

# 国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金

## 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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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 1 月 1 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
1.2 目录	3
<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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
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	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	12
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
<b>5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
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
<b>7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
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	50
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	50
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	50
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	51
7.12 投资组合报告附注	51
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>52</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	53
8.3 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 .....	53
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</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 .....	54
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	55
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>56</b>
<b>12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金	
基金简称	国联安核心趋势一年持有混合	
基金主代码	014325	
交易代码	014325	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 12 月 30 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	476,698,570.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安核心趋势一年持有混合 A	国联安核心趋势一年持有混合 C
下属分级基金的交易代码	014325	014326
报告期末下属分级基金的份额总额	437,420,914.96 份	39,277,655.83 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制基金资产投资风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	<p>本基金是混合型基金，根据宏观经济发展趋势、政策面因素、金融市场的利率变动和市场情绪，综合运用定性和定量的方法，对股票、债券和现金类资产的预期收益风险及相对投资价值进行评估，确定基金资产在股票、债券及现金类资产等资产类别的分配比例。在控制投资风险的前提下，形成大类资产的配置方案。</p> <p>本基金更加注重行业发展趋势的变化，判断不同行业的发展空间、景气周期、竞争格局等因素，通过行业配置策略与个股精选策略相结合的方式，构建投资组合。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%
风险收益特征	<p>本基金属于混合型证券投资基金，通常预期风险与预期收益水平高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。</p> <p>本基金可投资港股通标的股票，需承担港股市场股价波动较大的风险、汇率风险、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险以及境外市场的风险等风险。</p>

### 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	交通银行股份有限公司
信息披露	姓名	李华	陆志俊

负责人	联系电话	021-38992888	95559
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216
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188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）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		200121	200336
法定代表人		于业明	任德奇

## 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
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	国联安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

## 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 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	国联安核心趋势一年持有混合 A	国联安核心趋势一年持有混合 C
本期已实现收益	-26,295,413.20	-2,680,099.84
本期利润	60,451,946.54	5,697,547.38
加权平均基金份额本期利润	0.1336	0.1347
本期加权平均净值利润率	15.35%	15.64%
本期基金份额净值增长率	16.98%	16.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	国联安核心趋势一年持有	国联安核心趋势一年持有

	混合 A	混合 C
期末可供分配利润	-62,486,546.04	-5,982,033.11
期末可供分配基金份额利润	-0.1429	-0.1523
期末基金资产净值	392,165,998.98	34,793,874.54
期末基金份额净值	0.8965	0.8858
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023 年 6 月 30 日)</b>	
	国联安核心趋势一年持有混合 A	国联安核心趋势一年持有混合 C
基金份额累计净值增长率	-10.35%	-11.42%

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）扣除相关费用和资产减值损失后的余额，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

国联安核心趋势一年持有混合 A

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	0.88%	1.01%	1.50%	0.77%	-0.62%	0.24%
过去三个月	0.36%	1.14%	-4.33%	0.70%	4.69%	0.44%
过去六个月	16.98%	1.13%	-0.94%	0.72%	17.92%	0.41%
过去一年	-2.26%	1.24%	-10.80%	0.87%	8.54%	0.37%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-10.35%	1.43%	-15.75%	0.99%	5.40%	0.44%

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。

国联安核心趋势一年持有混合 C

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	0.81%	1.01%	1.50%	0.77%	-0.69%	0.24%
过去三个月	0.16%	1.14%	-4.33%	0.70%	4.49%	0.44%
过去六个月	16.51%	1.13%	-0.94%	0.72%	17.45%	0.41%

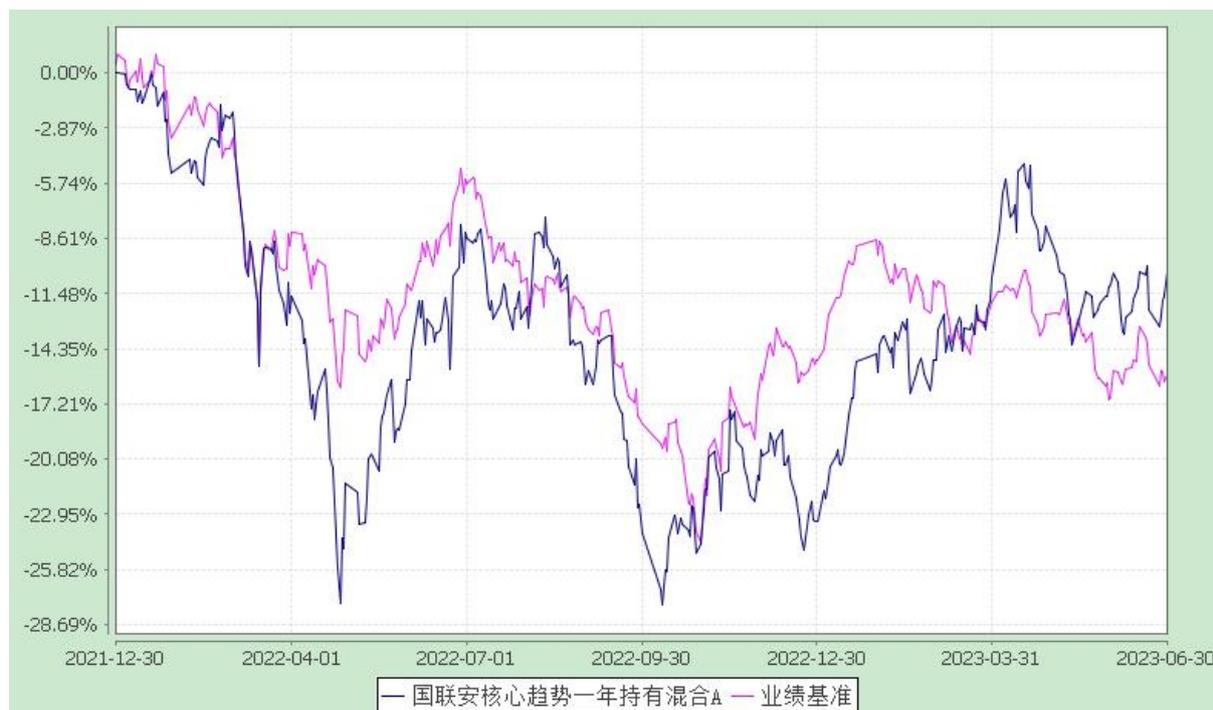
过去一年	-3.04%	1.24%	-10.80%	0.87%	7.76%	0.37%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-11.42%	1.43%	-15.75%	0.99%	4.33%	0.44%

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

国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金  
 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  
 (2021 年 12 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日)

国联安核心趋势一年持有混合 A



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%；

2、本基金基金合同于 2021 年 12 月 30 日生效；

3、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。

国联安核心趋势一年持有混合 C



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%；

2、本基金基金合同于 2021 年 12 月 30 日生效；

3、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		
魏东	本基金基金经理、兼任国联安精选混合型证券投资基金基金经理、国联安核心资产策略混合型证券投资基金基金经理、常务副总经理、投资总监。	2021-12-30	-	26 年（自 1997 年起）	魏东先生，硕士研究生。曾任平安证券股份有限公司研究员，国信证券股份有限公司研究员，华宝兴业基金管理有限公司交易部总经理、基金经理、投资副总监及国内投资部总经理等职。2009 年 6 月加入国联安基金管理有限公司，历任公司总经理助理、投资总监、副总经理、常务副总经理等职。2009 年 9 月起担任国联安德盛精选混合型证券投资基金的基金经理；2009 年 12 月至 2011 年 8 月兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金的基金经理；2014 年 3 月至 2021 年 5 月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；2020 年 11 月起兼任国联安核心资产策略混合型证券投资基金的基金经理；2021 年 12 月起兼任国联安核心趋势一年持有期混合型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》、《国联安核心趋势一年持有期混合型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

上半年虽然指数表现平稳，但行业之间表现差异极大，除 AIGC 相关的游戏传媒和计算机等录得较大涨幅外，其他多数行业表现均乏善可陈。本基金主要布局于 TMT、军工及有色黄金等行业，上半年通过积极交易、灵活轮动等策略，取得了一定相对收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，国联安核心趋势一年 A 的份额净值增长率为 16.98%，同期业绩比较基准收益率为 -0.94%；国联安核心趋势一年 C 的份额净值增长率为 16.51%，同期业绩比较基准收益率为 -0.94%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济角度看，上半年投资者经历了一季度的乐观憧憬以及二季度的回归现实，尤其是二季度从地产等投资和销售等数据看，行业风险仍然在扩大而不是在收敛，叠加出口回落、消费降速，国内经济似乎弱于预期。从近期相关会议来看，我们预计未来可能将有更进一步的相关经济刺激政策出台。另一方面，随着美国通胀的快速回落，美国利率基本见顶，未来对市场风险偏好和人民币汇率等都有正面影响。整体来看，三季度我们所面临的国际宏观环境在改善，市场情绪回暖和修复可能性在增加。

从市场层面来看，新增资金不足始终是困扰市场的主要问题，定增及大小非减持等对市场持续构成压力。在供需相对失衡的背景下，整体市场估值水平可能继续下滑，同时行情的演绎总是以板块轮动的方式完成。因此，虽然三季度基本面可能有所改观，但预计仍然是以个别板块的轮动表现为主。

基于以上判断，我们的策略是继续精选行业和公司，选择行业增长确定性较强、估值相对安全的公司。目前来看，军工、半导体设备、黄金以及部分消费电子板块是我们关注的重点。

#### 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,本基金本报告期末未进行利润分配,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

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,基金托管人在国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内,国联安基金管理有限公司在国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内,由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关

内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

## 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：国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金

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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,917,983.57	2,578,084.46
结算备付金		-	-
存出保证金		43,246,085.38	37,341,586.40
交易性金融资产	6.4.7.2	376,653,883.16	376,514,850.48
其中：股票投资		376,653,883.16	375,699,703.52
基金投资		-	-
债券投资		-	815,146.96
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		4,617.61	5,499.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		427,822,569.72	416,440,020.50
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		136,206.91	-
应付管理人报酬		520,414.85	543,725.76
应付托管费		86,735.80	90,620.95

应付销售服务费		22,602.85	26,412.87
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	96,735.79	190,500.00
负债合计		862,696.20	851,259.58
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	476,698,570.79	542,670,334.59
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-49,738,697.27	-127,081,573.67
净资产合计		426,959,873.52	415,588,760.92
负债和净资产总计		427,822,569.72	416,440,020.50

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，国联安核心趋势一年持有混合 A 基金份额净值 0.8965 元，国联安核心趋势一年持有混合 C 基金份额净值 0.8858 元。基金份额总额 476,698,570.79 份，其中国联安核心趋势一年持有混合 A 基金份额 437,420,914.96 份，国联安核心趋势一年持有混合 C 基金份额 39,277,655.83 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>70,134,919.61</b>	<b>-40,362,645.17</b>
1.利息收入		172,582.77	382,873.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	172,582.77	382,873.13
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）		-25,162,670.12	-16,205,451.47
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-26,292,443.44	-19,089,084.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,101.04	1,851.79
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-

股利收益	6.4.7.14	1,128,672.28	2,881,780.77
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）	6.4.7.15	95,125,006.96	-24,540,066.83
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）		-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,985,425.69</b>	<b>4,450,529.55</b>
1. 管理人报酬		<b>3,204,992.19</b>	<b>3,585,449.10</b>
2. 托管费		534,165.36	597,574.80
3. 销售服务费		144,951.50	174,662.03
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	101,316.64	92,843.62
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>66,149,493.92</b>	<b>-44,813,174.72</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>66,149,493.92</b>	<b>-44,813,174.72</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>66,149,493.92</b>	<b>-44,813,174.72</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	542,670,334.59	-	-127,081,573.67	415,588,760.92
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）	542,670,334.59	-	-127,081,573.67	415,588,760.92
三、本期增减变动	-65,971,763.80	-	77,342,876.40	11,371,112.60

额（减少以“-”号填列）				
（一）、综合收益总额	-	-	66,149,493.92	66,149,493.92
（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）	-65,971,763.80	-	11,193,382.48	-54,778,381.32
其中：1.基金申购款	1,160,569.09	-	-146,855.70	1,013,713.39
2.基金赎回款	-67,132,332.89	-	11,340,238.18	-55,792,094.71
（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）	476,698,570.79	-	-49,738,697.27	426,959,873.52
项目	上年度可比期间 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）	539,981,230.91	-	65,832.45	540,047,063.36
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）	539,981,230.91	-	65,832.45	540,047,063.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,560,085.20	-	-45,077,136.44	-43,517,051.24
（一）、综合收益总额	-	-	-44,813,174.72	-44,813,174.72
（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）	1,560,085.20	-	-263,961.72	1,296,123.48

其中：1.基金申购款	1,560,085.20	-	-263,961.72	1,296,123.48
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	541,541,316.11	-	-45,011,303.99	496,530,012.12

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

国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金(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[2021]3542号《关于准予国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准，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《国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，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 539,962,782.00 元，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(2021)第 1272 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金基金合同》于 2021 年 12 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 539,981,230.91 份基金份额，其中认购资金利息折合 18,448.91 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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，而不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购基金份额时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C

类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会准予上市的股票)、港股通标的股票、债券(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(协议存款、通知存款以及定期存款等)、货币市场工具、股指期货、国债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)。本基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)投资占基金资产的比例为 60%-95%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×60%+恒生指数收益率×20%+中债综合指数收益率×20%。

#### 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》、《国联安核心趋势一年持有期混合型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 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

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。

#### 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

本报告期内本基金无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金未发生过会计差错。

#### 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	7,917,983.57
等于：本金	7,916,138.99
加：应计利息	1,844.58
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	7,917,983.57

##### 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	361,002,710.65	-	376,653,883.16	15,651,172.51

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	361,002,710.65	-	376,653,883.16	15,651,172.51

#### 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

本报告期末本基金无其他资产。

#### 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	32,728.42
预提信息披露费	59,507.37

预提账户维护费	4,500.00
合计	96,735.79

#### 6.4.7.7 实收基金

国联安核心趋势一年持有混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	492,871,084.18	492,871,084.18
本期申购	1,059,207.21	1,059,207.21
本期赎回（以“-”号填列）	-56,509,376.43	-56,509,376.43
本期末	437,420,914.96	437,420,914.96

国联安核心趋势一年持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
上年度末	49,799,250.41	49,799,250.41
本期申购	101,361.88	101,361.88
本期赎回（以“-”号填列）	-10,622,956.46	-10,622,956.46
本期末	39,277,655.83	39,277,655.83

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

国联安核心趋势一年持有混合 A

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	-42,613,142.29	-72,529,373.27	-115,142,515.56
本期利润	-26,295,413.20	86,747,359.74	60,451,946.54
本期基金份额交易产生的变动数	6,422,009.45	3,013,643.59	9,435,653.04
其中：基金申购款	-143,737.74	14,170.67	-129,567.07
基金赎回款	6,565,747.19	2,999,472.92	9,565,220.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-62,486,546.04	17,231,630.06	-45,254,915.98

## 国联安核心趋势一年持有混合 C

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	-4,628,834.88	-7,310,223.23	-11,939,058.11
本期利润	-2,680,099.84	8,377,647.22	5,697,547.38
本期基金份额交易产生的变动数	1,326,901.61	430,827.83	1,757,729.44
其中：基金申购款	-11,830.37	-5,458.26	-17,288.63
基金赎回款	1,338,731.98	436,286.09	1,775,018.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,982,033.11	1,498,251.82	-4,483,781.29

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	14,244.14
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	158,338.63
合计	172,582.77

注：此处其他列示的是券商结算保证金利息收入。

## 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	623,039,632.84
减：卖出股票成本总额	647,583,584.67
减：交易费用	1,748,491.61
买卖股票差价收入	-26,292,443.44

## 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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	3,093.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,992.00
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	1,101.04

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	817,920.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	801,992.00
减：应计利息总额	17,920.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,992.00

#### 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投资收益赎回差价收入。

#### 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投资收益申购差价收入。

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本报告期内本基金无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,128,672.28
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,128,672.28

#### 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	95,125,006.96
——股票投资	95,123,334.96
——债券投资	1,672.00

——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	95,125,006.96

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	32,728.42
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
沪港通_证券组合费	80.85
账户维护费	9,000.00
合计	101,316.64

#### 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、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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，本基金均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，本基金均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，本基金均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，本基金均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，本基金均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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,204,992.19	3,585,449.10
其中：支付销售机构的客户维护费	783,481.36	424,310.77

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的 1.5% 年费率计提，基金管理费每日计提，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×1.5%÷当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	534,165.36	597,574.80

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提，基金托管费每日计提，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.25%÷当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安核心趋势一 年持有混合 A	国联安核心趋势一年持 有混合 C	合计

国联安基金管理有限 公司	-	718.90	718.90
交通银行	-	5,066.38	5,066.38
合计	-	5,785.28	5,785.28
获得销售服务费的各关 联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安核心趋势一 年持有混合A	国联安核心趋势一年持 有混合C	合计
国联安基金管理有限 公司	-	733.77	733.77
交通银行	-	5,706.86	5,706.86
合计	-	6,440.63	6,440.63

注：1、国联安核心趋势一年持有混合 A 基金份额：不收取销售服务费；

2、国联安核心趋势一年持有混合 C 基金份额：收取销售服务费：

(1) 计算标准

支付基金销售机构的国联安核心趋势一年持有混合 C 基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值的 0.8% 年费率计提，每日计提，按月支付。

(2) 计算方式

C 类基金份额每日应计提的销售服务费 = C 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.8% / 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进行转融通证券出借业务。

#### 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，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，除基金管理人之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
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022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
交通银行	7,917,983.57	14,244.14	7,460,006.80	104,660.37

注：1、本基金托管户的银行存款由基金托管人中国交通银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

2、本基金证券资金户的存款为本基金存放于国泰君安证券股份有限公司基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

#### 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参与关联方承销的证券。

#### 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，本基金均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（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688539	高华科技	2023-04-11	6 个月	新股锁定	38.22	43.49	4,267	163,084.74	185,571.83	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新股待上市	57.66	57.66	2,366	136,423.56	136,423.56	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股待上市并锁定	57.66	57.66	263	15,164.58	15,164.58	-
688522	纳睿雷达	2023-02-22	6 个月	新股锁定	46.68	51.50	2,381	111,145.08	122,621.50	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新股待上市	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新股待上市并锁定	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
30148	豪恩	2023-0	1 个月	新股	39.78	39.78	2,356	93,721	93,721	-

8	汽电	6-26	内 (含)	待上 市				.68	.68	
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	1 个月 内 (含)	新股 待上 市	25.82	25.82	2,754	71,108 .28	71,108 .28	-
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	6 个月	新股 待上 市并 锁定	25.82	25.82	306	7,900. 92	7,900. 92	-
68860 3	天承 科技	2023-0 6-30	1 个月 内 (含)	新股 待上 市	55.00	55.00	1,251	68,805 .00	68,805 .00	-
68860 3	天承 科技	2023-0 6-30	6 个月	新股 待上 市并 锁定	55.00	55.00	140	7,700. 00	7,700. 00	-
30126 1	恒工 精密	2023-0 6-29	1 个月 内 (含)	新股 待上 市	36.90	36.90	1,775	65,497 .50	65,497 .50	-
30126 1	恒工 精密	2023-0 6-29	6 个月	新股 待上 市并 锁定	36.90	36.90	198	7,306. 20	7,306. 20	-
68824 9	晶合 集成	2023-0 4-24	6 个月	新股 锁定	19.86	18.06	2,222	44,128 .92	40,129 .32	-
00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月	新股 锁定	9.60	9.41	3,767	36,163 .20	35,447 .47	-
68836 1	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月	新股 锁定	23.60	64.67	399	9,416. 40	25,803 .33	-
68847 2	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月	新股 锁定	11.10	17.04	1,433	15,906 .30	24,418 .32	-
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	6 个月	新股 锁定	29.60	71.42	333	9,856. 80	23,782 .86	-
30132 5	曼恩 斯特	2023-0 5-04	6 个月	新股 锁定	76.80	107.95	210	16,128 .00	22,669 .50	-
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	新股 锁定	5.69	5.41	4,140	23,556 .60	22,397 .40	-
68844 3	智翔 金泰	2023-0 6-13	6 个月	新股 锁定	37.88	29.49	694	26,288 .72	20,466 .06	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月	新股 锁定	23.77	42.89	458	10,886 .66	19,643 .62	-
30131 7	鑫磊 股份	2023-0 1-12	6 个月	新股 锁定	20.67	26.17	694	14,344 .98	18,161 .98	-
68853	日联	2023-0	6 个月	新股	152.38	135.97	127	19,352	17,268	-

1	科技	3-24		锁定				.26	.19	
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新股锁定	135.80	120.41	143	19,419.40	17,218.63	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股锁定	26.74	40.68	409	10,936.66	16,638.12	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新股锁定	26.80	22.32	688	18,438.40	15,356.16	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	161	12,075.00	14,612.36	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股锁定	32.34	31.86	458	14,811.72	14,591.88	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新股锁定	43.67	53.05	273	11,921.91	14,482.65	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新股锁定	39.99	36.71	390	15,596.10	14,316.90	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	新股锁定	16.24	16.95	809	13,138.16	13,712.55	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股锁定	36.15	38.13	358	12,941.70	13,650.54	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688352	顾中科技	2023-04-11	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	1,102	13,334.20	13,301.14	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股锁定	14.16	16.21	804	11,384.64	13,032.84	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新股锁定	30.22	25.50	508	15,351.76	12,954.00	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	881	9,849.58	12,853.79	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	546	11,558.82	12,831.00	-
68862	安凯	2023-0	6 个月	新股	10.68	12.34	1,016	10,850	12,537	-

0	微	6-15		锁定				.88	.44	
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股锁定	125.80	118.03	100	12,580.00	11,803.00	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股锁定	25.25	19.69	586	14,796.50	11,538.34	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股锁定	245.56	122.11	63	15,470.28	7,692.93	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6 个月 (含)	新股锁定	0.00	122.11	30	0.00	3,663.30	送股
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股锁定	14.81	13.73	824	12,203.44	11,313.52	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股锁定	26.66	31.50	358	9,544.28	11,277.00	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股锁定	30.26	25.33	435	13,163.10	11,018.55	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股锁定	53.27	40.20	262	13,956.74	10,532.40	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股待上市并锁定	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	491	5,833.08	10,320.82	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新股锁定	131.11	53.24	122	15,995.42	6,495.28	-
301322	绿通科技	2023-05-25	1-6 个月 (含)	新股锁定	0.00	53.24	61	0.00	3,247.64	送股
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
30135	南王	2023-0	6 个月	新股	17.55	16.75	563	9,880.	9,430.	-

5	科技	6-02		锁定				65	25	
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6个月	新股锁定	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	1,148	7,553.84	8,701.84	-
688623	二元科技	2023-05-31	6个月	新股锁定	125.88	86.79	99	12,462.12	8,592.21	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新股锁定	19.99	16.90	506	10,114.94	8,551.40	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新股锁定	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6个月(含)	新股锁定	0.00	25.10	96	0.00	2,409.60	送股
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	新股锁定	33.99	29.49	277	9,415.23	8,168.73	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6个月	新股锁定	25.28	29.87	259	6,547.52	7,736.33	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	17.89	398	7,084.40	7,120.22	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新股锁定	73.45	46.64	123	9,034.35	5,736.72	-

001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股锁定	11.66	12.26	369	4,302.54	4,523.94	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	365	3,781.40	4,321.60	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股锁定	25.98	24.53	128	3,325.44	3,139.84	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股锁定	5.00	8.96	3,217	16,085.00	28,824.32	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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，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 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%（2022 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的 10%。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 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	7,917,983.57	-	-	-	-	-	7,917,983.57
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	43,246,085.38	-	-	-	-	-	43,246,085.38
交易性金融资产	-	-	-	-	-	376,653,883.16	376,653,883.16
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购	-	-	-	-	-	4,617.61	4,617.61

款							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	51,164,068.95	-	-	-	-	376,658,500.77	427,822,569.72
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	136,206.91	136,206.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	520,414.85	520,414.85
应付托管费	-	-	-	-	-	86,735.80	86,735.80
应付销售服务费	-	-	-	-	-	22,602.85	22,602.85
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	96,735.79	96,735.79
负债总计	-	-	-	-	-	862,696.20	862,696.20
利率敏感度缺口	51,164,068.95	-	-	-	-	375,795,804.57	426,959,873.52
上年度末 2022 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	2,578,084.46	-	-	-	-	-	2,578,084.46
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	37,341,586.40	-	-	-	-	-	37,341,586.40
交易性金融资产	-	815,146.96	-	-	-	375,699,703.52	376,514,850.48
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	5,499.16	5,499.16
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	39,919,670.86	815,146.96	-	-	-	375,705,202.68	416,440,020.50
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	543,725.76	543,725.76
应付托管费	-	-	-	-	-	90,620.95	90,620.95
应付销售服务费	-	-	-	-	-	26,412.87	26,412.87
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	190,500.00	190,500.00
负债总计	-	-	-	-	-	851,259.58	851,259.58
利率敏感度缺口	39,919,670.86	815,146.96	-	-	-	374,853,943.10	415,588,760.92

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 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% (2022 年 12 月 31 日：0.20%)，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(2022 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

#### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	上年度末 2022年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	11,567,953.69	11,567,953.69
资产合计	-	<b>11,567,953.69</b>	<b>11,567,953.69</b>
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞 口净额	-	<b>11,567,953.69</b>	<b>11,567,953.69</b>

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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	上年度末 2022年12月31日
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-	减少 578,397.68
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	-	增加 578,397.68

注：本基金本报告期末未进行境外证券市场投资，故本报告期末未进行外汇风险的敏感性分析。

#### 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。本基金股票（含存托凭证）投资占基金资产的比例 60%-95%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；每个交易日日终扣除股指期货和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	376,653,883.16	88.22	375,699,703.52	90.40
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	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>376,653,883.16</b>	<b>88.22</b>	<b>375,699,703.52</b>	<b>90.40</b>

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 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	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 19,956,775.23	增加 22,400,117.00
	业绩比较基准下降 5%	减少 19,956,775.23	减少 22,400,117.00

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	374,748,385.90	351,959,260.01
第二层次	600,471.84	815,146.96
第三层次	1,305,025.42	23,740,443.51
合计	376,653,883.16	376,514,850.48

##### 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的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 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。(2022 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

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	376,653,883.16	88.04
	其中：股票	376,653,883.16	88.04
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	7,917,983.57	1.85
8	其他各项资产	43,250,702.99	10.11
9	合计	427,822,569.72	100.00

注：1、报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 0.00 元，占基金资产净值的比例为 0.00%。

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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	62,946,744.71	14.74
C	制造业	274,844,984.62	64.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,696.28	0.01
E	建筑业	7,957.73	0.00
F	批发和零售业	135,326.03	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	14,059.07	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,574,452.04	5.05

J	金融业	2,070.30	0.00
K	房地产业	7,991,074.00	1.87
L	租赁和商务服务业	510.53	0.00
M	科学研究和技术服务业	9,010,730.97	2.11
N	水利、环境和公共设施管理业	22,490.67	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	51,620.13	0.01
R	文化、体育和娱乐业	12,166.08	0.00
S	综合	-	-
	合计	376,653,883.16	88.22

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 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	002371	北方华创	120,000	38,118,000.00	8.93
2	600416	湘电股份	1,500,000	28,635,000.00	6.71
3	002049	紫光国微	250,000	23,312,500.00	5.46
4	601899	紫金矿业	2,000,000	22,740,000.00	5.33
5	688012	中微公司	125,000	19,556,250.00	4.58
6	600760	中航沈飞	434,000	19,530,000.00	4.57
7	688082	盛美上海	150,000	16,560,000.00	3.88
8	300054	鼎龙股份	640,000	15,827,200.00	3.71
9	002594	比亚迪	60,000	15,496,200.00	3.63
10	002683	广东宏大	500,000	14,720,000.00	3.45
11	300750	宁德时代	57,300	13,109,667.00	3.07
12	600862	中航高科	500,000	12,655,000.00	2.96
13	688768	容知日新	150,664	12,033,533.68	2.82
14	600489	中金黄金	1,100,000	11,363,000.00	2.66
15	002153	石基信息	800,000	11,200,000.00	2.62
16	000534	万泽股份	640,000	10,732,800.00	2.51
17	000975	银泰黄金	900,000	10,530,000.00	2.47
18	300454	深信服	90,000	10,192,500.00	2.39

19	000733	振华科技	100,000	9,585,000.00	2.24
20	688297	中无人机	176,301	9,042,478.29	2.12
21	300416	苏试试验	415,000	8,947,400.00	2.10
22	301129	瑞纳智能	108,700	8,007,929.00	1.88
23	600641	万业企业	418,600	7,991,074.00	1.87
24	600537	亿晶光电	898,300	6,863,012.00	1.61
25	688239	航宇科技	97,181	6,797,810.95	1.59
26	688276	百克生物	92,343	5,780,671.80	1.35
27	002155	湖南黄金	292,500	3,568,500.00	0.84
28	688475	萤石网络	8,415	360,666.90	0.08
29	688539	高华科技	4,267	185,571.83	0.04
30	688629	华丰科技	7,073	160,957.02	0.04
31	301486	致尚科技	2,629	151,588.14	0.04
32	688620	安凯微	10,157	135,209.66	0.03
33	688522	纳睿雷达	2,381	122,621.50	0.03
34	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.03
35	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.02
36	301376	致欧科技	4,192	98,850.60	0.02
37	688143	长盈通	2,519	94,966.30	0.02
38	301170	锡南科技	2,496	92,283.70	0.02
39	688420	美腾科技	2,373	91,906.29	0.02
40	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.02
41	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.02
42	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.02
43	001380	华纬科技	1,694	54,899.76	0.01
44	688249	晶合集成	2,222	40,129.32	0.01
45	603281	江瀚新材	1,208	37,303.04	0.01
46	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
47	301325	曼恩斯特	291	31,944.00	0.01
48	301293	三博脑科	424	31,526.96	0.01
49	301367	怡和嘉业	201	29,816.34	0.01
50	301301	川宁生物	3,266	29,263.36	0.01
51	301311	昆船智能	920	27,121.60	0.01
52	301302	华如科技	712	26,201.60	0.01
53	688361	中科飞测	399	25,803.33	0.01
54	301368	丰立智能	368	25,461.92	0.01
55	001367	海森药业	549	24,687.92	0.01
56	001337	四川黄金	795	24,557.55	0.01
57	688472	阿特斯	1,433	24,418.32	0.01
58	001324	长青科技	1,131	23,764.29	0.01
59	301297	富乐德	1,047	23,567.97	0.01
60	301328	维峰电子	406	23,117.64	0.01
61	688469	中芯集成	4,140	22,397.40	0.01
62	688443	智翔金泰	694	20,466.06	0.00

63	301358	湖南裕能	458	19,643.62	0.00
64	301317	鑫磊股份	716	18,755.54	0.00
65	301322	绿通科技	318	17,323.17	0.00
66	301303	真兰仪表	773	17,299.26	0.00
67	688531	日联科技	127	17,268.19	0.00
68	301267	华夏眼科	283	17,248.85	0.00
69	688576	西山科技	143	17,218.63	0.00
70	301387	光大同创	370	17,033.31	0.00
71	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
72	688582	芯动联科	409	16,638.12	0.00
73	301152	天力锂能	372	16,613.52	0.00
74	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
75	301361	众智科技	569	16,040.11	0.00
76	301282	金禄电子	533	16,021.98	0.00
77	603282	亚光股份	457	15,771.07	0.00
78	301327	华宝新能	195	15,426.45	0.00
79	301307	美利信	477	15,234.27	0.00
80	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
81	301262	海看股份	573	14,757.75	0.00
82	301280	珠城科技	409	14,625.84	0.00
83	688458	美芯晟	161	14,612.36	0.00
84	301338	凯格精机	375	14,587.50	0.00
85	688543	国科军工	273	14,482.65	0.00
86	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
87	301232	飞沃科技	243	14,373.12	0.00
88	688484	南芯科技	390	14,316.90	0.00
89	301277	新天地	725	14,144.75	0.00
90	301132	满坤科技	472	13,872.08	0.00
91	301141	中科磁业	317	13,720.28	0.00
92	301408	华人健康	809	13,712.55	0.00
93	688146	中船特气	358	13,650.54	0.00
94	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
95	301306	西测测试	343	13,325.55	0.00
96	688352	颀中科技	1,102	13,301.14	0.00
97	603162	海通发展	774	13,196.70	0.00
98	301153	中科江南	176	13,192.96	0.00
99	301315	威士顿	253	13,168.53	0.00
100	603153	上海建科	740	13,135.00	0.00
101	301398	星源卓镁	349	13,087.50	0.00
102	301360	荣旗科技	140	13,034.08	0.00
103	688334	西高院	804	13,032.84	0.00
104	688593	新相微	881	12,853.79	0.00
105	688552	航天南湖	546	12,831.00	0.00
106	301290	东星医疗	391	12,531.55	0.00

107	301429	森泰股份	589	12,531.08	0.00
108	688581	安杰思	100	11,803.00	0.00
109	301231	荣信文化	344	11,572.16	0.00
110	301305	朗坤环境	586	11,538.34	0.00
111	301332	德尔玛	838	11,513.58	0.00
112	301386	未来电器	476	11,460.26	0.00
113	688507	索辰科技	93	11,356.23	0.00
114	688433	华曙高科	358	11,277.00	0.00
115	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
116	001278	一彬科技	473	11,247.94	0.00
117	301313	凡拓数创	264	11,175.12	0.00
118	301323	新莱福	277	11,093.33	0.00
119	688570	天玛智控	435	11,018.55	0.00
120	301281	科源制药	426	10,806.52	0.00
121	001287	中电港	504	10,681.96	0.00
122	301157	华塑科技	198	10,629.42	0.00
123	301397	溯联股份	262	10,532.40	0.00
124	301355	南王科技	624	10,516.05	0.00
125	001260	坤泰股份	484	10,401.16	0.00
126	001366	播恩集团	646	9,961.32	0.00
127	301357	北方长龙	200	9,714.90	0.00
128	301300	远翔新材	307	9,701.20	0.00
129	301439	泓淋电力	559	9,496.92	0.00
130	301227	森鹰窗业	340	9,428.20	0.00
131	301285	鸿日达	643	9,317.07	0.00
132	301428	世纪恒通	289	9,143.40	0.00
133	001368	通达创智	351	8,922.42	0.00
134	301319	唯特偶	149	8,917.65	0.00
135	601061	中信金属	1,172	8,912.56	0.00
136	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
137	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
138	603135	中重科技	473	8,650.22	0.00
139	301349	信德新材	172	8,624.08	0.00
140	688623	双元科技	99	8,592.21	0.00
141	301203	国泰环保	243	8,384.22	0.00
142	301161	唯万密封	360	8,319.60	0.00
143	301276	嘉曼服饰	326	8,313.00	0.00
144	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
145	301316	慧博云通	359	8,203.15	0.00
146	301095	广立微	99	8,182.35	0.00
147	688479	友车科技	277	8,168.73	0.00
148	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
149	688631	莱斯信息	259	7,736.33	0.00
150	301233	盛帮股份	176	7,615.52	0.00

151	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
152	301269	华大九天	49	6,019.16	0.00
153	301345	涛涛车业	126	5,879.85	0.00
154	601065	江盐集团	445	5,396.00	0.00
155	601133	柏诚股份	384	4,747.59	0.00
156	001269	欧晶科技	64	4,705.92	0.00
157	603125	常青科技	177	4,533.89	0.00
158	301330	熵基科技	118	4,222.04	0.00
159	001360	南矿集团	262	4,108.44	0.00
160	301162	国能日新	47	3,707.36	0.00
161	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
162	603172	万丰股份	220	3,678.94	0.00
163	001301	尚太科技	64	3,603.84	0.00
164	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
165	603137	恒尚节能	182	3,210.14	0.00
166	301112	信邦智能	84	3,075.24	0.00
167	301263	泰恩康	147	3,069.36	0.00
168	301279	金道科技	96	2,851.20	0.00
169	301239	普瑞眼科	29	2,844.32	0.00
170	603173	福斯达	88	2,591.60	0.00
171	001323	慕思股份	73	2,479.08	0.00
172	301097	天益医疗	49	2,343.67	0.00
173	301258	富士莱	58	2,280.56	0.00
174	603235	天新药业	72	2,257.92	0.00
175	301197	工大科雅	91	2,193.10	0.00
176	001331	胜通能源	119	2,174.13	0.00
177	603190	亚通精工	70	2,142.00	0.00
178	001336	楚环科技	74	2,070.52	0.00
179	301309	万得凯	71	1,955.34	0.00
180	001230	劲旅环境	75	1,838.25	0.00
181	603130	云中马	80	1,816.80	0.00
182	301237	和顺科技	61	1,811.09	0.00
183	301219	腾远钴业	48	1,793.28	0.00
184	001238	浙江正特	74	1,741.22	0.00
185	301220	亚香股份	49	1,671.39	0.00
186	603211	晋拓股份	87	1,599.06	0.00
187	001229	魅视科技	47	1,565.10	0.00
188	603280	南方路机	63	1,548.54	0.00
189	001236	弘业期货	99	1,517.67	0.00
190	301139	元道通信	51	1,473.39	0.00
191	301187	欧圣电气	76	1,403.72	0.00
192	001299	美能能源	76	1,239.56	0.00
193	603057	紫燕食品	49	1,231.37	0.00
194	301216	万凯新材	66	1,097.58	0.00



1	002049	紫光国微	28,096,286.57	6.76
2	300750	宁德时代	17,287,783.40	4.16
3	600760	中航沈飞	16,981,302.55	4.09
4	600372	中航电子	16,340,984.80	3.93
5	688012	中微公司	15,660,740.92	3.77
6	002594	比亚迪	15,367,965.00	3.70
7	002013	中航机电	15,326,996.00	3.69
8	300454	深信服	14,053,479.30	3.38
9	603690	至纯科技	13,448,954.00	3.24
10	688768	容知日新	13,395,875.83	3.22
11	601800	中国交建	13,292,785.89	3.20
12	600383	金地集团	13,023,451.00	3.13
13	688082	盛美上海	12,926,716.52	3.11
14	600489	中金黄金	12,535,346.00	3.02
15	000975	银泰黄金	12,185,006.00	2.93
16	600259	广晟有色	12,133,468.00	2.92
17	300496	中科创达	12,075,454.00	2.91
18	000534	万泽股份	11,351,877.60	2.73
19	002155	湖南黄金	11,252,273.00	2.71
20	600862	中航高科	11,143,768.00	2.68
21	601117	中国化学	10,984,876.00	2.64
22	002389	航天彩虹	10,704,707.00	2.58
23	688385	复旦微电	10,607,081.89	2.55
24	688297	中无人机	9,865,284.86	2.37
25	301129	瑞纳智能	9,543,403.00	2.30
26	600004	白云机场	9,237,775.00	2.22
27	000733	振华科技	9,208,723.78	2.22
28	300416	苏试试验	8,943,108.00	2.15
29	603650	彤程新材	8,835,760.00	2.13
30	603486	科沃斯	8,814,905.00	2.12
31	002549	凯美特气	8,624,899.00	2.08
32	600641	万业企业	8,341,924.00	2.01

## 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	603986	兆易创新	27,026,254.20	6.50
2	300750	宁德时代	22,394,224.60	5.39
3	688120	华海清科	22,158,507.65	5.33
4	002572	索菲亚	20,725,378.00	4.99
5	002352	顺丰控股	19,453,424.82	4.68
6	600745	闻泰科技	18,097,539.00	4.35

7	688017	绿的谐波	17,479,407.58	4.21
8	601800	中国交建	17,404,379.00	4.19
9	002013	中航机电	16,340,984.80	3.93
10	603501	韦尔股份	16,005,044.73	3.85
11	002735	王子新材	15,206,864.00	3.66
12	300366	创意信息	14,826,491.00	3.57
13	600372	中航电子	14,748,683.87	3.55
14	300496	中科创达	14,332,290.06	3.45
15	688297	中无人机	14,126,705.98	3.40
16	002268	电科网安	14,076,615.00	3.39
17	603690	至纯科技	13,663,474.00	3.29
18	300726	宏达电子	12,627,332.00	3.04
19	300775	三角防务	12,528,132.00	3.01
20	301367	怡和嘉业	12,511,653.00	3.01
21	002129	TCL 中环	12,491,321.00	3.01
22	02238	广汽集团	11,975,087.99	2.88
23	688385	复旦微电	11,866,906.94	2.86
24	601117	中国化学	11,141,128.00	2.68
25	688733	壹石通	11,127,940.09	2.68
26	600383	金地集团	10,934,835.00	2.63
27	002389	航天彩虹	10,661,711.32	2.57
28	002153	石基信息	10,494,114.80	2.53
29	603650	彤程新材	9,585,000.00	2.31
30	600259	广晟有色	9,535,526.00	2.29
31	603486	科沃斯	8,642,958.12	2.08
32	600004	白云机场	8,444,691.00	2.03

#### 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

买入股票成本（成交）总额	553,414,429.35
卖出股票收入（成交）总额	623,039,632.84

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

在股指期货投资上，本基金以套期保值为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

## 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

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券交易市场和期货市场运行趋势的研究，结合国债期货的定价模型寻求其合理的估值水平，与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。基金管理人将充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险性特征，运用国债期货对冲系统风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等；利用金融衍生品的杠杆作用，以达到降低投资组合的整体风险的目的。

### 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。

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	43,246,085.38
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,617.61
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	43,250,702.99

#### 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

本报告期末本基金前十名股票中不存在流通受限情况。

## 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

份额级别	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
国联安核心趋势一年持有混合 A	3,373	129,683.05	210,989,851.43	48.23%	226,431,063.53	51.77%
国联安核心趋势一年持有混合 C	1,405	27,955.63	-	-	39,277,655.83	100.00%
合计	4,778	99,769.48	210,989,851.43	44.26%	265,708,719.36	55.74%

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安核心趋势一年持有混合 A	5,925,994.55	1.35%
	国联安核心趋势一年持有混合 C	16,201.39	0.04%
	合计	5,942,195.94	1.25%

## 8.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国联安核心趋势一年持有混合 A	>100
	国联安核心趋势一年持有混合 C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安核心趋势一年持有混合 A	>100
	国联安核心趋势一年持有混合 C	0
	合计	>100

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安核心趋势一年持有混合 A	国联安核心趋势一年持有混合 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 30 日）基金份额总额	490,622,741.76	49,358,489.15
本报告期期初基金份额总额	492,871,084.18	49,799,250.41
本报告期基金总申购份额	1,059,207.21	101,361.88
减：本报告期基金总赎回份额	56,509,376.43	10,622,956.46
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	437,420,914.96	39,277,655.83

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

## 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

#### 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，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

### 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	
国泰君安证券股份有限公司	3	1,132,853,026.15	100.00%	1,044,736.13	100.00%	-

注：1.根据《关于新设公募基金管理人证券交易模式转换有关事项的通知》（证监办发[2019]14号）的有关规定，基金产品管理人可选择一家或多家证券公司开展证券交易，并可免于执行《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》第二条“一家基金管理公司通过一家证券公司的交易席位买卖证券的年交易佣金，不得超过其当年所有基金买卖证券交易佣金的30%”的分仓规定。2.本基金管理人选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强、能满足公募基金采用券商交易模式进行证券交易和结算需要的证券公司作为本基金的证券经纪商。3.本基金管理人与选择的证券经

纪商、本基金的托管人签订证券经纪服务协议，对账户管理、资金存管、交易执行、交易管理、佣金收取、清算交收、违约责任等作出约定。4.报告期内，本基金通过国泰君安证券的专用交易单元进行场内证券交易，无其他新增或停止使用的交易单元。5.本基金选择的证券经纪商国泰君安证券与本公司不存在关联关系。6.按照本基金与国泰君安证券签订的经纪服务协议，本基金通过其提供的交易单元进行股票交易的佣金费率为0.1%，进行债券交易的佣金费率为0.02%，实际支付的佣金已扣除由经纪服务商承担的费用，在进行交易结算时逐笔直接扣除。本基金通过其提供的交易单元进行港股通股票交易的佣金费率为0.1%，在进行交易结算时逐笔直接扣除。

#### 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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

#### 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	国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	规定网站	2023-01-20
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
3	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加联泰基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-02-08
4	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加众禄基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-02-08
5	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新华信通为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-03-24
6	国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站	2023-03-31
7	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	规定报刊	2023-03-31
8	国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金 2023 年 1 季度报告	规定网站	2023-04-22
9	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023	规定报刊	2023-04-22

	年 1 季度报告提示性公告		
10	国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金招募说明书更新（2023 年第 1 号）	规定网站	2023-05-18
11	国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2023-05-18
12	国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2023-05-18
13	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行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	2023-05-29
14	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加腾安基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-06-30

## 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 1 月 1 日 -2023 年 6 月 30 日	140,999,175.00	-	-	140,999,175.00	29.58%
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核心趋势一年持有期混合型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安核心趋势一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安核心趋势一年持有期混合型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