

# 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2020 年第 4 季度报告

2020 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十二日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 月 21 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 2020 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |   |
|------------|---|
| 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  |
| 报告期末基金份额总额 | 288,694,165.00 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。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       | 1、股票投资策略  |

|        |   |
|--------|---|
|        | <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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值后作出相应的投资决策。</p> <p>4、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券，根据基金资产组合情况可适度进行投资。</p> <p>5、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，追求对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>6、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p> |
| 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。 |
| 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  |

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。

### § 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                                |
|-----------------|------------------------------------|
|                 | (2020 年 10 月 1 日-2020 年 12 月 31 日) |
| 1. 本期已实现收益      | 32,355,672.42                      |
| 2. 本期利润         | 197,750,065.27                     |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.6722                             |
| 4. 期末基金资产净值     | 1,590,079,815.83                   |
| 5. 期末基金份额净值     | 5.5078                             |

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交易基金的各项费用，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 本报告期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 | 净值增长率① | 净值增长率标准差 | 业绩比较基准收益 | 业绩比较基准收益 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|----------|----------|----------|-----|-----|
|    |        |          |          |          |     |     |

|            |        | ②     | 率③     | 率标准差  |       |        |
|------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
|            |        |       |        | ④     |       |        |
| 过去三个月      | 13.99% | 0.97% | 13.60% | 0.99% | 0.39% | -0.02% |
| 过去六个月      | 30.75% | 1.27% | 25.15% | 1.35% | 5.60% | -0.08% |
| 过去一年       | 35.04% | 1.39% | 27.21% | 1.43% | 7.83% | -0.04% |
| 过去三年       | -      | -     | -      | -     | -     | -      |
| 过去五年       | -      | -     | -      | -     | -     | -      |
| 自基金合同生效起至今 | 42.25% | 1.33% | 35.36% | 1.38% | 6.89% | -0.05% |

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  
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 12 月 31 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；  
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、兼任国联安中证 100 指数证券投资基金（LOF）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 | 2019-11-25  | -    | 18 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 月起担任国联安中证 100 指数证券投资基金（LOF）（原国联安双禧中证 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 |

|  |   |  |  |  |  |
|--|---|--|--|--|--|
|  | <p>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</p> |  |  |  | <p>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。</p> |
|--|---|--|--|--|--|

|     |  |            |   |                 |  |
|-----|--|------------|---|-----------------|--|
|     | 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。  |            |   |                 |  |
| 章榭元 | 本基金基金经理、兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 2020-05-06 | - | 12 年（自 2008 年起） | 章榭元先生，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，2020 年 8 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、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<br>理、量<br>化投资<br>部总经<br>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 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有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

#### 4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020 年四季度，扑朔迷离的美国大选基本上告一段落，短期内美国对中国在科技上的打压可能暂时得到一定程度的缓解，但预计长期的态势不会改变。随着北半球冬天的到来，新冠疫情在欧美等地加快了传播速度，经济何时能够恢复正常还充满了未知。国内方面，虽然零星的新冠阳性案例偶尔还会出现，但疫情整体处于可控状态，中国或将成为今年全球范围内唯一一个 GDP 保持正增长的主要经济体，A 股整体保持反弹的趋势，一些国际资本也加大了 A 股资产的配置。随着年底中欧投资协定谈判的完成，预计 2021 年在中欧合作的带领下，全球经济或能出现明显的复苏。

四季度大小盘股表现分化较大，大盘蓝筹股表现较好。整个四季度沪深 300 指数上涨约 13.6%，中小板综指上涨 5.36%，创业板综指上涨 5.38%。

报告期内，国联安沪深 300ETF 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，努力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 5.5078 元，本报告期份额净值增长率为 13.99%，同期业绩比较基准收益率为 13.60%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.03%，年化跟踪误差为 0.58%，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。

#### 4.6 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   | 1,564,997,164.12 | 98.35        |
|    | 其中：股票  | 1,564,997,164.12 | 98.35        |
| 2  | 基金投资   | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资 | 96,999.15        | 0.01         |

|   |                   |                  |        |
|---|-------------------|------------------|--------|
|   | 其中：债券             | 96,999.15        | 0.01   |
|   | 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      | 25,128,215.78    | 1.58   |
| 8 | 其他各项资产            | 1,053,202.05     | 0.07   |
| 9 | 合计                | 1,591,275,581.10 | 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5.2的合计项不含可退替代款估值增值；

2、报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为20,663,855.00元，占基金资产净值的比例为1.30%；

3、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 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 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         | 17,935,744.20  | 1.13         |
| B  | 采矿业              | 34,205,238.80  | 2.15         |
| C  | 制造业              | 817,053,707.54 | 51.38        |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 26,030,925.00  | 1.64         |
| E  | 建筑业              | 23,972,208.00  | 1.51         |
| F  | 批发和零售业           | 11,159,214.32  | 0.70         |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 41,114,610.00  | 2.59         |

|   |                 |                  |       |
|---|-----------------|------------------|-------|
| H | 住宿和餐饮业          | -                | -     |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 48,308,054.95    | 3.04  |
| J | 金融业             | 413,625,899.38   | 26.01 |
| K | 房地产业            | 46,910,632.90    | 2.95  |
| L | 租赁和商务服务业        | 30,001,268.85    | 1.89  |
| M | 科学研究和技术服务业      | 15,744,512.00    | 0.99  |
| 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              | 1,889,994.00     | 0.12  |
| Q | 卫生和社会工作         | 24,012,035.70    | 1.51  |
| R | 文化、体育和娱乐业       | 7,587,842.00     | 0.48  |
| S | 综合              | -                | -     |
|   | 合计              | 1,559,551,887.64 | 98.08 |

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 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别             | 公允价值（元）      | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | -            | -            |
| B  | 采矿业              | -            | -            |
| C  | 制造业              | 3,818,162.39 | 0.24         |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | -            | -            |
| E  | 建筑业              | -            | -            |
| F  | 批发和零售业           | 16,322.72    | 0.00         |
| 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  | 1,522,824.66 | 0.10         |
| J  | 金融业              | -            | -            |
| K  | 房地产业             | 8,975.14     | 0.00         |
| L  | 租赁和商务服务业         | -            | -            |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,649.20    | 0.00         |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | 15,081.10    | 0.00         |
| 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 | 48,261.27    | 0.00 |
| S | 综合        | -            | -    |
|   | 合计        | 5,445,276.48 | 0.34 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

## 5.3 报告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 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  | 600519 | 贵州茅台 | 40,000    | 79,920,000.00 | 5.03         |
| 2  | 601318 | 中国平安 | 860,800   | 74,872,384.00 | 4.71         |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 154,200   | 45,003,270.00 | 2.83         |
| 4  | 600036 | 招商银行 | 983,500   | 43,224,825.00 | 2.72         |
| 5  | 000333 | 美的集团 | 390,648   | 38,455,389.12 | 2.42         |
| 6  | 600276 | 恒瑞医药 | 316,284   | 35,253,014.64 | 2.22         |
| 7  | 601166 | 兴业银行 | 1,155,300 | 24,111,111.00 | 1.52         |
| 8  | 000651 | 格力电器 | 382,400   | 23,685,856.00 | 1.49         |
| 9  | 601888 | 中国中免 | 77,693    | 21,944,387.85 | 1.38         |
| 10 | 600887 | 伊利股份 | 483,400   | 21,448,458.00 | 1.35         |

### 5.3.2 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前五名股票投资明细

| 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  | 688180 | 君实生物 | 29,617.00 | 2,332,338.75 | 0.15         |
| 2  | 688256 | 寒武纪  | 8,962.00  | 1,286,405.48 | 0.08         |
| 3  | 300999 | 金龙鱼  | 6,738.00  | 594,898.02   | 0.04         |
| 4  | 300896 | 爱美客  | 473.00    | 285,389.28   | 0.02         |
| 5  | 688589 | 力合微  | 3,562.00  | 125,845.46   | 0.01         |

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)   | 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） | 96,999.15 | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -         | -            |
| 9  | 其他        | -         | -            |
| 10 | 合计        | 96,999.15 | 0.01         |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 5.5 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

| 序号 | 债券代码   | 债券名称 | 数量(张) | 公允价值(元)   | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1  | 113616 | 韦尔转债 | 970   | 96,999.15 | 0.01         |

#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 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

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 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。

## 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

本基金本报告期末未持有国债期货,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

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货,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招商银行和中信证券外,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)的发行主体兴业银行股份有限公司,因同业投资用途不合规、授信管理不尽职等违法违规事由,于2020年8月31日被中国银保监会福建监管局合计罚没2232.36万元。因在作为永城煤电控股集团有限公司主承销商期间存在涉嫌违反银行间债券市场自律管理规则的行为,于2020年11月18日被中国银行间市场交易商协会启动自律性调查。因作为债务融资工具主承销商,在部分债务融资工具选聘主承销商的投标过程中,中标承销费

率远低于市场正常水平，预估承销费收入远低于其业务开展平均成本，于 2020 年 5 月 15 日被中国银行间市场交易商协会予以警告，并责令整改。福州分行因违规转接清算、银行卡收单外包等违法违规行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行罚没 2469.953 万元。上海分行因同业资金违规用于股权投资、房地产项目等违法违规行为，于 2020 年 7 月 28 日被银保监会上海监管局责令改正并处罚款 450 万元。福州三明分行因为非法交易平台提供条码支付服务等五项违规行为，于 2020 年 6 月 9 日被中国人民银行福州中心支行累计罚没 376.53 万元。

招商银行（600036）的发行主体是招商银行股份有限公司，其福州分行因所收税款延迟划缴国库等违法违规行为，于 2020 年 9 月 7 日被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 163.28 元，并处 303.5 万元罚款。

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 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   | 128,237.06   |
| 2  | 应收证券清算款 | 910,875.01   |
| 3  | 应收股利    | -            |
| 4  | 应收利息    | 14,089.98    |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 1,053,202.05 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末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 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 601318 | 中国平安 | 10,437,600.00  | 0.66         | 转融通融出股票  |
| 2  | 000333 | 美的集团 | 5,118,880.00   | 0.32         | 转融通融出股票  |
| 3  | 000858 | 五粮液  | 5,107,375.00   | 0.32         | 转融通融出股票  |

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1  | 688180 | 君实生物 | 2,332,338.75   | 0.15         | 新股锁定     |
| 2  | 688256 | 寒武纪  | 1,286,405.48   | 0.08         | 新股锁定     |
| 3  | 300999 | 金龙鱼  | 594,898.02     | 0.04         | 新股锁定     |
| 4  | 300896 | 爱美客  | 285,389.28     | 0.02         | 新股锁定     |
| 5  | 688589 | 力合微  | 125,845.46     | 0.01         | 新股锁定     |

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

|              |                |
|--------------|----------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 293,194,165.00 |
| 报告期基金总申购份额   | 11,700,000.00  |
| 减：报告期基金总赎回份额 | 16,200,000.00  |
| 报告期基金拆分变动份额  | -              |
| 本报告期期末基金份额总额 | 288,694,165.00 |

§ 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10月01日至2020年12月31日 | 108,528,180.00 | -             | 7,768,000.00  | 100,760,180.00 | 34.90% |
| 联接基金  | 1              | 2020年10月01日至2020年12月31日 | 179,500,000.00 | 31,500,000.00 | 27,900,000.00 | 183,100,000.00 | 63.42% |
| 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<br/>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<br/>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

## 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](http://www.cpicfunds.com)

国联安基金管理有限公司  
二〇二一年一月二十二日