

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2020 年中期报告
2020 年 6 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作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.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	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真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况.....	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	41
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.....	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	52
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.....	52
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.....	52
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.....	52
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	55
9 开放式基金份额变动.....	55
10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
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.....	57
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.8 其他重大事件.....	59
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	60
12 备查文件目录.....	61
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联安沪深 300ETF
场内简称	沪深 300E
基金主代码	515660
交易代码	515660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 25 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	464,194,165.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 月 24 日

注：本表所列的基金主代码 515660 为本基金二级市场交易代码，本基金一级市场申购赎回代码为 515661。

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。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。
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。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。
业绩比较基准	沪深 300 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	郭明
	联系电话	021-38992888	010-66105799
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95588
传真		021-50151582	010-66105798
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		200121	100140
法定代表人		于业明	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年1月1日至2020年6月30日）
本期已实现收益	33,512,813.32
本期利润	67,664,859.89
加权平均基金份额本期利润	0.1365
本期加权平均净值利润率	3.46%
本期基金份额净值增长率	3.29%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)

期末可供分配利润	25,769,717.53
期末可供分配基金份额利润	0.0555
期末基金资产净值	1,955,415,887.59
期末基金份额净值	4.2125
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	8.80%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，例如，开放式基金的申购赎回费等，计入费用后实际收益要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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。

4、本基金基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年。

3.2 基金净值表现

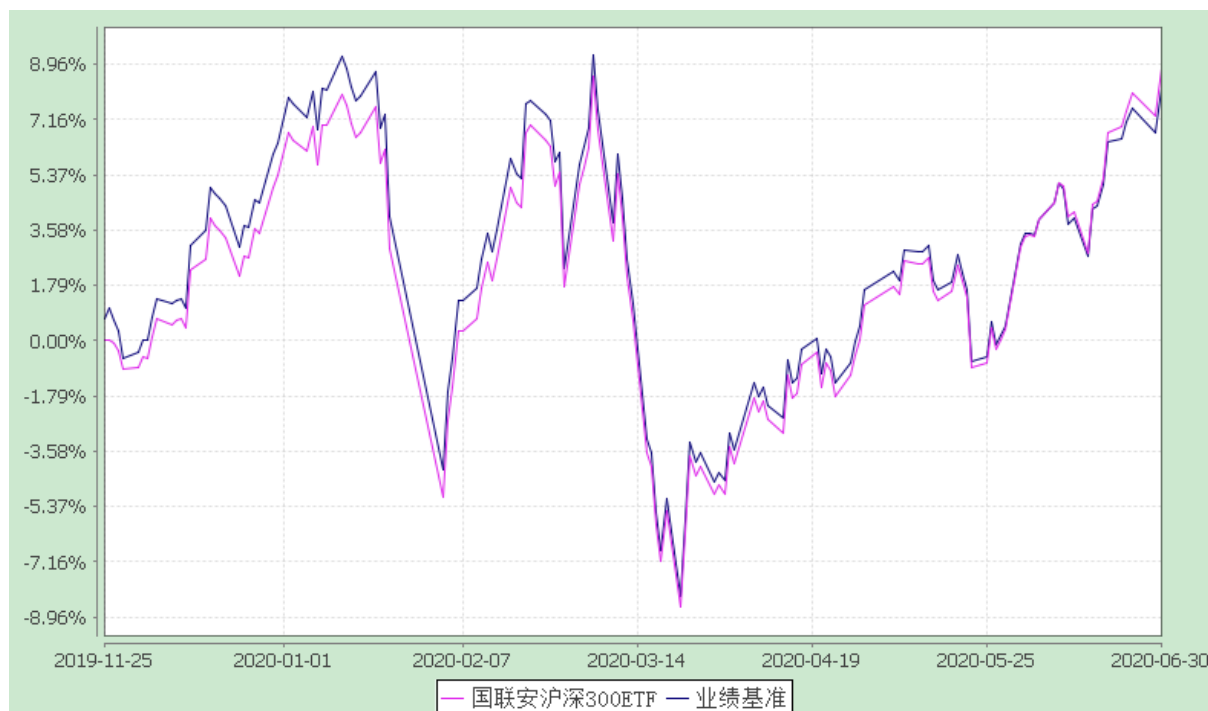
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.42%	0.90%	7.68%	0.90%	0.74%	0.00%
过去三个月	14.15%	0.89%	12.96%	0.90%	1.19%	-0.01%
过去六个月	3.29%	1.51%	1.64%	1.52%	1.65%	-0.01%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	8.80%	1.39%	8.16%	1.41%	0.64%	-0.02%

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

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2019 年 11 月 25 日至 2020 年 6 月 30 日）



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率；

2、本基金基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。建仓期结束距离本报告期末未满一年，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。截至本报告期末，公司共管理五十四只开放式基金。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		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理、国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF) 基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2019-11-25	-	17 年 (自 2002 年起)	黄欣先生，硕士研究生。2003 年 10 月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、债券投资助理、基金经理助理。现任量化投资部总监助理。2010 年 4 月起担任国联安双禧中证 100 指数分级证券投资基金的基金经理，2010 年 5 月至 2012 年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理，2010 年 11 月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2010 年 12 月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2013 年 6 月至 2017 年 3 月兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金的基金经理，2016 年 8 月起兼任国联安中证医药 100 指数证券投资基金和国联安双力中小板综指证券投资基金 (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。

	基金经理。				
章湛元	本基金基金经理、兼任量化投资部总经理。	2020-05-06	-	11 年（自 2009 年起）	章湛元先生，硕士研究生。2008 年 7 月至 2011 年 5 月就职于建信基金管理有限公司任研究员；2011 年 5 月至 2015 年 5 月就职于富国基金管理有限公司任基金经理助理、基金经理；2015 年 5 月至 2019 年 5 月就职于融通基金管理有限公司，历任专户投资经理、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，任量化投资部总经理。2020 年 5 月起担任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

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》、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投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

2020 年上半年，突如其来新冠疫情给人类的生活以及宏观经济带来了巨大的冲击，中美之间的贸易摩擦在疫情爆发的大环境下更是不断升级。经过一季度严格的防疫措施之后，国内开始复工复产，经济逐步向正常水平恢复。国外特别是美国的情况却不令人乐观，受感染人数在不断上升，经济全面重启遥遥无期。A 股在疫情出现后出现大幅的下跌，但是随着疫情在国内被有效抑制，经济出现反弹，第二季度的股市也出现较大幅度的上涨，大小盘股票表现分化较大，小盘股表现相对较好。从整个上半年来看，沪深 300 指数上涨 1.64%，中小板综指上涨 15.14%，创业板综指上涨 27.94%。从板块表现来看，上半年医药、半导体、食品饮料等行业板块表现较好。

本报告期内，本基金始终保持较高的仓位，采用完全复制的方法跟踪沪深 300 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 4.2125 元，本报告期份额净值增长率为 3.29%，同期业绩比较基准收益率为 1.64%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.03%，年化跟踪误差为 0.61%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.20%，以及年化跟踪误差不超过 2.0% 的限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 下半年，新冠疫情、美国特朗普政府的对华政策等因素给全球的宏观经济带来较大的不确定性。但是可以确定的是，由于应对疫情得力，中国率先全面复工复产，A 股资产在全球范围内势必是较好的投资选择。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，量化投资部、研究部、

权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，本基金托管人在对国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——国联安基金管理有限公司在国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国联安基金管理有限公司编制和披露的国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

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：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	22,874,781.58	27,186,941.70
结算备付金		68,143.71	3,680,221.62
存出保证金		157,913.70	67,464.97
交易性金融资产	6.4.7.2	1,933,735,810.21	1,972,051,849.44
其中：股票投资		1,931,933,675.26	1,972,035,249.55
基金投资		-	-
债券投资		1,802,134.95	16,599.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,182,395.81	127,194.81
应收利息	6.4.7.5	3,054.54	14,685.81
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,958,022,099.55	2,003,128,358.35
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		494,426.62	189,096.06
应付托管费		82,404.43	31,516.00
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	6.4.7.7	312,042.28	1,007,093.52
应交税费		5.14	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	1,717,333.49	2,240,110.18
负债合计		2,606,211.96	3,467,815.76
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	1,797,261,810.51	1,898,315,500.51
未分配利润	6.4.7.10	158,154,077.08	101,345,042.08
所有者权益合计		1,955,415,887.59	1,999,660,542.59
负债和所有者权益总计		1,958,022,099.55	2,003,128,358.35

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.2125 元，基金份额总额 464,194,165.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		72,198,936.95
1.利息收入		79,461.06
其中：存款利息收入	6.4.7.11	78,758.62
债券利息收入		702.44
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）		37,567,793.97
其中：股票投资收益	6.4.7.12	16,921,762.81
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	72,399.15
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	20,573,632.01
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	34,152,046.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	399,635.35
减：二、费用		4,534,077.06

1. 管理人报酬		2,918,936.93
2. 托管费		486,489.53
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	771,733.94
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.税金及附加		2.58
7. 其他费用	6.4.7.19	356,914.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		67,664,859.89
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		67,664,859.89

注：本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效；本基金无上年度可比期间数据。

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,898,315,500.51	101,345,042.08	1,999,660,542.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	67,664,859.89	67,664,859.89
三、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）	-101,053,690.00	-10,855,824.89	-111,909,514.89
其中：1.基金申购款	48,784,539.99	-59,895.15	48,724,644.84
2.基金赎回款	-149,838,229.99	-10,795,929.74	-160,634,159.73
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,797,261,810.51	158,154,077.08	1,955,415,887.59

注：本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效；本基金无上年度可比期间数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：魏东，主管会计工作负责人：李柯，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

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1121 号《关于准予国联安沪深 300 交易型开放式指数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《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 500,936,940.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0681 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 500,986,890.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 49,950.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、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)、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)。本基金可以参与融资业务以及通过证券金融公司办理转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]290 号文审核同意，本基金 129,394,165 份基金份额于 2019 年 12 月 24 日在上交所挂牌交易。

本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国联安沪深 300ETF 联接基金”)。国联安沪深 300ETF 联接基金为交易型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外,以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该

限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。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。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达到 1% 以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)及在银行

间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

对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，包括买卖股票的差价收入，股票的股息、红利收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	22,874,781.58
定期存款	-
其他存款	-
合计	22,874,781.58

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,845,985,641.34	1,931,933,675.26	85,948,033.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	1,374,193.49	1,802,134.95
	银行间市场	-	-
	合计	1,374,193.49	1,802,134.95

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,847,359,834.83	1,933,735,810.21	86,375,975.38

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。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	2,280.38
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	30.60
应收债券利息	672.46
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	71.10
合计	3,054.54

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	312,042.28
银行间市场应付交易费用	-
合计	312,042.28

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 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	-
应付替代款	1,452,527.87
应付指数使用费	145,347.68
预提审计费	59,785.60
预提信息披露费	59,672.34
合计	1,717,333.49

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	490,294,165.00	1,898,315,500.51
本期申购	12,600,000.00	48,784,539.99
本期赎回（以“-”号填列）	-38,700,000.00	-149,838,229.99
本期末	464,194,165.00	1,797,261,810.51

注：1、本基金自2019年8月28日至2019年11月19日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币500,936,940.00元，折合为500,936,940.00份基金份额。根据《国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币49,950.00元在本基金成立后，折合为49,950.00份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金交易申购和赎回业务自2019年12月24日起开始办理。

3、根据《国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《国联安基金管理有限公司关于国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，国联安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）以2019年12月3日为折算日对国联安沪深300交易型开放式指数证券投资基金进行了基金份额折算。当日沪深300 指数收盘值为3851.09 点，基金资产净值为498,305,497.49 元，折算前基金份额总额为500,986,890 份，折算前基金份额净值为0.9946 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.25827695，折算后基金份额总额为129,394,165 份，折算后基金份额净值为3.8511 元。折算后的基金份额采取截位法计算保留到整数位。

6.4.7.10 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	-6,057,267.47	107,402,309.55	101,345,042.08
本期利润	33,512,813.32	34,152,046.57	67,664,859.89
本期基金份额交易产生的变动数	-1,685,828.32	-9,169,996.57	-10,855,824.89
其中：基金申购款	84,066.13	-143,961.28	-59,895.15
基金赎回款	-1,769,894.45	-9,026,035.29	-10,795,929.74
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,769,717.53	132,384,359.55	158,154,077.08

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	67,966.74
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	9,117.08
其他	1,674.80
合计	78,758.62

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	19,217,446.21
股票投资收益——赎回差价收入	-2,295,683.40
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	16,921,762.81

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	245,516,978.25
减：卖出股票成本总额	226,299,532.04
买卖股票差价收入	19,217,446.21

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	158,386,384.33
减：现金支付赎回款总额	63,770,323.73
减：赎回股票成本总额	96,911,744.00
赎回差价收入	-2,295,683.40

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	72,399.15
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	72,399.15

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成	447,557.81

交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	375,098.17
减：应收利息总额	60.49
买卖债券差价收入	72,399.15

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	20,573,632.01
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	20,573,632.01

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1.交易性金融资产	34,152,046.57
——股票投资	33,724,105.11
——债券投资	427,941.46
——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	34,152,046.57
----	---------------

注：本报告期内本基金公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为-23.76 元。

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	399,635.35
合计	399,635.35

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	771,733.94
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	771,733.94

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	5,156.06
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行划款手续费	192.00
指数使用费	291,893.68
合计	356,914.08

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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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
国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“国联安沪深 300ETF 联接”)	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的股票交易。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的权证交易。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的债券交易。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。本基金合同于 2019 年 11 月

25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内本基金未有应支付关联方的佣金。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

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 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,918,936.93
其中：支付销售机构的客户维护费	-

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 0.30% 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 × 0.30% / 当年天数。

2、本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	486,489.53

注：1、支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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 × 0.05% / 当年天数。

2、本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内本基金未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内本基金未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本报告期内本基金未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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
国联安沪深 300ETF 联接	333,400,000.00	71.82%	360,000,000.00	73.43%

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 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	22,874,781.58	67,966.74

注：1、本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“中国工商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 2020 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 68,143.71 元。

2、本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内本基金无须作说明的其他关联交易事项。本基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效，本基金无上年度可比期间数据。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020 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	可流通日	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
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股待上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股待上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股待上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股待上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股待上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股待上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股待上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688528	秦川物联	2020-06-19	2020-07-01	新股待上市	11.33	11.33	8,337	94,458.21	94,458.21	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股待上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

688090	瑞松科技	2020-02-07	2020-08-17	新股锁定	27.55	59.45	3,013	83,008.15	179,122.85	-
688312	燕麦科技	2020-05-29	2020-12-08	新股锁定	19.68	41.77	7,390	145,435.20	308,680.30	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股待上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128112	歌尔转 2	2020-06-12	2020-07-13	待上市	100.00	100.00	4,200	419,998.16	419,998.16	-
128114	正邦转债	2020-06-17	2020-07-15	待上市	100.00	100.00	1,123	112,299.02	112,299.02	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，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 2020 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，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 2020 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 0.09%（2019 年 12 月 31 日：0%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。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未超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.05%。

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 2020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							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	22,874,781.58	-	-	-	-	-	22,874,781.58
结算备付金	68,143.71	-	-	-	-	-	68,143.71
存出保证金	157,913.70	-	-	-	-	-	157,913.70
交易性金融资产	-	-	1,802,134.95	-	-	1,931,933,675.26	1,933,735,810.21
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	1,182,395.81	1,182,395.81
应收利息	-	-	-	-	-	3,054.54	3,054.54
应收股利	-	-	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	23,100,838.99	-	1,802,134.95	-	-	1,933,119,125.61	1,958,022,099.55
负债							
其他负债	-	-	-	-	-	1,717,333.49	1,717,333.49
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	494,426.62	494,426.62
应付托管费	-	-	-	-	-	82,404.43	82,404.43
应付交易费用	-	-	-	-	-	312,042.28	312,042.28
应交税费	-	-	-	-	-	5.14	5.14
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	2,606,211.96	2,606,211.96
利率敏感度缺口	23,100,838.99	-	1,802,134.95	-	-	1,930,512,913.65	1,955,415,887.59
上年度末 2019 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							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	27,186,941.70	-	-	-	-	-	27,186,941.70
结算备付金	3,680,221.62	-	-	-	-	-	3,680,221.62
存出保证金	67,464.97	-	-	-	-	-	67,464.97

交易性金融资产	-	-	16,599.89	-	-	1,972,035,249.55	1,972,051,849.44
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	127,194.81	127,194.81
应收利息	-	-	-	-	-	14,685.81	14,685.81
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	30,934,628.29	-	16,599.89	-	-	1,972,177,130.17	2,003,128,358.35
负债							
其他负债	-	-	-	-	-	2,240,110.18	2,240,110.18
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	189,096.06	189,096.06
应付托管费	-	-	-	-	-	31,516.00	31,516.00
应付交易费用	-	-	-	-	-	1,007,093.52	1,007,093.52
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	3,467,815.76	3,467,815.76
利率敏感度缺口	30,934,628.29	-	16,599.89	-	-	1,968,709,314.41	1,999,660,542.59

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 2020 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 0.09%(2019 年 12 月 31 日: 0%), 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(2019 年 12 月 31 日: 同)。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%, 且不低于非现金基金资产的 80%; 每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后, 应当保持不低于交易保证金一倍的现金; 股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外, 本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控, 定期运用多种定量方法对基金进行风险度量, 及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	1,931,933,675. 26	98.80	1,972,035,249 .55	98.62
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,802,134.95	0.09	16,599.89	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,933,735,810. 21	98.89	1,972,051,849 .44	98.62

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

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 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升 5%	增加 96,769,948.56	增加 88,544,614.87
	业绩比较基准下降 5%	减少 96,769,948.56	减少 88,544,614.87

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	1,931,933,675.26	98.67
	其中：股票	1,931,933,675.26	98.67
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,802,134.95	0.09
	其中：债券	1,802,134.95	0.09
	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	22,942,925.29	1.17
8	其他各项资产	1,343,364.05	0.07
9	合计	1,958,022,099.55	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 7.2 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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	28,616,712.00	1.46
B	采矿业	46,549,338.00	2.38
C	制造业	925,411,073.20	47.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,246,449.00	2.01
E	建筑业	38,151,408.00	1.95
F	批发和零售业	19,843,438.10	1.01
G	交通运输、仓储和邮政业	54,180,255.50	2.77
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,201,159.20	4.05
J	金融业	546,346,655.73	27.94
K	房地产业	73,930,713.00	3.78
L	租赁和商务服务业	27,832,502.79	1.42
M	科学研究和技术服务业	12,886,440.00	0.66
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,417,025.00	0.12
Q	卫生和社会工作	23,639,242.50	1.21
R	文化、体育和娱乐业	12,461,893.00	0.64
S	综合	-	-
	合计	1,930,714,305.02	98.74

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,194,506.35	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,097.57	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,219,370.24	0.06

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.3 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投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	1,407,400	100,488,360.00	5.14
2	600519	贵州茅台	66,500	97,281,520.00	4.97
3	600276	恒瑞医药	511,584	47,219,203.20	2.41
4	600036	招商银行	1,342,700	45,275,844.00	2.32
5	000858	五粮液	252,200	43,156,464.00	2.21
6	000333	美的集团	635,148	37,975,498.92	1.94
7	000651	格力电器	627,000	35,469,390.00	1.81
8	002475	立讯精密	543,707	27,919,354.45	1.43
9	600030	中信证券	1,106,800	26,684,948.00	1.36
10	601166	兴业银行	1,620,200	25,566,756.00	1.31
11	600887	伊利股份	789,600	24,580,248.00	1.26
12	000002	万科A	886,800	23,180,952.00	1.19
13	601398	工商银行	4,555,900	22,688,382.00	1.16
14	600900	长江电力	1,145,100	21,688,194.00	1.11
15	601888	中国中免	128,893	19,853,388.79	1.02
16	601328	交通银行	3,573,700	18,333,081.00	0.94
17	300059	东方财富	839,100	16,949,820.00	0.87
18	600585	海螺水泥	312,600	16,539,666.00	0.85
19	000725	京东方A	3,523,600	16,455,212.00	0.84
20	600000	浦发银行	1,526,752	16,153,036.16	0.83
21	000001	平安银行	1,261,000	16,140,800.00	0.83
22	000661	长春高新	36,800	16,019,040.00	0.82
23	603288	海天味业	128,340	15,965,496.00	0.82
24	002714	牧原股份	194,300	15,932,600.00	0.81
25	600016	民生银行	2,768,400	15,696,828.00	0.80
26	002415	海康威视	484,300	14,698,505.00	0.75
27	600031	三一重工	768,300	14,413,308.00	0.74
28	601688	华泰证券	765,500	14,391,400.00	0.74
29	000063	中兴通讯	350,400	14,061,552.00	0.72
30	601012	隆基股份	342,637	13,955,605.01	0.71
31	600048	保利地产	932,200	13,777,916.00	0.70
32	600837	海通证券	1,051,100	13,222,838.00	0.68
33	601668	中国建筑	2,727,000	13,007,790.00	0.67
34	603259	药明康德	133,400	12,886,440.00	0.66
35	300498	温氏股份	581,840	12,684,112.00	0.65
36	601288	农业银行	3,736,700	12,630,046.00	0.65
37	600570	恒生电子	109,264	11,767,732.80	0.60
38	300015	爱尔眼科	262,430	11,402,583.50	0.58
39	601601	中国太保	410,400	11,183,400.00	0.57
40	000100	TCL 科技	1,758,800	10,904,560.00	0.56
41	601229	上海银行	1,294,862	10,747,354.60	0.55

42	300142	沃森生物	199,800	10,461,528.00	0.54
43	002142	宁波银行	389,321	10,227,462.67	0.52
44	600309	万华化学	204,100	10,202,959.00	0.52
45	601211	国泰君安	584,500	10,088,470.00	0.52
46	603986	兆易创新	42,260	9,969,556.60	0.51
47	601988	中国银行	2,740,200	9,535,896.00	0.49
48	002352	顺丰控股	173,800	9,506,860.00	0.49
49	601169	北京银行	1,923,900	9,427,110.00	0.48
50	600588	用友网络	211,994	9,348,935.40	0.48
51	600009	上海机场	127,100	9,160,097.00	0.47
52	601766	中国中车	1,582,100	8,812,297.00	0.45
53	600690	海尔智家	491,000	8,690,700.00	0.44
54	002241	歌尔股份	294,800	8,655,328.00	0.44
55	000568	泸州老窖	94,700	8,629,064.00	0.44
56	000338	潍柴动力	624,702	8,570,911.44	0.44
57	002594	比亚迪	119,100	8,551,380.00	0.44
58	002410	广联达	118,900	8,287,330.00	0.42
59	000876	新希望	275,880	8,221,224.00	0.42
60	300122	智飞生物	81,800	8,192,270.00	0.42
61	600999	招商证券	373,100	8,189,545.00	0.42
62	002304	洋河股份	76,600	8,053,724.00	0.41
63	600703	三安光电	319,500	7,987,500.00	0.41
64	601899	紫金矿业	1,788,200	7,868,080.00	0.40
65	002555	三七互娱	165,900	7,764,120.00	0.40
66	600104	上汽集团	455,600	7,740,644.00	0.40
67	002230	科大讯飞	199,900	7,482,257.00	0.38
68	600745	闻泰科技	59,100	7,443,645.00	0.38
69	002027	分众传媒	1,332,700	7,423,139.00	0.38
70	601818	光大银行	2,069,400	7,408,452.00	0.38
71	002007	华兰生物	141,630	7,097,079.30	0.36
72	300347	泰格医药	69,600	7,090,848.00	0.36
73	300601	康泰生物	43,200	7,005,312.00	0.36
74	600028	中国石化	1,740,400	6,804,964.00	0.35
75	600919	江苏银行	1,199,400	6,800,598.00	0.35
76	001979	招商蛇口	412,000	6,773,280.00	0.35
77	600436	片仔癀	38,300	6,520,575.00	0.33
78	000538	云南白药	67,600	6,341,556.00	0.32
79	600547	山东黄金	170,500	6,243,710.00	0.32
80	601088	中国神华	430,600	6,183,416.00	0.32
81	600406	国电南瑞	300,100	6,077,025.00	0.31
82	300413	芒果超媒	92,000	5,998,400.00	0.31
83	300003	乐普医疗	163,000	5,952,760.00	0.30
84	002371	北方华创	34,700	5,930,577.00	0.30
85	601628	中国人寿	217,600	5,920,896.00	0.30

86	000166	申万宏源	1,172,300	5,920,115.00	0.30
87	000895	双汇发展	127,700	5,885,693.00	0.30
88	600050	中国联通	1,209,500	5,853,980.00	0.30
89	300014	亿纬锂能	121,200	5,799,420.00	0.30
90	600438	通威股份	333,100	5,789,278.00	0.30
91	002271	东方雨虹	142,200	5,777,586.00	0.30
92	601009	南京银行	782,200	5,733,526.00	0.29
93	603160	汇顶科技	25,600	5,706,240.00	0.29
94	002129	中环股份	253,600	5,695,856.00	0.29
95	000938	紫光股份	131,400	5,647,572.00	0.29
96	601939	建设银行	874,600	5,518,726.00	0.28
97	601006	大秦铁路	774,000	5,448,960.00	0.28
98	000776	广发证券	383,100	5,409,372.00	0.28
99	300136	信维通信	100,800	5,344,416.00	0.27
100	002460	赣锋锂业	99,400	5,324,858.00	0.27
101	600196	复星医药	157,300	5,324,605.00	0.27
102	600809	山西汾酒	36,700	5,321,500.00	0.27
103	601390	中国中铁	1,058,400	5,313,168.00	0.27
104	601857	中国石油	1,262,700	5,290,713.00	0.27
105	600019	宝钢股份	1,157,500	5,278,200.00	0.27
106	603019	中科曙光	134,220	5,154,048.00	0.26
107	002044	美年健康	357,100	5,145,811.00	0.26
108	300124	汇川技术	133,841	5,084,619.59	0.26
109	002050	三花智控	232,116	5,083,340.40	0.26
110	000977	浪潮信息	129,600	5,077,728.00	0.26
111	601186	中国铁建	597,400	5,006,212.00	0.26
112	002602	世纪华通	325,600	4,984,936.00	0.25
113	002001	新 和 成	168,900	4,914,990.00	0.25
114	002311	海大集团	102,900	4,897,011.00	0.25
115	600015	华夏银行	799,200	4,891,104.00	0.25
116	603501	韦尔股份	24,200	4,887,190.00	0.25
117	300433	蓝思科技	172,600	4,839,704.00	0.25
118	601336	新华保险	108,200	4,791,096.00	0.25
119	002624	完美世界	82,700	4,766,828.00	0.24
120	601989	中国重工	1,187,300	4,749,200.00	0.24
121	601933	永辉超市	496,900	4,660,922.00	0.24
122	002456	欧菲光	244,800	4,501,872.00	0.23
123	002236	大华股份	232,900	4,474,009.00	0.23
124	600958	东方证券	466,500	4,427,085.00	0.23
125	000157	中联重科	676,200	4,347,966.00	0.22
126	600183	生益科技	147,700	4,323,179.00	0.22
127	600352	浙江龙盛	337,300	4,314,067.00	0.22
128	600741	华域汽车	205,200	4,266,108.00	0.22
129	002024	苏宁易购	482,400	4,230,648.00	0.22

130	601377	兴业证券	609,900	4,177,815.00	0.21
131	601788	光大证券	254,200	4,082,452.00	0.21
132	002008	大族激光	111,800	4,019,210.00	0.21
133	300033	同花顺	30,200	4,019,016.00	0.21
134	600383	金地集团	292,800	4,011,360.00	0.21
135	002463	沪电股份	157,500	3,934,350.00	0.20
136	000860	顺鑫农业	68,900	3,925,922.00	0.20
137	601138	工业富联	258,700	3,919,305.00	0.20
138	600346	恒力石化	276,200	3,866,800.00	0.20
139	601901	方正证券	533,700	3,778,596.00	0.19
140	600660	福耀玻璃	180,800	3,773,296.00	0.19
141	601225	陕西煤业	521,000	3,756,410.00	0.19
142	300408	三环集团	134,339	3,721,190.30	0.19
143	601155	新城控股	118,700	3,708,188.00	0.19
144	002120	韵达股份	150,810	3,687,304.50	0.19
145	600522	中天科技	320,300	3,667,435.00	0.19
146	601877	正泰电器	138,900	3,660,015.00	0.19
147	002736	国信证券	321,100	3,628,430.00	0.19
148	000425	徐工机械	611,700	3,615,147.00	0.18
149	600109	国金证券	315,600	3,600,996.00	0.18
150	600340	华夏幸福	157,100	3,591,306.00	0.18
151	002202	金风科技	359,589	3,585,102.33	0.18
152	300144	宋城演艺	204,200	3,532,660.00	0.18
153	601669	中国电建	992,900	3,435,434.00	0.18
154	603799	华友钴业	88,156	3,425,742.16	0.18
155	000783	长江证券	503,300	3,392,242.00	0.17
156	603993	洛阳钼业	919,200	3,373,464.00	0.17
157	601108	财通证券	328,600	3,368,150.00	0.17
158	601800	中国交建	458,300	3,363,922.00	0.17
159	002916	深南电路	20,040	3,357,100.80	0.17
160	601985	中国核电	809,200	3,309,628.00	0.17
161	601555	东吴证券	403,680	3,294,028.80	0.17
162	600089	特变电工	484,100	3,277,357.00	0.17
163	000069	华侨城 A	535,600	3,245,736.00	0.17
164	600010	包钢股份	2,967,000	3,204,360.00	0.16
165	600867	通化东宝	183,800	3,203,634.00	0.16
166	603369	今世缘	80,000	3,183,200.00	0.16
167	000768	中航飞机	178,300	3,163,042.00	0.16
168	000066	中国长城	230,600	3,043,920.00	0.16
169	002493	荣盛石化	244,900	3,012,270.00	0.15
170	002179	中航光电	73,300	3,006,033.00	0.15
171	600487	亨通光电	179,900	2,952,159.00	0.15
172	600606	绿地控股	475,900	2,941,062.00	0.15
173	603658	安图生物	18,100	2,940,164.00	0.15

174	002841	视源股份	29,475	2,933,352.00	0.15
175	000963	华东医药	114,797	2,904,364.10	0.15
176	600029	南方航空	559,600	2,893,132.00	0.15
177	601100	恒立液压	35,900	2,879,180.00	0.15
178	002157	正邦科技	163,700	2,861,476.00	0.15
179	600795	国电电力	1,534,800	2,839,380.00	0.15
180	600061	国投资本	221,300	2,817,149.00	0.14
181	000625	长安汽车	253,700	2,790,700.00	0.14
182	600893	航发动力	118,300	2,777,684.00	0.14
183	600886	国投电力	353,000	2,774,580.00	0.14
184	600705	中航资本	699,900	2,771,604.00	0.14
185	600926	杭州银行	308,900	2,755,388.00	0.14
186	601607	上海医药	149,900	2,755,162.00	0.14
187	002422	科伦药业	129,500	2,719,500.00	0.14
188	002466	天齐锂业	116,360	2,670,462.00	0.14
189	601066	中信建投	67,600	2,662,088.00	0.14
190	600111	北方稀土	281,900	2,627,308.00	0.13
191	603899	晨光文具	48,100	2,626,260.00	0.13
192	600498	烽火通信	90,600	2,619,246.00	0.13
193	601162	天风证券	431,830	2,616,889.80	0.13
194	600637	东方明珠	267,500	2,581,375.00	0.13
195	601111	中国国航	387,200	2,559,392.00	0.13
196	600176	中国巨石	274,900	2,515,335.00	0.13
197	300628	亿联网络	36,500	2,491,490.00	0.13
198	600115	东方航空	585,000	2,468,700.00	0.13
199	000596	古井贡酒	16,200	2,433,888.00	0.12
200	600332	白云山	74,900	2,421,517.00	0.12
201	600011	华能国际	573,400	2,419,748.00	0.12
202	002607	中公教育	87,100	2,417,025.00	0.12
203	002601	龙蟠佰利	130,600	2,416,100.00	0.12
204	600233	圆通速递	165,700	2,412,592.00	0.12
205	601727	上海电气	476,800	2,403,072.00	0.12
206	601360	三六零	130,300	2,385,793.00	0.12
207	601816	京沪高铁	381,200	2,374,876.00	0.12
208	000786	北新建材	110,600	2,359,098.00	0.12
209	600271	航天信息	144,800	2,351,552.00	0.12
210	601600	中国铝业	849,800	2,345,448.00	0.12
211	601618	中国中冶	930,300	2,335,053.00	0.12
212	600118	中国卫星	75,000	2,312,250.00	0.12
213	000656	金科股份	279,800	2,283,168.00	0.12
214	003816	中国广核	767,500	2,271,800.00	0.12
215	600221	海航控股	1,498,800	2,248,200.00	0.11
216	601838	成都银行	280,200	2,230,392.00	0.11
217	000728	国元证券	263,400	2,212,560.00	0.11

218	600489	中金黄金	240,600	2,199,084.00	0.11
219	601919	中远海控	631,200	2,190,264.00	0.11
220	000703	恒逸石化	238,370	2,176,318.10	0.11
221	600177	雅戈尔	361,800	2,156,328.00	0.11
222	600068	葛洲坝	359,800	2,140,810.00	0.11
223	000961	中南建设	240,300	2,138,670.00	0.11
224	600066	宇通客车	174,400	2,127,680.00	0.11
225	601997	贵阳银行	292,200	2,092,152.00	0.11
226	600390	五矿资本	291,700	2,059,402.00	0.11
227	603833	欧派家居	17,700	2,051,430.00	0.10
228	601998	中信银行	397,800	2,048,670.00	0.10
229	600004	白云机场	133,200	2,029,968.00	0.10
230	600085	同仁堂	73,000	1,979,760.00	0.10
231	002508	老板电器	62,600	1,947,486.00	0.10
232	601881	中国银河	168,900	1,937,283.00	0.10
233	601198	东兴证券	177,500	1,934,750.00	0.10
234	600018	上港集团	451,600	1,896,720.00	0.10
235	600219	南山铝业	934,300	1,896,629.00	0.10
236	002673	西部证券	229,800	1,875,168.00	0.10
237	600516	方大炭素	296,520	1,862,145.60	0.10
238	002146	荣盛发展	228,100	1,847,610.00	0.09
239	601018	宁波港	514,700	1,837,479.00	0.09
240	601231	环旭电子	83,800	1,830,192.00	0.09
241	600998	九州通	97,400	1,813,588.00	0.09
242	600760	中航沈飞	55,000	1,805,100.00	0.09
243	600362	江西铜业	133,600	1,798,256.00	0.09
244	601319	中国人保	278,700	1,794,828.00	0.09
245	600655	豫园股份	202,100	1,790,606.00	0.09
246	002938	鹏鼎控股	35,700	1,787,142.00	0.09
247	600170	上海建工	580,900	1,783,363.00	0.09
248	002773	康弘药业	35,900	1,780,640.00	0.09
249	601117	中国化学	322,200	1,765,656.00	0.09
250	601878	浙商证券	175,100	1,735,241.00	0.09
251	600369	西南证券	368,100	1,689,579.00	0.09
252	600297	广汇汽车	529,200	1,688,148.00	0.09
253	601021	春秋航空	47,500	1,673,900.00	0.09
254	600208	新湖中宝	559,500	1,667,310.00	0.09
255	002739	万达电影	108,700	1,659,849.00	0.08
256	002032	苏泊尔	23,000	1,633,000.00	0.08
257	600674	川投能源	173,400	1,607,418.00	0.08
258	002958	青农商行	361,900	1,603,217.00	0.08
259	002153	石基信息	41,000	1,600,230.00	0.08
260	601658	邮储银行	348,600	1,593,102.00	0.08
261	600038	中直股份	37,400	1,536,018.00	0.08

262	002939	长城证券	122,700	1,511,664.00	0.08
263	600027	华电国际	425,300	1,454,526.00	0.07
264	603156	养元饮品	67,068	1,441,962.00	0.07
265	000671	阳光城	213,900	1,356,126.00	0.07
266	002558	巨人网络	77,200	1,343,280.00	0.07
267	000627	天茂集团	257,400	1,341,054.00	0.07
268	601992	金隅集团	432,100	1,322,226.00	0.07
269	600482	中国动力	83,000	1,303,100.00	0.07
270	600583	海油工程	286,300	1,302,665.00	0.07
271	002468	申通快递	77,900	1,278,339.00	0.07
272	600977	中国电影	96,800	1,270,984.00	0.06
273	600848	上海临港	58,300	1,251,701.00	0.06
274	601633	长城汽车	158,600	1,224,392.00	0.06
275	000709	河钢股份	552,200	1,126,488.00	0.06
276	601216	君正集团	437,700	1,111,758.00	0.06
277	601916	浙商银行	281,000	1,107,140.00	0.06
278	601238	广汽集团	122,200	1,099,800.00	0.06
279	601577	长沙银行	132,055	1,048,516.70	0.05
280	600188	兖州煤业	116,600	1,021,416.00	0.05
281	600398	海澜之家	174,100	1,013,262.00	0.05
282	601236	红塔证券	52,100	1,010,740.00	0.05
283	000723	美锦能源	160,600	1,005,356.00	0.05
284	601808	中海油服	75,100	986,814.00	0.05
285	601698	中国卫通	52,100	938,321.00	0.05
286	600372	中航电子	70,100	933,732.00	0.05
287	600928	西安银行	175,100	921,026.00	0.05
288	601898	中煤能源	236,900	900,220.00	0.05
289	600989	宝丰能源	105,200	885,784.00	0.05
290	600025	华能水电	232,500	881,175.00	0.05
291	000708	中信特钢	45,600	779,304.00	0.04
292	601077	渝农商行	149,400	705,168.00	0.04
293	600968	海油发展	265,400	618,382.00	0.03
294	601828	美凯龙	52,500	555,975.00	0.03
295	603260	合盛硅业	19,700	538,598.00	0.03
296	601298	青岛港	90,400	513,472.00	0.03
297	002945	华林证券	36,700	506,827.00	0.03
298	601212	白银有色	191,900	489,345.00	0.03
299	600299	安迪苏	37,400	457,028.00	0.02

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

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	688312	燕麦科技	7,390.00	308,680.30	0.02
2	688090	瑞松科技	3,013.00	179,122.85	0.01
3	688377	迪威尔	7,894.00	129,619.48	0.01
4	603087	甘李药业	1,076.00	107,922.80	0.01
5	688277	天智航	8,810.00	106,072.40	0.01
6	688027	国盾量子	2,830.00	102,389.40	0.01
7	688528	秦川物联	8,337.00	94,458.21	0.00
8	688600	皖仪科技	5,468.00	84,754.00	0.00
9	300824	北鼎股份	1,954.00	26,789.34	0.00
10	300842	帝科股份	455.00	18,527.60	0.00
11	600956	新天绿能	2,533.00	12,766.32	0.00
12	300839	博汇股份	502.00	11,751.82	0.00
13	300847	中船汉光	1,421.00	9,861.74	0.00
14	300845	捷安高科	470.00	8,286.10	0.00
15	300843	胜蓝股份	751.00	7,517.51	0.00
16	300840	酷特智能	1,185.00	7,038.90	0.00
17	300846	首都在线	1,131.00	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601398	工商银行	27,833,474.00	1.39
2	601601	中国太保	17,814,703.00	0.89
3	600745	闻泰科技	6,996,889.00	0.35
4	300601	康泰生物	6,890,179.00	0.34
5	603986	兆易创新	6,750,782.10	0.34
6	300014	亿纬锂能	5,526,068.00	0.28
7	000977	浪潮信息	5,460,546.00	0.27
8	002129	中环股份	5,249,163.00	0.26
9	002371	北方华创	5,119,496.00	0.26
10	000860	顺鑫农业	4,064,150.00	0.20
11	002463	沪电股份	3,952,353.00	0.20
12	601688	华泰证券	3,420,724.00	0.17
13	002352	顺丰控股	3,306,864.00	0.17
14	603369	今世缘	3,295,110.00	0.16
15	000066	中国长城	3,214,051.00	0.16
16	000002	万科 A	3,171,975.00	0.16
17	600585	海螺水泥	3,115,506.53	0.16

18	603658	安图生物	2,988,290.00	0.15
19	601229	上海银行	2,966,580.00	0.15
20	002157	正邦科技	2,906,106.11	0.15

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	601288	农业银行	22,678,678.00	1.13
2	601318	中国平安	21,810,164.00	1.09
3	601166	兴业银行	6,056,402.00	0.30
4	000858	五粮液	5,450,371.00	0.27
5	000333	美的集团	4,818,437.00	0.24
6	000651	格力电器	4,781,410.00	0.24
7	600016	民生银行	3,695,512.00	0.18
8	688396	华润微	3,407,804.60	0.17
9	002475	立讯精密	3,352,152.00	0.17
10	600519	贵州茅台	3,080,920.00	0.15
11	688266	泽璟制药	2,649,572.43	0.13
12	300017	网宿科技	2,548,115.00	0.13
13	600100	同方股份	2,459,156.00	0.12
14	688169	石头科技	2,418,616.15	0.12
15	300070	碧水源	2,242,489.00	0.11
16	600036	招商银行	2,212,259.00	0.11
17	000423	东阿阿胶	2,198,620.08	0.11
18	000001	平安银行	2,185,696.00	0.11
19	600276	恒瑞医药	2,185,519.00	0.11
20	300024	机器人	2,132,001.00	0.11

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	221,014,885.04
卖出股票的收入（成交）总额	245,516,978.25

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
----	------	------	---------------

1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	1,802,134.95	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,802,134.95	0.09

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	123041	东财转 2	8,419	1,269,837.77	0.06
2	128112	歌尔转 2	4,200	419,998.16	0.02
3	128114	正邦转债	1,123	112,299.02	0.01

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.11.2 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。

7.11.3 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体中除兴业银行和中信证券外，没有出现被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

兴业银行（601166）的发行主体是兴业银行股份有限公司，其沈阳分公司因严重违反审慎经营规则办理票据业务，于 2019 年 10 月 15 日被辽宁银保监局罚款 2250 万元。

中信证券（600030）的发行主体中信证券股份有限公司，因其在保荐上海柏楚电子科技股份有限公司科创板首次公开发行股票申请过程中，对前期问询要求披露的相关内容在招股说明书注册稿（6 月 28 日）中擅自进行了删减，于 2019 年 7 月 16 日被证监会决定采取出具警示函的监督管理措施。本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	157,913.70

2	应收证券清算款	1,182,395.81
3	应收股利	-
4	应收利息	3,054.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,343,364.05

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688312	燕麦科技	308,680.30	0.02	新股锁定
2	688090	瑞松科技	179,122.85	0.01	新股锁定
3	688377	迪威尔	129,619.48	0.01	新股待上市
4	688277	天智航	106,072.40	0.01	新股待上市

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

			比例		比例
2,096	221,466.68	462,711,670.00	99.68%	1,482,495.00	0.32%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国工商银行股份有限公司—国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	333,400,000.00	71.82%
2	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品（保额分红）委托专户	126,944,880.00	27.35%
3	华泰证券股份有限公司	2,366,331.00	0.51%
4	唐颖豪	42,900.00	0.01%
5	赵洪亮	37,600.00	0.01%
6	宋帝恺	35,100.00	0.01%
7	蔡瑞安	30,000.00	0.01%
8	周健	30,000.00	0.01%
9	汤林骏	27,000.00	0.01%
10	刘彩莲	26,300.00	0.01%
11	陈鲁	22,459.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 11 月 25 日）基金份额总额	500,986,890.00
本报告期期初基金份额总额	490,294,165.00
本报告期基金总申购份额	12,600,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	38,700,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	464,194,165.00

1、本基金自 2019 年 8 月 28 日至 2019 年 11 月 19 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 500,936,940.00 元，折合为 500,936,940.00 份基金份额。根据《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 49,950.00 元在本基金成立后，折合为 49,950.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务的公告》的相关规定，本基金交易申购和赎回业务自 2019 年 12 月 24 日起开始办理。

3、根据《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定以及《国联安基金管理有限公司关于国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，国联安基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）以 2019 年 12 月 3 日为折算日对国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金进行了基金份额折算。当日沪深 300 指数收盘值为 3851.09 点，基金资产净值为 498,305,497.49 元，折算前基金份额总额为 500,986,890 份，折算前基金份额净值为 0.9946 元。根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为 0.25827695，折算后基金份额总额为 129,394,165 份，折算后基金份额净值为 3.8511 元。折算后的基金份额采取截位法计算保留到整数位。

10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2020 年 4 月 25 日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，孟朝霞女士不再担任公司总经理职务，由常务副总经理兼投资总监魏东先生代行总经理职务。

2、2020 年 5 月 7 日，基金管理人发布《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告》，章椹元先生担任本基金的基金经理。

3、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金管理人、托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
招商证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	176,228,058.18	39.12%	160,596.47	38.63%	-
平安证券股份有限公司	1	128,428,264.26	28.51%	119,605.79	28.77%	-
中信证券股份有限公司	2	128,043,648.18	28.42%	119,246.72	28.69%	-
光大证券股份有限公司	1	17,835,691.92	3.96%	16,253.87	3.91%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。
- F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 研究报告被基金采纳的情况；
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内新增招商证券深圳席位001103。

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
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	447,557.81	100.00%	-	-	-	-
平安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
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	国联安基金管理有限公司关于调整旗下 ETF 申购赎回结算模式和指数许可使用费收取下限的公告	上海证券报、证券时报、证券日报、指定网站	2020-01-20
2	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要	指定网站、上海证券交易所	2020-01-23

3	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)正文	指定网站、上海证券交易所	2020-01-23
4	国联安基金管理有限公司关于 2020 年春节假期延长期间暂停办理申购、赎回等业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报、指定网站	2020-01-30
5	国联安基金管理有限公司关于旗下在上海证券交易所上市基金增加扩位证券简称的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、上海证券交易所、指定网站	2020-03-16
6	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业证券股份有限公司为基金申购赎回代办券商的公告	规定报刊、规定网站、上海证券交易所	2020-03-26
7	国联安基金管理有限公司 2020 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2020-04-22
8	国联安基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2020-04-25
9	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	规定报刊、规定网站、上海证券交易所	2020-05-07
10	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要	规定网站	2020-05-11
11	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)正文	规定网站	2020-05-11
12	国联安基金管理有限公司关于修订旗下基金基金合同及托管协议的公告	规定报刊、规定网站	2020-05-26
13	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	规定网站	2020-05-26
14	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议	规定网站	2020-05-26
15	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)正文	规定网站	2020-05-29
16	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)摘要	规定网站	2020-05-29

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	2020年01月01日至2020年06月30日	129,021,980.00	0.00	2,077,100.00	126,944,880.00	27.35%

联接基金	1	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	360,000,000.00	51,700,000.00	78,300,000.00	333,400,000.00	71.82%
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>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自 2020 年 4 月 23 日起，孟朝霞女士不再担任公司总经理，由常务副总经理兼投资总监魏东先生代行总经理职务。

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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.epicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二〇年八月三十一日