

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券  
投资基金  
2026 年第 2 季度报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 7 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。  
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国联安 ESG300ETF                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 场内简称       | ESG300ETF 国联安                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |
| 基金主代码      | 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                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 报告期末基金份额总额 | 55,972,068.00 份                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资目标       | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 投资策略       | <p>本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股或增发；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。</p> |

|        |                                                                                  |
|--------|----------------------------------------------------------------------------------|
| 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。 |
| 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                                                                       |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期（2026 年 4 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日） |
|-----------------|---------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 1, 257, 372. 24                       |
| 2. 本期利润         | 5, 600, 125. 06                       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0. 1001                               |
| 4. 期末基金资产净值     | 70, 771, 871. 76                      |
| 5. 期末基金份额净值     | 1. 2644                               |

注：1、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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，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。

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

（报告期：2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）

| 阶段    | 净值增长率<br>① | 净值增长率<br>标准差② | 业绩比较基<br>准收益率③ | 业绩比较基<br>准收益率标<br>准差④ | ①—③    | ②—④     |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|---------|
| 过去三个月 | 8. 59%     | 1. 23%        | 8. 14%         | 1. 26%                | 0. 45% | -0. 03% |
| 过去六个月 | 5. 07%     | 1. 12%        | 4. 60%         | 1. 15%                | 0. 47% | -0. 03% |
| 过去一年  | 27. 67%    | 1. 02%        | 26. 62%        | 1. 05%                | 1. 05% | -0. 03% |
| 过去三年  | 31. 93%    | 1. 08%        | 26. 20%        | 1. 13%                | 5. 73% | -0. 05% |
| 过去五年  | -          | -             | -              | -                     | -      | -       |
| 过去七年  | -          | -             | -              | -                     | -      | -       |

|                |        |       |        |       |       |        |
|----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去十年           | -      | -     | -      | -     | -     | -      |
| 自基金合同<br>生效起至今 | 26.44% | 1.05% | 16.62% | 1.10% | 9.82% | -0.05% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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



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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务   | 任本基金的基金经理期限    |      | 证券从业<br>年限      | 说明                                                                                                                                                                          |
|----|------|----------------|------|-----------------|-----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|    |      | 任职日期           | 离任日期 |                 |                                                                                                                                                                             |
| 黄欣 | 基金经理 | 2023 年 3 月 6 日 | -    | 24 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）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 |

|  |  |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  | <p>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 月至 2025 年 9 月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；2025 年 9 月起兼任国联安中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月起兼任国联安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基</p> |
|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|     |                           |                   |   |                    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                |
|-----|---------------------------|-------------------|---|--------------------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|     |                           |                   |   |                    | 金经理。                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                           |
| 章樾元 | 基金经<br>理、量化<br>投资部总<br>经理 | 2023 年 3 月 6<br>日 | - | 18 年（自<br>2008 年起） | 章樾元先生，硕士研究生。曾任建信基金管理<br>有限公司研究员，富国基金管理有限公<br>司基金经理助理、基金经理，融通基金<br>管理有限公司专户投资经理、基金经理、<br>指数与量化投资部总经理。2019 年 5 月<br>加入国联安基金管理有限公司，担任量<br>化投资部总经理（兼投资经理）。2020 年 5<br>月起担任国联安沪深 300 交易型开放式<br>指数证券投资基金的基金经理；2020 年 8<br>月起兼任国联安中证全指半导体产品与<br>设备交易型开放式指数证券投资基金联<br>接基金、国联安沪深 300 交易型开放式指<br>数证券投资基金联接基金和国联安中证<br>全指半导体产品与设备交易型开放式指<br>数证券投资基金的基金经理；2021 年 2<br>月起兼任国联安中证全指证券公司交易<br>型开放式指数证券投资基金的基金经理；<br>2021 年 5 月至 2025 年 9 月兼任国联安中<br>证新材料主题交易型开放式指数证券投资<br>基金的基金经理；2021 年 6 月起兼任<br>国联安上证科创板 50 成份交易型开放式<br>指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9<br>月起兼任国联安创业板科技交易型开放<br>式指数证券投资基金的基金经理；2021<br>年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置混<br>合型证券投资基金的基金经理；2022 年<br>11 月至 2025 年 1 月兼任国联安添鑫灵<br>活配置混合型证券投资基金的基金经理；<br>2022 年 12 月起兼任国联安中证 1000 指<br>数增强型证券投资基金的基金经理；2023<br>年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易<br>型开放式指数证券投资基金的基金经理；<br>2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交<br>易型开放式指数证券投资基金的基金经<br>理；2024 年 1 月起兼任国联安沪深 300<br>指数增强型证券投资基金的基金经理；<br>2024 年 12 月起兼任国联安上证科创板芯<br>片设计主题交易型开放式指数证券投资<br>基金的基金经理；2025 年 6 月起兼任国<br>联安中证 A500 增强策略交易型开放式指<br>数证券投资基金的基金经理；2025 年 8<br>月起兼任国联安上证科创板综合指数增<br>强型证券投资基金的基金经理；2025 年 9<br>月起兼任国联安中证 A500 红利低波动交 |

|  |  |  |  |  |                                                                   |
|--|--|--|--|--|-------------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月起兼任国联安恒生港股通科技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。

4.1.1 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           |
|-----|----------|---------|-------------------|----------------|
| 章榭元 | 公募基金     | 17      | 41,544,545,428.95 | 2020 年 5 月 6 日 |
|     | 私募资产管理计划 | 5       | 24,666,924,468.65 | 2024 年 9 月 2 日 |
|     | 其他组合     | -       | -                 | -              |
|     | 合计       | 22      | 66,211,469,897.60 | -              |

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交

易量未发现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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2026 年 2 季度，全球经济增长放缓，美国依托人工智能领域的投资保持着经济增长的韧性。中东局势有所缓和，原油、黄金等大宗商品价格也从高位出现一定程度的回落，但未来世界局势的走势仍旧存在很大的不确定性。

国内方面，以半导体为代表的科技股出现大幅上涨，而消费、地产等传统行表现不尽人意，股市两级分化效应明显。

二季度市场整体上行，但不同板块分化较大，沪深 300 指数上涨 11.90%，中证 A100 指数上涨 12.38%，创业板综指上涨 24.75%，ESG300 指数上涨 8.14%。

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。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.2644 元，本报告期份额净值增长率为 8.59%，同期业绩比较基准收益率为 8.14%。

## 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

# § 5 投资组合报告

## 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额（元）         | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|---------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | 68,658,480.18 | 96.89        |
|    | 其中：股票             | 68,658,480.18 | 96.89        |
| 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 | —             | —            |



|   |              |               |        |
|---|--------------|---------------|--------|
|   | 产            |               |        |
| 7 | 银行存款和结算备付金合计 | 2,191,996.63  | 3.09   |
| 8 | 其他资产         | 10,276.97     | 0.01   |
| 9 | 合计           | 70,860,753.78 | 100.00 |

注：1、上表中的权益投资股票项含可退替代款估值增值而 8.2 的合计项不含可退替代款估值增值；

2、由于四舍五入的原因分项之和与合计项可能存在尾差。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 报告期末指数投资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         | 344,425.00    | 0.49         |
| B  | 采矿业              | 3,235,120.00  | 4.57         |
| C  | 制造业              | 48,597,707.88 | 68.67        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,176,686.00  | 3.08         |
| E  | 建筑业              | 583,160.00    | 0.82         |
| F  | 批发和零售业           | 247,925.00    | 0.35         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 1,540,671.00  | 2.18         |
| H  | 住宿和餐饮业           | 28,784.00     | 0.04         |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 1,726,317.00  | 2.44         |
| J  | 金融业              | 8,194,537.00  | 11.58        |
| K  | 房地产业             | 277,558.00    | 0.39         |
| L  | 租赁和商务服务业         | 187,985.00    | 0.27         |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 1,292,617.50  | 1.83         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 89,357.60     | 0.13         |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | —             | —            |
| P  | 教育               | —             | —            |
| Q  | 卫生和社会工作          | 135,629.20    | 0.19         |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | —             | —            |
| S  | 综合               | —             | —            |
|    | 合计               | 68,658,480.18 | 97.01        |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

### 5.2.3 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。

## 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）  | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|--------|--------------|--------------|
| 1  | 300308 | 中际旭创 | 3,200  | 4,064,000.00 | 5.74         |
| 2  | 300750 | 宁德时代 | 9,600  | 3,772,896.00 | 5.33         |
| 3  | 600519 | 贵州茅台 | 2,100  | 2,489,529.00 | 3.52         |
| 4  | 603986 | 兆易创新 | 2,300  | 1,874,500.00 | 2.65         |
| 5  | 601318 | 中国平安 | 36,900 | 1,761,606.00 | 2.49         |
| 6  | 600036 | 招商银行 | 44,600 | 1,583,300.00 | 2.24         |
| 7  | 601899 | 紫金矿业 | 55,200 | 1,387,728.00 | 1.96         |
| 8  | 000333 | 美的集团 | 17,800 | 1,344,434.00 | 1.90         |
| 9  | 688008 | 澜起科技 | 4,000  | 1,239,600.00 | 1.75         |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 17,300 | 1,217,920.00 | 1.72         |

### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

### 5.7 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。

### 5.8 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权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

#### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 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。

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

## 5.11 投资组合报告附注

### 5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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中国人民银行安徽省分行、中国人民银行山东省分行、烟台市牟平区市场监督管理局、济南市市中区财政局、国家金融监督管理总局浙江监管局、国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局、市场监管总局的处罚。

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。

### 5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

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。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称    | 金额（元）     |
|----|-------|-----------|
| 1  | 存出保证金 | 10,276.97 |

|   |         |           |
|---|---------|-----------|
| 2 | 应收证券清算款 | —         |
| 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      | 10,276.97 |

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

##### 5.11.5.2 报告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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           |               |
|---------------------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 55,972,068.00 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 3,000,000.00  |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 3,000,000.00  |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —             |
| 报告期期末基金份额总额               | 55,972,068.00 |

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。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 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 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额       | 份额占比（%） |

|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                   |   | 20%的时间区间                        |               |      |      |               |       |
|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|---|---------------------------------|---------------|------|------|---------------|-------|
| 机构                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                | 1 | 2026 年 4 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 50,668,900.00 | 0.00 | 0.00 | 50,668,900.00 | 90.53 |
| 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</p> <p>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</p> <p>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> |   |                                 |               |      |      |               |       |

注：申购份额包含本报告期内发生的买入份额；赎回份额包含本报告期内发生的卖出份额。

§ 9 备查文件目录

9.1 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

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司  
二〇二六年七月二十一日