	2	2023年6月30日	0.00	36,000,000.00	0.00	36,000,000.00	58.09%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 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

## 12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

## 12.3 查阅方式

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

国联安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日