国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 28 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 7
2.4 信息披露方式 7
2.5 其他相关资料 8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 9
3.3 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 14
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 15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 17
§5 托管人报告 17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
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 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17
§6 审计报告 18
6.1 审计意见 18
6.2 形成审计意见的基础 18
6.3 其他信息 18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 19
§7 年度财务报表 20
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 51
8.1 期末基金资产组合情况 51
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 60

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 62
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 62
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 62
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 62
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
8.12 投资组合报告附注 63
§9 基金份额持有人信息 64
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
9.2 期末上市基金前十名持有人 64
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 65
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 65
§10 开放式基金份额变动 65
§11 重大事件揭示 65
11.1 基金份额持有人大会决议 65
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 66
11.4 基金投资策略的改变 66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 66
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 66
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 66
11.8 其他重大事件 68
§12 影响投资者决策的其他重要信息 69
§13 备查文件目录 70
13.1 备查文件目录 70
13.2 存放地点 70
13.3 查阅方式 70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安国证 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	58,972,068.00 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	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。 1、股票投资策略 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。 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。 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。 2、债券投资策略 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。 3、资产支持证券投资策略 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定量的全方面分析，评估其相对投资价值后作出相应的投资决策。 4、可转换债券和可交换债券投资策略 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。 5、金融衍生品投资策略 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。 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。 6、融资及转融通证券出借业务投资策略 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。 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。

	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。
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@bosc.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	上海市黄浦区中山南路688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37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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金年度报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	1,439,393.60	-1,206,189.31
本期利润	5,961,491.36	-1,299,256.94
加权平均基金份额本期利润	0.1155	-0.0321
本期加权平均净值利润率	12.66%	-3.28%
本期基金份额净值增长率	14.04%	-13.52%
3.1.2 期末数据和指标	**2024 年末**	**2023 年末**
期末可供分配利润	-3,597,666.81	-1,483,810.57
期末可供分配基金份额利润	-0.0610	-0.1352
期末基金资产净值	58,156,422.34	9,488,257.43
期末基金份额净值	0.9862	0.8648
3.1.3 累计期末指标	**2024 年末**	**2023 年末**
基金份额累计净值增长率	-1.38%	-13.52%

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
过去三个月	-3.40%	1.69%	-3.64%	1.76%	0.24%	-0.07%
过去六个月	13.17%	1.61%	12.07%	1.68%	1.10%	-0.07%
过去一年	14.04%	1.29%	12.03%	1.36%	2.01%	-0.07%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-1.38%	1.07%	-7.17%	1.14%	5.79%	-0.07%

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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 3 月 6 日至 2024 年 12 月 31 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；

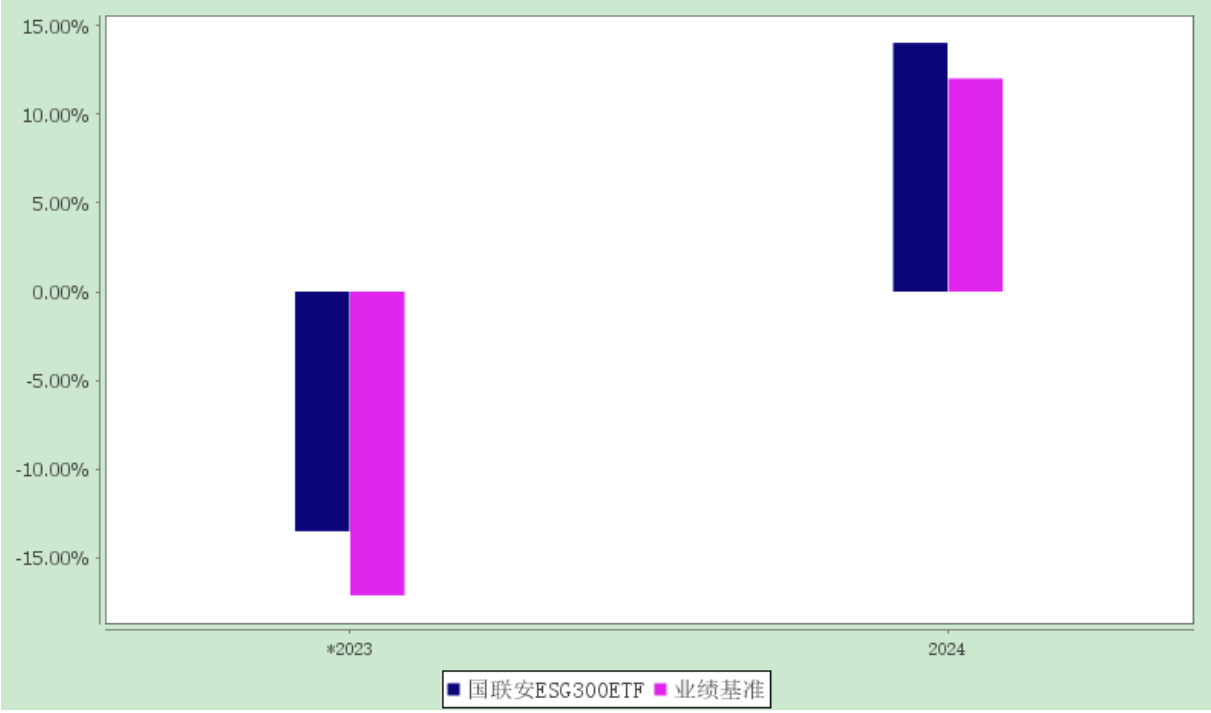
3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约

定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，截至本报告期末本基金成立未满三年。

§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		
章椹元	基金经理、量化投资部总经理	2023-03-06	-	16 年（自 2008 年起）	章椹元先生，硕士研究生。曾任建信基金管理有限公司研究员，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（兼投资经理）。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联接基金和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；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；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；2024 年 1 月起兼任国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理；2024 年 12 月起兼任国联安上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
黄欣	基金经理	2023-03-06	-	22 年（自 2002 年起）	黄欣先生，硕士研究生。2003 年 10 月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、债券投资助理、基金经理助理、基金经理等职。2010 年 4 月起担任国联安中证 A100 指数证券投资基金(LOF)（2024 年 10 月由国联安中证 100 指数证券投资基金(LOF)更名而来）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；2024 年 12 月起兼任国联安上证科创板芯片设计主题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。

4.1.3期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
章椹元	公募基金	15.00	41,930,174,727.20	2020-05-06
	私募资产管理计划	4.00	21,007,497,723.62	2024-09-02
	其他组合	0.00	0.00	-
	合计	19.00	62,937,672,450.82	-

4.1.4基金经理薪酬机制

本基金基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

投资流程独立稽核等。

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易次数为 1 次，发生原因是为了满足产品合同中相关投资比例的限制要求。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

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

公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人依据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》的要求，完善了相关的制度和流程，防范兼任行为潜在利益冲突，确保公平对待所有投资组合，保障基金份额持有人的合法权益。本报告期内，通过对基金经理的投资交易行为进行监控和分析，未发现同一基金经理管理公募基金、私募资产管理计划之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年是选举大年，多国政要发生变动，英国平稳完成了大选和权力交接，特朗普当选美国总统，中东地区叙利亚政府迅速倒台，法国、德国、韩国等发达国家也出现了政局的动荡，世界政治格局未来依旧存在较大的变数。在科技方面，各国均加大了在人工智能方面的投入，国内方面，消费不足依旧是当前宏观经济急需解决的问题。

全年 A 股整体在震荡中上涨，沪深 300 指数上涨约 14.68%，创业板综指上涨 9.63%，科创 50 指数上涨 16.07%，ESG300 指数上涨 12.03%。

依据基金合同的约定，ESG300ETF 基金始终保持合理的仓位，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 0.9862 元，本报告期份额净值增长率为 14.04%，同期业绩比较基准收益率为 12.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，特朗普上任之后，对华政策方面可能存在许多变数，但是美国对中国在科技领域方面的打压不会有根本性的改变。俄乌战争、巴以冲突有望得到一定程度的解决。未来中美关系、中欧关系的发展有待观察，但中国与西方国家在高科技领域的竞争不可避免。中国在人工智能、半导体、尖端军工等领域都有所突破，相信未来高科技领域会不断出现惊喜，值得长期关注，在中央的相应政策之下，国内消费、房地产行业预计会逐步复苏，相应的板块也或将存在投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

基金管理人将继续致力于维护一个有效率、效果的内部控制体系，以风险防范为核心，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值委员会，对估值业务总体负责。估值委员会由公司负责营运相关领导（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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

2024 年 1 月 1 日至 2024 年 3 月 14 日，本基金资产净值低于 5000 万。基金管理人已按照法律法规及《基金合同》的有关规定，向监管机构报告并提出方案，已通过持续营销活动，增加基金规模。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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 审计报告

安永华明（2025）审字第 70076852_B41 号

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终

止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

石静筠　骆文慧

上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2025 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	2,512,284.10	826,245.79
结算备付金		12,262.28	-
存出保证金		2,539.23	45,622.74
交易性金融资产	7.4.7.2	55,778,706.22	8,808,777.74
其中：股票投资		55,778,706.22	8,808,777.74
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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	7.4.7.5	-	-
资产总计		58,305,791.83	9,680,646.27
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2024 年 12 月 31 日**	**上年度末 2023 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		24,828.67	4,558.34

应付托管费		2,979.44	547.03
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	7.4.7.6	121,561.38	187,283.47
负债合计		149,369.49	192,388.84
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	58,972,068.00	10,972,068.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-815,645.66	-1,483,810.57
净资产合计		58,156,422.34	9,488,257.43
负债和净资产总计		58,305,791.83	9,680,646.27

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9862 元，基金份额总额 58,972,068.00 份。

7.2 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 6 日 （基金合同生效日） 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		6,343,473.22	-986,157.32
1.利息收入		19,898.93	139,995.53
其中：存款利息收入	7.4.7.9	19,898.93	106,368.07
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
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,943,546.39	-1,684,365.32
其中：股票投资收益	7.4.7.10	345,853.08	-2,289,754.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	1,597,693.31	605,388.97

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）	7.4.7.14	4,522,097.76	-93,067.63
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-142,069.86	651,280.10
减：二、营业总支出		381,981.86	313,099.62
1．管理人报酬		233,839.14	154,135.35
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		28,060.72	18,496.27
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	7.4.7.16	120,082.00	140,468.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**5,961,491.36**	**-1,299,256.94**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**5,961,491.36**	**-1,299,256.94**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,961,491.36	-1,299,256.94

注：本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。（下同）

7.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,972,068.00	-	-1,483,810.57	9,488,257.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,972,068.00	-	-1,483,810.57	9,488,257.43
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	48,000,000.00	-	668,164.91	48,668,164.91
（一）、综合收益总额	-	-	5,961,491.36	5,961,491.36
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	48,000,000.00	-	-5,293,326.45	42,706,673.55
其中：1.基金申购款	51,000,000.00	-	-5,379,147.48	45,620,852.52
2.基金赎回款	-3,000,000.00	-	85,821.03	-2,914,178.97
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	58,972,068.00	-	-815,645.66	58,156,422.34
项目	**上年度可比期间 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日**			
	实收基金	**其他综合收益**	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	232,972,068.00	-	-	232,972,068.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-222,000,000.00	-	-1,483,810.57	-223,483,810.57
（一）、综合收益总额	-	-	-1,299,256.94	-1,299,256.94
（二）、本期基金	-222,000,000.00	-	-184,553.63	-

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				222,184,553.63
其中：1.基金申购款	192,000,000.00	-	-14,046,426.74	177,953,573.26
2.基金赎回款	-414,000,000.00	-	13,861,873.11	-400,138,126.89
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	10,972,068.00	-	-1,483,810.57	9,488,257.43

注：本基金于 2023 年 3 月 6 日成立，截至本报告期末本基金成立不满两年，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。（下同）

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码（序号）从 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：唐华，主管会计工作负责人：叶培智，会计机构负责人：仲晓峰

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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注册的批复》的核准，由基金管理人国联安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2023 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模 232,972,068.00 基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构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。

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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

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。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述比例。

本基金的标的指数为国证 ESG300 指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据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分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利

息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净资产比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）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确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率时，基金管理人可以进行收益分配；具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告；

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下，收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(3) 本基金收益分配方式为现金分红；

(4) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5) 每一基金份额享有同等分配权；

(6) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(7) 在不违背法律法规及基金合同的规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人经与托管人协商一致，可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则，不需召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

7.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

7.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相

关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

7.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	2,512,284.10	826,245.79
等于：本金	2,511,733.46	826,064.11

加：应计利息	550.64	181.68
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	2,512,284.10	826,245.79

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		51,349,676.09	-	55,778,706.22	4,429,030.13
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		51,349,676.09	-	55,778,706.22	4,429,030.13
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,901,845.37	-	8,808,777.74	-93,067.63
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		8,901,845.37	-	8,808,777.74	-93,067.63

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末及上年度末，本基金均无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金均无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金均无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 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	1,561.38	47,283.47
其中：交易所市场	1,561.38	47,283.47
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	40,000.00	40,000.00
预提信息披露费	80,000.00	100,000.00
合计	121,561.38	187,283.47

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,972,068.00	10,972,068.00
本期申购	51,000,000.00	51,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,000,000.00	-3,000,000.00
本期末	58,972,068.00	58,972,068.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-775,388.87	-708,421.70	-1,483,810.57
本期期初	-775,388.87	-708,421.70	-1,483,810.57
本期利润	1,439,393.60	4,522,097.76	5,961,491.36
本期基金份额交易产生的变动数	-4,261,671.54	-1,031,654.91	-5,293,326.45
其中：基金申购款	-4,461,809.58	-917,337.90	-5,379,147.48
基金赎回款	200,138.04	-114,317.01	85,821.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,597,666.81	2,782,021.15	-815,645.66

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	18,611.27	97,935.86
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	907.58	6,748.90
其他	380.08	1,683.31
合计	19,898.93	106,368.07

注：1.此处其他列示的是保证金利息收入。

2.本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。（下同）

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	250,872.56	-2,268,656.98
股票投资收益——赎回差价收入	94,980.52	-21,097.31
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	345,853.08	-2,289,754.29

注：本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。（下同）

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年	上年度可比期间

	12 月 31 日	2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	11,050,851.82	240,149,106.22
减：卖出股票成本总额	10,750,757.54	241,631,314.46
减：交易费用	49,221.72	786,448.74
买卖股票差价收入	250,872.56	-2,268,656.98

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 3 月 6 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	2,914,178.97	400,138,126.89
减：现金支付赎回款总额	1,866,385.97	267,099,223.89
减：赎回股票成本总额	952,812.48	133,060,000.31
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	94,980.52	-21,097.31

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无股票申购差价收入。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无证券出借差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。（下同）

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无买卖债券差价收入。

7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无衍生工具收益。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,597,693.31	605,388.97
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	1,597,693.31	605,388.97

注：本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	4,522,097.76	-93,067.63
——股票投资	4,522,097.76	-93,067.63
——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	4,522,097.76	-93,067.63

注：本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-142,069.86	651,278.10
其他	-	2.00
合计	-142,069.86	651,280.10

注：本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	80,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	71.00	68.00
其他费用	11.00	400.00
合计	120,082.00	140,468.00

注：此处列示的“其他费用”是指证券账户开户费及银行对账单费用。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	基金托管人
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
中国太平洋保险（集团）股份有限公司（“太保集团”）	基金管理人的最终控制人
中国太平洋人寿保险股份有限公司（“太保人寿”）	基金管理人的最终控制人控制的机构

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。（下同）

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	233,839.14	154,135.35
其中：应支付销售机构的客户维护费	758.12	-
应支付基金管理人的净管理费	233,081.02	154,135.35

注：1、支付基金管理人国联安基金管理有限公司的管理人报酬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：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值 ×0.50%/ 当年天数。

2、本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	28,060.72	18,496.27

注：1、支付基金托管人上海银行的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：

日托管费＝前一日基金资产净值 ×0.06%/ 当年天数。

2、本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行转融通证券出借业务。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。（下同）

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
太保人寿	50,668,900.00	85.92%	-	-

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年3月6日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
上海银行	2,512,284.10	18,611.27	826,245.79	97,935.86

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 2024

年 12 月 31 日的余额为人民币 12,262.28 元（2023 年 12 月 31 日无相关余额）。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金未在承销期内购入过由关联方承销的证券。本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效，上年度可比期间为 2023 年 3 月 6 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金管理人的最终控制人发行的股票太保集团（601601.SH）。

7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688139	海尔生物	2024-12-23	重大事项	35.20	2025-01-07	30.60	800.00	27,784.00	28,160.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 0.00%（2023 年 12 月 31 日：0.00%）。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间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 7.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 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							
货币资金	2,512,284.10	-	-	-	-	-	2,512,284.10
结算备付金	12,262.28	-	-	-	-	-	12,262.28

存出保证金	2,539.23	-	-	-	-	-	2,539.23
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,778,706.22	55,778,706.22
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	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,527,085.61	-	-	-	-	55,778,706.22	58,305,791.83
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	-	-	-	-	-	24,828.67	24,828.67
应付托管费	-	-	-	-	-	2,979.44	2,979.44
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	121,561.38	121,561.38
负债总计	-	-	-	-	-	149,369.49	149,369.49
利率敏感度缺口	2,527,085.61	-	-	-	-	55,629,336.73	58,156,422.34
上年度末 2023 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							
货币资金	826,245.79	-	-	-	-	-	826,245.79
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	45,622.74	-	-	-	-	-	45,622.74
交易性金融资产	-	-	-	-	-	8,808,777.74	8,808,777.74
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	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	871,868.53	-	-	-	-	8,808,777.74	9,680,646.27
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	-	-	-	-	-	4,558.34	4,558.34
应付托管费	-	-	-	-	-	547.03	547.03
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	187,283.47	187,283.47
负债总计	-	-	-	-	-	192,388.84	192,388.84
利率敏感度缺口	871,868.53	-	-	-	-	8,616,388.90	9,488,257.43

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 日，本基金持有的债券、同业存单和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2023 年 12 月 31 日：0.00%)，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，因而未进行敏感性分析(2023 年 12 月 31 日：同)。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	55,778,706.22	95.91	8,808,777.74	92.84
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	55,778,706.22	95.91	8,808,777.74	92.84

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 2,764,481.64	增加 406,473.71
	业绩比较基准下降 5%	减少 2,764,481.64	减少 406,473.71

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	55,750,546.22	8,808,777.74
第二层次	28,160.00	-
第三层次	-	-
合计	55,778,706.22	8,808,777.74

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。(2023 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	55,778,706.22	95.67
	其中：股票	55,778,706.22	95.67
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	2,524,546.38	4.33
8	其他各项资产	2,539.23	0.00
9	合计	58,305,791.83	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。

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	353,648.00	0.61

B	采矿业	2,778,154.40	4.78
C	制造业	32,239,423.02	55.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,583,216.00	4.44
E	建筑业	817,099.00	1.41
F	批发和零售业	123,832.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,325,044.00	2.28
H	住宿和餐饮业	42,976.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,306,680.80	2.25
J	金融业	12,249,997.00	21.06
K	房地产业	594,432.00	1.02
L	租赁和商务服务业	269,063.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	758,645.00	1.30
N	水利、环境和公共设施管理业	98,026.00	0.17
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	238,470.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	55,778,706.22	95.91

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	2,100	3,200,400.00	5.50
2	300750	宁德时代	9,400	2,500,400.00	4.30
3	601318	中国平安	35,200	1,853,280.00	3.19
4	600036	招商银行	44,600	1,752,780.00	3.01
5	000333	美的集团	17,900	1,346,438.00	2.32
6	600900	长江电力	44,500	1,314,975.00	2.26
7	300059	东方财富	45,900	1,185,138.00	2.04
8	601166	兴业银行	59,300	1,136,188.00	1.95
9	000858	五粮液	6,700	938,268.00	1.61
10	002594	比亚迪	3,100	876,246.00	1.51
11	601899	紫金矿业	55,100	833,112.00	1.43
12	002475	立讯精密	17,100	696,996.00	1.20
13	601328	交通银行	87,500	679,875.00	1.17
14	600276	恒瑞医药	14,800	679,320.00	1.17
15	688981	中芯国际	7,150	676,533.00	1.16
16	600887	伊利股份	22,100	666,978.00	1.15
17	601288	农业银行	116,100	619,974.00	1.07
18	000725	京东方 A	122,200	536,458.00	0.92
19	300760	迈瑞医疗	2,000	510,000.00	0.88
20	000063	中兴通讯	11,700	472,680.00	0.81
21	600309	万华化学	6,300	449,505.00	0.77
22	601088	中国神华	10,200	443,496.00	0.76
23	603259	药明康德	8,000	440,320.00	0.76
24	002415	海康威视	13,800	423,660.00	0.73
25	601988	中国银行	76,800	423,168.00	0.73
26	300124	汇川技术	6,900	404,202.00	0.70
27	601668	中国建筑	67,000	402,000.00	0.69
28	300308	中际旭创	3,200	395,232.00	0.68
29	600690	海尔智家	13,800	392,886.00	0.68
30	002371	北方华创	1,000	391,000.00	0.67
31	300274	阳光电源	5,260	388,345.80	0.67
32	601601	中国太保	11,300	385,104.00	0.66
33	601857	中国石油	41,900	374,586.00	0.64
34	000001	平安银行	31,100	363,870.00	0.63
35	600031	三一重工	21,900	360,912.00	0.62
36	600028	中国石化	54,000	360,720.00	0.62
37	002714	牧原股份	9,200	353,648.00	0.61
38	601688	华泰证券	19,500	343,005.00	0.59
39	000568	泸州老窖	2,700	338,040.00	0.58

40	600660	福耀玻璃	5,400	336,960.00	0.58
41	600837	海通证券	30,200	335,824.00	0.58
42	601012	隆基绿能	21,200	333,052.00	0.57
43	603019	中科曙光	4,600	332,672.00	0.57
44	600406	国电南瑞	13,040	328,868.80	0.57
45	002352	顺丰控股	8,100	326,430.00	0.56
46	603501	韦尔股份	3,100	323,671.00	0.56
47	601919	中远海控	20,300	314,650.00	0.54
48	601211	国泰君安	16,300	303,995.00	0.52
49	601985	中国核电	29,000	302,470.00	0.52
50	601225	陕西煤业	12,800	297,728.00	0.51
51	600104	上汽集团	13,600	282,336.00	0.49
52	600809	山西汾酒	1,500	276,315.00	0.48
53	601138	工业富联	12,700	273,050.00	0.47
54	603288	海天味业	5,620	257,958.00	0.44
55	000338	潍柴动力	18,600	254,820.00	0.44
56	000425	徐工机械	30,600	242,658.00	0.42
57	601818	光大银行	62,300	241,101.00	0.41
58	600048	保利发展	27,000	239,220.00	0.41
59	601628	中国人寿	5,700	238,944.00	0.41
60	600436	片仔癀	1,100	235,950.00	0.41
61	002241	歌尔股份	9,100	234,871.00	0.40
62	601888	中国中免	3,500	234,535.00	0.40
63	600905	三峡能源	51,500	225,055.00	0.39
64	601939	建设银行	25,300	222,387.00	0.38
65	601658	邮储银行	39,100	222,088.00	0.38
66	601390	中国中铁	34,200	218,538.00	0.38
67	300014	亿纬锂能	4,600	215,004.00	0.37
68	600019	宝钢股份	30,700	214,900.00	0.37
69	300015	爱尔眼科	15,920	210,940.00	0.36
70	600438	通威股份	9,400	207,834.00	0.36
71	600893	航发动力	5,000	207,250.00	0.36
72	601006	大秦铁路	30,200	204,756.00	0.35
73	600089	特变电工	15,823	201,585.02	0.35
74	688111	金山办公	700	200,473.00	0.34
75	000977	浪潮信息	3,800	197,144.00	0.34
76	002463	沪电股份	4,900	194,285.00	0.33
77	601009	南京银行	18,100	192,765.00	0.33
78	600958	东方证券	18,200	192,192.00	0.33
79	688271	联影医疗	1,500	189,600.00	0.33
80	600585	海螺水泥	7,900	187,862.00	0.32
81	002304	洋河股份	2,200	183,766.00	0.32
82	000002	万科 A	24,700	179,322.00	0.31
83	601825	沪农商行	21,000	178,710.00	0.31

84	603993	洛阳钼业	26,700	177,555.00	0.31
85	002050	三花智控	7,500	176,325.00	0.30
86	000166	申万宏源	32,400	173,340.00	0.30
87	002179	中航光电	4,160	163,488.00	0.28
88	600760	中航沈飞	3,200	162,304.00	0.28
89	000538	云南白药	2,700	161,865.00	0.28
90	601186	中国铁建	17,300	158,641.00	0.27
91	601916	浙商银行	53,600	155,976.00	0.27
92	605499	东鹏饮料	620	154,082.40	0.26
93	600886	国投电力	8,900	147,918.00	0.25
94	603799	华友钴业	5,000	146,300.00	0.25
95	601377	兴业证券	23,300	145,858.00	0.25
96	688036	传音控股	1,500	142,500.00	0.25
97	002311	海大集团	2,900	142,245.00	0.24
98	601058	赛轮轮胎	9,800	140,434.00	0.24
99	002460	赣锋锂业	4,000	140,040.00	0.24
100	600989	宝丰能源	8,300	139,772.00	0.24
101	600547	山东黄金	6,100	138,043.00	0.24
102	601336	新华保险	2,700	134,190.00	0.23
103	600066	宇通客车	4,900	129,262.00	0.22
104	001979	招商蛇口	12,600	129,024.00	0.22
105	002422	科伦药业	4,300	128,699.00	0.22
106	002466	天齐锂业	3,800	125,400.00	0.22
107	600745	闻泰科技	3,200	124,096.00	0.21
108	301236	软通动力	2,100	123,291.00	0.21
109	600426	华鲁恒升	5,500	118,855.00	0.20
110	002797	第一创业	14,200	118,570.00	0.20
111	603369	今世缘	2,600	117,598.00	0.20
112	600487	亨通光电	6,800	117,096.00	0.20
113	600196	复星医药	4,700	116,795.00	0.20
114	002340	格林美	17,700	115,581.00	0.20
115	688777	中控技术	2,300	114,241.00	0.20
116	601360	三六零	11,000	113,850.00	0.20
117	600011	华能国际	16,700	113,059.00	0.19
118	601111	中国国航	14,200	112,322.00	0.19
119	600346	恒力石化	7,300	112,055.00	0.19
120	002236	大华股份	7,000	112,000.00	0.19
121	300207	欣旺达	5,000	111,550.00	0.19
122	000661	长春高新	1,100	109,384.00	0.19
123	300347	泰格医药	2,000	109,240.00	0.19
124	300122	智飞生物	4,150	109,145.00	0.19
125	600674	川投能源	6,300	108,675.00	0.19
126	601633	长城汽车	4,100	107,953.00	0.19
127	000423	东阿阿胶	1,700	106,624.00	0.18

128	600183	生益科技	4,400	105,820.00	0.18
129	003816	中国广核	25,600	105,728.00	0.18
130	000786	北新建材	3,400	103,054.00	0.18
131	601066	中信建投	4,000	103,000.00	0.18
132	000807	云铝股份	7,600	102,828.00	0.18
133	002180	纳思达	3,600	101,412.00	0.17
134	000895	双汇发展	3,900	101,244.00	0.17
135	600176	中国巨石	8,800	100,232.00	0.17
136	002202	金风科技	9,600	99,168.00	0.17
137	002920	德赛西威	900	99,099.00	0.17
138	601108	财通证券	12,000	98,040.00	0.17
139	600600	青岛啤酒	1,200	97,104.00	0.17
140	002129	TCL 中环	10,800	95,796.00	0.16
141	002493	荣盛石化	10,500	95,025.00	0.16
142	002281	光迅科技	1,800	93,906.00	0.16
143	002271	东方雨虹	7,000	90,860.00	0.16
144	002459	晶澳科技	6,600	90,750.00	0.16
145	600219	南山铝业	22,900	89,539.00	0.15
146	601877	正泰电器	3,800	88,958.00	0.15
147	300759	康龙化成	3,450	88,665.00	0.15
148	600741	华域汽车	5,000	88,050.00	0.15
149	002938	鹏鼎控股	2,400	87,552.00	0.15
150	002916	深南电路	700	87,500.00	0.15
151	688599	天合光能	4,514	87,120.20	0.15
152	601319	中国人保	11,400	86,868.00	0.15
153	002709	天赐材料	4,400	86,768.00	0.15
154	000596	古井贡酒	500	86,650.00	0.15
155	300832	新产业	1,200	85,020.00	0.15
156	688223	晶科能源	11,900	84,609.00	0.15
157	300896	爱美客	460	83,950.00	0.14
158	601615	明阳智能	6,500	81,965.00	0.14
159	600188	兖矿能源	5,720	81,052.40	0.14
160	000999	华润三九	1,820	80,698.80	0.14
161	688396	华润微	1,700	80,223.00	0.14
162	300450	先导智能	4,000	80,080.00	0.14
163	601607	上海医药	3,800	79,800.00	0.14
164	600109	国金证券	9,000	78,570.00	0.14
165	300866	安克创新	800	78,112.00	0.13
166	300136	信维通信	3,000	76,320.00	0.13
167	600845	宝信软件	2,600	76,076.00	0.13
168	600332	白云山	2,600	73,892.00	0.13
169	300316	晶盛机电	2,300	73,370.00	0.13
170	600873	梅花生物	7,300	73,219.00	0.13
171	601898	中煤能源	5,900	71,862.00	0.12

172	600765	中航重机	3,500	71,645.00	0.12
173	300142	沃森生物	5,900	71,272.00	0.12
174	000876	新希望	7,800	70,044.00	0.12
175	600803	新奥股份	3,200	69,376.00	0.12
176	000021	深科技	3,600	68,616.00	0.12
177	300999	金龙鱼	2,100	68,481.00	0.12
178	603605	珀莱雅	800	67,760.00	0.12
179	000400	许继电气	2,400	66,072.00	0.11
180	600025	华能水电	6,900	65,619.00	0.11
181	603345	安井食品	800	65,184.00	0.11
182	000617	中油资本	9,300	64,077.00	0.11
183	600875	东方电气	4,000	63,560.00	0.11
184	601872	招商轮船	9,900	63,459.00	0.11
185	300012	华测检测	5,100	63,393.00	0.11
186	600705	中航产融	17,300	62,799.00	0.11
187	600369	西南证券	13,300	62,111.00	0.11
188	300413	芒果超媒	2,300	61,847.00	0.11
189	600549	厦门钨业	3,200	61,664.00	0.11
190	002821	凯莱英	800	60,872.00	0.10
191	603659	璞泰来	3,790	60,298.90	0.10
192	601865	福莱特	3,000	59,070.00	0.10
193	600521	华海药业	3,300	58,971.00	0.10
194	002410	广联达	5,000	58,800.00	0.10
195	600026	中远海能	5,000	58,000.00	0.10
196	600312	平高电气	3,000	57,600.00	0.10
197	600909	华安证券	9,500	57,570.00	0.10
198	603806	福斯特	3,752	55,529.60	0.10
199	002152	广电运通	4,700	54,802.00	0.09
200	002568	百润股份	1,900	53,219.00	0.09
201	000513	丽珠集团	1,400	53,200.00	0.09
202	000039	中集集团	6,800	52,836.00	0.09
203	300751	迈为股份	500	52,575.00	0.09
204	600060	海信视像	2,600	51,844.00	0.09
205	600699	均胜电子	3,300	51,711.00	0.09
206	002841	视源股份	1,400	51,674.00	0.09
207	002624	完美世界	5,000	51,650.00	0.09
208	603338	浙江鼎力	800	51,616.00	0.09
209	600580	卧龙电驱	3,000	51,570.00	0.09
210	600486	扬农化工	890	51,504.30	0.09
211	603195	公牛集团	725	50,924.00	0.09
212	600498	烽火通信	2,600	50,596.00	0.09
213	600008	首创环保	15,000	49,200.00	0.08
214	000960	锡业股份	3,500	49,105.00	0.08
215	300296	利亚德	7,400	47,656.00	0.08

216	688009	中国通号	7,600	47,576.00	0.08
217	300979	华利集团	600	47,190.00	0.08
218	601966	玲珑轮胎	2,600	46,904.00	0.08
219	600383	金地集团	10,700	46,866.00	0.08
220	002603	以岭药业	2,900	46,429.00	0.08
221	688050	爱博医疗	500	45,515.00	0.08
222	600732	爱旭股份	4,100	45,182.00	0.08
223	688187	时代电气	940	45,044.80	0.08
224	600132	重庆啤酒	700	44,114.00	0.08
225	600998	九州通	8,600	44,032.00	0.08
226	603444	吉比特	200	43,768.00	0.08
227	000921	海信家电	1,500	43,350.00	0.07
228	603568	伟明环保	2,000	43,260.00	0.07
229	000830	鲁西化工	3,700	43,253.00	0.07
230	600754	锦江酒店	1,600	42,976.00	0.07
231	601880	辽港股份	24,600	42,558.00	0.07
232	688385	复旦微电	1,100	42,229.00	0.07
233	002506	协鑫集成	15,800	42,186.00	0.07
234	600535	天士力	2,900	41,934.00	0.07
235	600380	健康元	3,700	41,699.00	0.07
236	600282	南钢股份	8,700	40,803.00	0.07
237	300677	英科医疗	1,600	40,448.00	0.07
238	300748	金力永磁	2,240	40,051.20	0.07
239	300212	易华录	1,700	39,780.00	0.07
240	300601	康泰生物	2,300	39,445.00	0.07
241	603899	晨光股份	1,300	39,325.00	0.07
242	002936	郑州银行	18,400	38,640.00	0.07
243	002831	裕同科技	1,400	37,940.00	0.07
244	600970	中材国际	4,000	37,920.00	0.07
245	688005	容百科技	1,200	37,860.00	0.07
246	300676	华大基因	900	37,773.00	0.06
247	002056	横店东磁	2,900	37,584.00	0.06
248	601866	中远海发	14,400	37,584.00	0.06
249	600779	水井坊	700	37,464.00	0.06
250	688676	金盘科技	900	37,278.00	0.06
251	000598	兴蓉环境	4,800	36,432.00	0.06
252	002508	老板电器	1,700	36,431.00	0.06
253	600867	通化东宝	4,500	36,270.00	0.06
254	600131	国网信通	1,900	35,929.00	0.06
255	000708	中信特钢	3,100	35,371.00	0.06
256	002249	大洋电机	6,000	35,220.00	0.06
257	002747	埃斯顿	1,900	35,150.00	0.06
258	300573	兴齐眼药	500	34,890.00	0.06
259	600755	厦门国贸	5,200	34,528.00	0.06

260	600271	航天信息	3,700	33,707.00	0.06
261	603486	科沃斯	700	32,900.00	0.06
262	002080	中材科技	2,500	32,700.00	0.06
263	002557	洽洽食品	1,100	31,955.00	0.05
264	601231	环旭电子	1,900	31,350.00	0.05
265	600685	中船防务	1,300	30,810.00	0.05
266	603678	火炬电子	1,000	30,500.00	0.05
267	300888	稳健医疗	700	29,456.00	0.05
268	000877	天山股份	5,100	28,866.00	0.05
269	688301	奕瑞科技	300	28,671.00	0.05
270	600236	桂冠电力	4,200	28,560.00	0.05
271	000035	中国天楹	5,800	28,246.00	0.05
272	688139	海尔生物	800	28,160.00	0.05
273	600377	宁沪高速	1,800	27,558.00	0.05
274	603882	金域医学	1,000	27,530.00	0.05
275	002531	天顺风能	3,400	26,894.00	0.05
276	002032	苏泊尔	500	26,605.00	0.05
277	002266	浙富控股	8,500	26,520.00	0.05
278	603565	中谷物流	2,700	26,460.00	0.05
279	603456	九洲药业	1,900	25,992.00	0.04
280	600801	华新水泥	2,100	25,410.00	0.04
281	600500	中化国际	6,200	24,924.00	0.04
282	688390	固德威	600	24,540.00	0.04
283	300682	朗新集团	2,000	24,400.00	0.04
284	000582	北部湾港	3,000	23,640.00	0.04
285	601598	中国外运	4,400	23,540.00	0.04
286	002773	康弘药业	1,200	23,520.00	0.04
287	600717	天津港	4,700	22,889.00	0.04
288	688778	厦钨新能	500	22,820.00	0.04
289	601298	青岛港	2,500	22,775.00	0.04
290	601568	北元集团	5,400	22,680.00	0.04
291	600315	上海家化	1,200	20,292.00	0.03
292	688248	南网科技	600	19,254.00	0.03
293	001872	招商港口	900	18,423.00	0.03
294	688475	萤石网络	600	18,114.00	0.03
295	688331	荣昌生物	600	18,066.00	0.03
296	000930	中粮科技	3,100	17,205.00	0.03
297	601869	长飞光纤	400	11,956.00	0.02
298	688276	百克生物	400	10,044.00	0.02
299	600956	新天绿能	1,100	8,294.00	0.01
300	001289	龙源电力	500	7,855.00	0.01

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	3,233,000.00	34.07
2	601318	中国平安	1,440,055.00	15.18
3	600036	招商银行	1,334,169.00	14.06
4	600900	长江电力	1,025,694.00	10.81
5	601166	兴业银行	934,086.00	9.84
6	002594	比亚迪	848,396.00	8.94
7	601899	紫金矿业	823,446.00	8.68
8	600276	恒瑞医药	672,273.00	7.09
9	601398	工商银行	645,638.00	6.80
10	600887	伊利股份	606,736.00	6.39
11	300059	东方财富	596,391.00	6.29
12	601328	交通银行	522,479.00	5.51
13	601288	农业银行	479,247.00	5.05
14	600809	山西汾酒	443,543.00	4.67
15	601012	隆基绿能	443,030.00	4.67
16	600309	万华化学	438,161.00	4.62
17	603259	药明康德	394,022.00	4.15
18	601088	中国神华	393,520.00	4.15
19	601857	中国石油	356,490.00	3.76
20	688981	中芯国际	345,047.14	3.64
21	600690	海尔智家	337,381.00	3.56
22	601668	中国建筑	332,305.00	3.50
23	601988	中国银行	329,447.00	3.47
24	600028	中国石化	326,590.00	3.44
25	601888	中国中免	317,068.00	3.34
26	601225	陕西煤业	302,248.00	3.19
27	600406	国电南瑞	299,650.00	3.16
28	600031	三一重工	295,567.00	3.12
29	002371	北方华创	292,854.00	3.09
30	601138	工业富联	284,929.00	3.00
31	603501	韦尔股份	279,069.00	2.94
32	688111	金山办公	277,432.00	2.92
33	601688	华泰证券	276,776.00	2.92
34	600837	海通证券	257,416.00	2.71
35	600048	保利发展	255,040.00	2.69

36	600089	特变电工	248,534.00	2.62
37	601601	中国太保	247,122.00	2.60
38	601985	中国核电	246,477.00	2.60
39	601211	国泰君安	235,391.00	2.48
40	600905	三峡能源	234,325.00	2.47
41	600660	福耀玻璃	233,873.00	2.46
42	600436	片仔癀	230,878.00	2.43
43	600438	通威股份	228,425.00	2.41
44	603288	海天味业	221,028.00	2.33
45	300014	亿纬锂能	215,736.00	2.27
46	601006	大秦铁路	207,387.00	2.19
47	601919	中远海控	206,750.00	2.18
48	601390	中国中铁	205,781.00	2.17
49	603019	中科曙光	199,937.00	2.11
50	601818	光大银行	198,621.00	2.09
51	600019	宝钢股份	196,761.00	2.07
52	601009	南京银行	190,955.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601398	工商银行	926,128.00	9.76
2	600519	贵州茅台	301,506.00	3.18
3	601318	中国平安	237,839.00	2.51
4	600111	北方稀土	228,685.00	2.41
5	600036	招商银行	221,096.00	2.33
6	000858	五粮液	191,739.00	2.02
7	600570	恒生电子	188,602.00	1.99
8	300408	三环集团	178,304.00	1.88
9	601166	兴业银行	150,590.00	1.59
10	000333	美的集团	146,294.00	1.54
11	600809	山西汾酒	142,892.00	1.51
12	601899	紫金矿业	137,402.00	1.45
13	300750	宁德时代	132,246.00	1.39
14	002001	新和成	129,628.00	1.37
15	601100	恒立液压	115,421.00	1.22
16	600085	同仁堂	110,840.00	1.17
17	000963	华东医药	108,936.00	1.15
18	002601	龙佰集团	105,900.00	1.12

19	600161	天坛生物	105,774.80	1.11
20	002555	三七互娱	101,882.00	1.07

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	39,500,120.74
卖出股票的收入（成交）总额	11,050,851.82

注：不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

8.10 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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆证监局、国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局黑龙江监管局、国家金融监督管理总局四川监管局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局河南监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海南证监局、国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局泉州监管分局、国家金融监督管理总局北京监管局的处罚。

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。

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

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,539.23
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	-
9	合计	2,539.23

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前十名指数股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票，不存在前五名积极投资流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
216	273,018.83	54,087,690.00	91.72%	4,884,378.00	8.28%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红-个人分红	50,668,900.00	85.92%
2	方正证券股份有限公司	1,750,262.00	2.97%
3	海通证券股份有限公司	1,668,470.00	2.83%
4	王青	600,016.00	1.02%
5	易新建	500,014.00	0.85%
6	袁伊	498,014.00	0.84%
7	韩宏兴	420,012.00	0.71%
8	葛伟	400,011.00	0.68%
9	陈婷	198,907.00	0.34%
10	张巧红	197,015.00	0.33%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：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。

9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
章椹元	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

§10 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
本报告期期初基金份额总额	10,972,068.00
本报告期基金总申购份额	51,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	3,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	58,972,068.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2024 年 6 月 28 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，王琤女士不再担任公司总经理职务，常务副总经理兼首席投资官魏东先生代行总经理职务。

2、2024 年 11 月 5 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，唐华先生担任公司总经理职务，常务副总经理兼首席投资官魏东先生不再代行总经理职务。

3、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年 10 月 30 日起改聘会计师事务所，由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。该事项已经国联安基金管理有限公司董事会及相关内部程序审议通过。本基金报告年度支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 4 万元人民币。目前该事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
山西证券股份有限公司	1	27,760,907.14	54.92%	24,985.01	61.76%	-
方正证券股份有限公司	2	16,114,500.82	31.88%	9,223.13	22.80%	-
浙商证券股份有限公司	1	6,675,564.60	13.21%	6,247.66	15.44%	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：一、选择证券经营机构参与证券交易的标准

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券经营机构参与证券交易。具体标准如下：

（一） 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

（二） 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（三）经营行为稳健、规范；

（四）合规风控能力强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具有完善的合规风控机制，能满足基金运作高度保密要求；

（五）不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；

（六）交易服务能力较强，具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；

（七）研究能力较强，能及时、全面地向基金管理人提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据基金管理人所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；

（八）能协助基金管理人拓展资产管理业务和能力，促进基金管理人业务发展等。

二、选择证券经营机构参与证券交易的程序

基金管理人根据上述标准对拟合作证券经营机构开展尽职调查、建立证券经营机构白名单。基金管理人与白名单内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，基金管理人定期对合作证券经营机构开展服务评价，根据各证券经营机构的研究能力和质量、投资研究服务水平、上市公司交流机会和投资研讨会质量等进行评比排名，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。

基金管理人定期评估、维护证券经营机构白名单。如评估发现合作证券经营机构不再符合上述标准的，基金管理人将其从证券经营机构白名单中删除。若证券经营机构所提供的服务不符合要求的，基金管理人可提前中止租用其交易单元。

三、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内本基金退租江海证券有限公司一个上海交易单元。

四、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

五、本部分的数据统计时间区间与本报告的报告期一致；本公司网站披露的《国联安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日。敬请投资者关注上述报告统计时间区间的口径差异。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-01-22
2	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2024-01-22
3	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	规定网站、深圳证券交易所	2024-03-29
4	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-29
5	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-22
6	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2024-04-22
7	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2024-05-17
8	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更新（2024 年第 1 号）	规定网站、深圳证券交易所	2024-05-17
9	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2024-06-28
10	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2024-07-19
11	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-07-19
12	国联安基金管理有限公司关于提醒投资者注	规定网站、规定报刊	2024-07-20

	意防范不法分子冒用国联安基金名义进行诈骗活动的提示性公告		
13	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年中期报告	规定网站、深圳证券交易所	2024-08-30
14	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年中期报告提示性公告	规定报刊	2024-08-30
15	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华宝证券为基金申购赎回代办券商的公告	规定网站、规定报刊、深圳证券交易所、上海证券交易所	2024-09-13
16	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2024-10-25
17	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-10-25
18	国联安基金管理有限公司旗下部分基金更换会计师事务所的公告	规定网站、规定报刊	2024-10-31
19	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2024-11-05

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2024 年 3 月 11 日至 2024 年 3 月 12 日	960,636.00	6,993,433.00	6,285,599.00	1,668,470.00	2.83%
	2	2024 年 3 月 15 日至 2024 年 12 月 31 日	0.00	50,668,900.00	0.00	50,668,900.00	85.92%
产品特有风险							
（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。 （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。 （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。							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安国证 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

13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

13.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日