

国联安中证医药 100 指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	6
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	17
6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	18
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	21
7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	57
9 开放式基金份额变动	57
10 重大事件揭示	58
10.1 基金份额持有人大会决议	58
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	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
10.4 基金投资策略的改变	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
10.8 其他重大事件	60
11 备查文件目录	61
11.1 备查文件目录	61
11.2 存放地点	61
11.3 查阅方式	61

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安中证医药 100 指数证券投资基金	
基金简称	国联安医药 100 指数	
基金主代码	000059	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013 年 8 月 21 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	254,535,163.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安中证医药 100A	国联安中证医药 100C
下属分级基金的交易代码	000059	006569
报告期末下属分级基金的份额总额	171,738,159.32 份	82,797,003.92 份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中证医药 100 指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。</p>
投资策略	<p>本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动式指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，以实现了对中证医药 100 指数的有效跟踪。</p> <p>当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或因其他原因导致无法有效复制和</p>

	跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，并结合合理的投资管理策略等，最终使跟踪误差控制在限定的范围之内。
业绩比较基准	95%×中证医药 100 指数收益率+5%×活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	陆志俊
	联系电话	021-38992888	95559
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		200121	200336
法定代表人		于业明	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国联安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	国联安中证医药 100A	国联安中证医药 100C
本期已实现收益	-819,541.13	-620,345.53
本期利润	-13,286,511.75	-6,747,252.93
加权平均基金份额本期利润	-0.0673	-0.0793
本期加权平均净值利润率	-5.80%	-6.76%
本期基金份额净值增长率	-6.59%	-6.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	国联安中证医药 100A	国联安中证医药 100C
期末可供分配利润	11,392,936.99	6,486,312.83
期末可供分配基金份额利润	0.0663	0.0783
期末基金资产净值	183,131,096.31	89,283,316.75
期末基金份额净值	1.0663	1.0783
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	国联安中证医药 100A	国联安中证医药 100C
基金份额累计净值增长率	63.66%	43.98%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低

数；

4、经中国证监会批准，根据《关于国联安中证医药 100 指数证券投资基金增设 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2018 年 10 月 26 日增设 C 类基金份额，原有的基金份额在增设 C 类基金份额后，全部自动转换为本基金 A 类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安中证医药 100A

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	-4.80%	0.87%	-5.43%	0.88%	0.63%	-0.01%
过去三个月	-8.35%	0.93%	-9.59%	0.95%	1.24%	-0.02%
过去六个月	-6.59%	0.93%	-7.96%	0.95%	1.37%	-0.02%
过去一年	-11.25%	1.30%	-13.01%	1.34%	1.76%	-0.04%
过去三年	-20.58%	1.43%	-30.55%	1.45%	9.97%	-0.02%
自基金合同生效起至今	63.66%	1.55%	55.58%	1.55%	8.08%	0.00%

注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

国联安中证医药 100C

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	-4.83%	0.86%	-5.43%	0.88%	0.60%	-0.02%
过去三个月	-8.44%	0.93%	-9.59%	0.95%	1.15%	-0.02%
过去六个月	-6.77%	0.93%	-7.96%	0.95%	1.19%	-0.02%
过去一年	-11.61%	1.30%	-13.01%	1.34%	-	-
过去三年	-21.53%	1.43%	-30.55%	1.45%	-	-
自基金合同生效起至今	43.98%	1.43%	21.40%	1.46%	22.58%	-0.03%

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

国联安中证医药 100 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

(2013 年 8 月 21 日至 2023 年 6 月 30 日)

国联安中证医药 100A



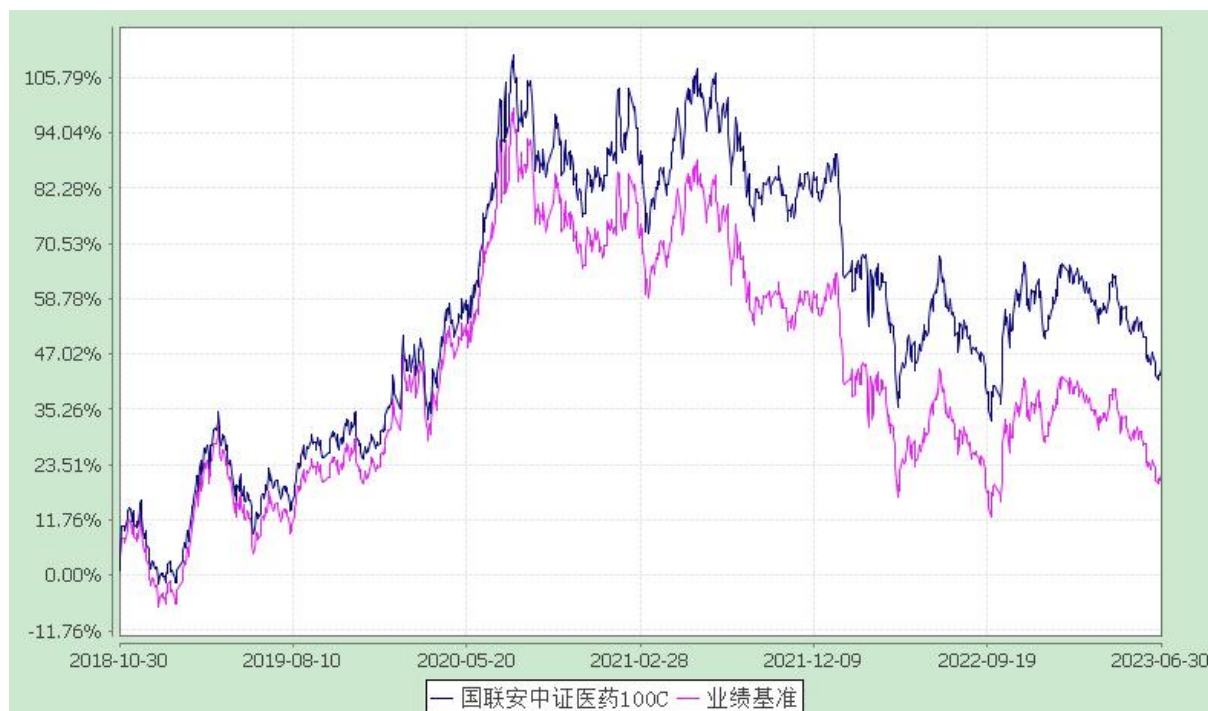
注：1、国联安中证医药 100 指数证券投资基金于 2018 年 10 月 26 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并对本基金基金合同作相应修改，原有的基金份额在开放申购赎回后，全部转换为国联安中证医药 100 指数 A 类份额；

2、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ ；

3、本基金基金合同于 2013 年 8 月 21 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

国联安中证医药 100C



注：1、国联安中证医药 100 指数证券投资基金于 2018 年 10 月 26 日起增加收取销售服务费的 C 类基金份额，并对本基金基金合同作相应修改，原有的基金份额在开放申购赎回后，全部转换为国联安中证医药 100 指数 A 类份额；

2、C 类收费模式的对应基金代码为 006569，自 2018 年 10 月 30 日起开始确认申购份额，因此，国联安中证医药 100 指数 C 类份额的业绩表现自 2018 年 10 月 30 日开始计算；

3、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ ；

4、本基金基金合同于 2013 年 8 月 21 日生效。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；

5、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结

合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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基金经理、国联安中证全指半导体	2016-08-19	-	21 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、量化投资部总监助理等职。2010 年 4 月起担任国联安中证 100 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

	<p>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基金经理、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基金经理、国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理、国联安创</p>				<p>月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2019 年 12 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 5 月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	---

	业板科技 交易型开 放式指数 证券投资 基金基金 经理、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 基金经 理、国联 安国证 ESG300 交易型开 放式指数 证券投资 基金基金 经理、国 联安中证 消费 50 交 易型开放 式指数证 券投资基 金基金经 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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安中证医药 100 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有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初，A 股市场出现了一波上扬，但根据此后的宏观数据来看，人民币兑美元汇率跌破 7，国内制造业 PMI 跌至 48.8%，再度不及预期，在之前的低基数基础上进一步小幅下滑。经济复苏不及预期加上人民币贬值，A 股市场在宏观经济数据不理想的影响之下也出现了一波下调，包括外资在内的一些资金出现流出的迹象。

2023 年上半年，A 股市场整体震荡下行。依据基金合同的约定，本基金始终保持较合理的仓位，采用完全复制的方法跟踪医药 100 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，国联安医药 100 指数 A 的份额净值为 1.0663 元，国联安医药 100 指数 C 的份额净值为 1.0783 元。本报告期内，国联安医药 100 指数 A 的份额净值增长率为-6.59%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%；国联安医药 100 指数 C 的份额净值增长率为-6.77%，同期业绩比较基准收益率为-7.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

俄乌冲突仍在胶着之中，后续全球政治经济局势依旧存在较大的不确定性，短期内投资依然需要注重风险控制。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值委员会,对估值业务总体负责。估值委员会由公司营运总监/副总监(主席/副主席)、运营部、权益投资部、现金管理部、固定收益部、专户投资部、交易部、量化投资部、研究部、监察稽核部和风险管理部部门负责人组成,并根据业务分工履行相应的职责,所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验,参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策,估值决策由估值委员会成员 1/2 以上多数票通过,估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策,公司和基金托管银行有充分沟通,积极商讨达成一致意见;对于估值结果,公司和基金托管银行有详细的核对流程,达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,基金托管人在国联安中证医药 100 指数证券投资基金的托管过程中,严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议,尽职尽责地履行了托管人应尽的义务,不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内,国联安基金管理有限公司在国联安中证医药 100 指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安中证医药 100 指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	19,761,174.96	22,348,239.52
结算备付金		675.83	227.89
存出保证金		34,755.62	8,005.64
交易性金融资产	6.4.7.2	252,075,306.70	268,553,546.90
其中：股票投资		252,075,306.70	268,553,546.90
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		72,164.01	181,779.03
应收股利		-	-
应收申购款		1,163,945.07	275,525.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		273,108,022.19	291,367,324.46
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 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		-	-
应付清算款		-	-

应付赎回款		207,653.77	715,617.63
应付管理人报酬		181,947.78	160,043.20
应付托管费		45,486.98	40,010.81
应付销售服务费		29,174.78	13,387.85
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	229,345.82	354,835.65
负债合计		693,609.13	1,283,895.14
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	254,535,163.24	253,017,810.45
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	17,879,249.82	37,065,618.87
净资产合计		272,414,413.06	290,083,429.32
负债和净资产总计		273,108,022.19	291,367,324.46

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，国联安中证医药 100A 基金份额净值 1.0663 元；国联安中证医药 100C 基金份额净值 1.0783 元。基金份额总额 254,535,163.24 份，其中国联安中证医药 100A 基金份额 171,738,159.32 份，国联安中证医药 100C 基金份额 82,797,003.92 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-18,004,534.13	-28,563,534.14
1.利息收入		88,853.72	63,465.75
其中：存款利息收入	6.4.7.9	88,853.72	63,465.75
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		412,858.56	-6,741,194.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-2,558,491.40	-8,387,357.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-

贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	2,971,349.96	1,646,163.58
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-18,593,878.02	-21,956,867.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	87,631.61	71,062.47
减：二、营业总支出		2,029,230.55	1,308,854.02
1. 管理人报酬		1,307,149.10	843,871.20
2. 托管费		326,787.33	210,967.83
3. 销售服务费		198,482.00	64,916.35
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	196,812.12	189,098.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-20,033,764.68	-29,872,388.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,033,764.68	-29,872,388.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,033,764.68	-29,872,388.16

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国联安中证医药 100 指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	253,017,810.45	-	37,065,618.87	290,083,429.32
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	253,017,810.45	-	37,065,618.87	290,083,429.32

产（基金净值）				2
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,517,352.79	-	-19,186,369.05	-17,669,016.26
（一）、综合收益总额	-	-	-20,033,764.68	-20,033,764.68
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,517,352.79	-	847,395.63	2,364,748.42
其中：1.基金申购款	84,055,525.19	-	13,329,477.03	97,385,002.22
2.基金赎回款	-82,538,172.40	-	-12,482,081.40	-95,020,253.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	254,535,163.24	-	17,879,249.82	272,414,413.06
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	172,448,295.98	-	66,395,405.40	238,843,701.38
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	172,448,295.98	-	66,395,405.40	238,843,701.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	15,798,833.20	-	-27,940,003.67	-12,141,170.47
（一）、综合收益总额	-	-	-29,872,388.16	-29,872,388.16
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	15,798,833.20	-	1,932,384.49	17,731,217.69

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	67,102,216.42	-	12,843,466.73	79,945,683.15
2.基金赎回款	-51,303,383.22	-	-10,911,082.24	-62,214,465.46
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	188,247,129.18	-	38,455,401.73	226,702,530.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：王琤，主管会计工作负责人：叶培智，会计机构负责人：仲晓峰

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国联安中证医药 100 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”)《关于核准国联安中证医药 100 指数证券投资基金募集的批复》(证监许可[2012]1237 文)批准，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》及其配套规则和《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2013 年 8 月 21 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为 414,529,636.08 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》和《国联安中证医药 100 指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、新股、到期日在一年之内的政府债券、债券回购、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金的投资组合比例为：股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计（轧差计算）占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产市值不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产市值不低于股票资产的 90%；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，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准为： $95\% \times \text{中证医药 100 指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率（税后）}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本报告期内本基金无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本报告期内本基金无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本报告期内本基金未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85 号文《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税 [2005] 103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字 [2008] 16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关

工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局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 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2 号文《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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c)基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得,由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起,对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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%计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息、红利所得,由挂牌公司代扣代缴 20%的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额: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,其股息红利所得暂减按 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。

(e)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。

(f)对投资者从证券投资基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

(g)对基金在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税,分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率,计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	19,761,174.96
等于: 本金	19,757,550.93
加: 应计利息	3,624.03
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
合计	19,761,174.96

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	283,505,193.06	-	252,075,306.70	-31,429,886.36
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	283,505,193.06	-	252,075,306.70	-31,429,886.36

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买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	219.35
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	121,622.98

其中：交易所市场	121,622.98
银行间市场	-
应付利息	-
其他	15,763.64
预提审计费	32,232.48
预提信息披露费	59,507.37
合计	229,345.82

注：此处其他列示的是应付指数使用费。

6.4.7.7 实收基金

国联安中证医药100A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	169,469,144.03	169,469,144.03
本期申购	60,965,630.10	60,965,630.10
本期赎回（以“-”号填列）	-58,696,614.81	-58,696,614.81
本期末	171,738,159.32	171,738,159.32

国联安中证医药100C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	83,548,666.42	83,548,666.42
本期申购	23,089,895.09	23,089,895.09
本期赎回（以“-”号填列）	-23,841,557.59	-23,841,557.59
本期末	82,797,003.92	82,797,003.92

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国联安中证医药100A

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	223,494,227.09	-199,515,383.52	23,978,843.57
本期利润	-819,541.13	-12,466,970.62	-13,286,511.75
本期基金份额交易产生的变动数	2,875,180.95	-2,174,575.78	700,605.17
其中：基金申购款	80,422,602.11	-71,308,395.61	9,114,206.50
基金赎回款	-77,547,421.16	69,133,819.83	-8,413,601.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	225,549,866.91	-214,156,929.92	11,392,936.99

国联安中证医药100C

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	68,112,918.59	-55,026,143.29	13,086,775.30
本期利润	-620,345.53	-6,126,907.40	-6,747,252.93
本期基金份额交易产生的变动数	-641,514.97	788,305.43	146,790.46
其中：基金申购款	18,810,538.49	-14,595,267.96	4,215,270.53
基金赎回款	-19,452,053.46	15,383,573.39	-4,068,480.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	66,851,058.09	-60,364,745.26	6,486,312.83

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	87,017.60
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	1,581.41
其他	254.71
合计	88,853.72

注：此处其他列示的是沪深结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	89,687,055.50
减：卖出股票成本总额	91,976,705.58
减：交易费用	268,841.32
买卖股票差价收入	-2,558,491.40

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,971,349.96
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	2,971,349.96

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-18,593,878.02

——股票投资	-18,593,878.02
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-18,593,878.02

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	85,186.94
转换费收入	2,337.60
其他	107.07
合计	87,631.61

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	32,232.48
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
其他费用	104,372.27
银行汇划费用	700.00
合计	196,812.12

注：此处其他费用列示的是指数使用费。

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
太平洋资产管理有限责任公司（“太平洋资管”）	基金管理人的股东
安联集团	基金管理人的股东

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年6月 30日	2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,307,149.10	843,871.20
其中：支付销售机构的客户维护费	395,105.04	177,442.78

注：本基金支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值的 0.80% 年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	326,787.33	210,967.83

注：本基金支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值的 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日的基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安中证医药 100A	国联安中证医药 100C	合计
国联安基金管理有限 公司	-	136,279.99	136,279.99
合计	-	136,279.99	136,279.99
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安中证医药 100A	国联安中证医药100C	合计
国联安基金管理有限 公司	-	5,883.39	5,883.39
合计	-	5,883.39	5,883.39

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；

2、支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计

至每月月底，按月支付。计算公式为：

C 类日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 $\times 0.40\%$ \div 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	19,761,174.96	87,017.60	15,727,395.78	62,476.66

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计算。

本基金通过“交通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 2023 年 6 月 30 日的相关余额为人民币 675.83 元（2022 年 6 月 30 日：37,392.52 元）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配情况。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新股待上市	57.66	57.66	1,538	88,681.08	88,681.08	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股待上市并锁定	57.66	57.66	171	9,859.86	9,859.86	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新股待上市	19.99	19.99	3,948	78,920.52	78,920.52	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新股待上市并锁定	19.99	19.99	439	8,775.61	8,775.61	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新股待上市	39.78	39.78	1,952	77,650.56	77,650.56	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新股待上市	55.00	55.00	1,125	61,875.00	61,875.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新股待上市并锁定	55.00	55.00	126	6,930.00	6,930.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新股待上市	36.90	36.90	1,395	51,475.50	51,475.50	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新股待上市并锁定	36.90	36.90	155	5,719.50	5,719.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新股待上市	25.82	25.82	1,939	50,064.98	50,064.98	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股待上市并锁定	25.82	25.82	216	5,577.12	5,577.12	-

00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月	新股 锁定	9.60	9.41	3,767	36,163 .20	35,447 .47	-
68824 9	晶合 集成	2023-0 4-24	6 个月	新股 锁定	19.86	18.06	1,234	24,507 .24	22,286 .04	-
30129 3	三博 脑科	2023-0 4-25	6 个月	新股 锁定	29.60	71.42	300	8,880. 00	21,426 .00	-
68836 1	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月	新股 锁定	23.60	64.67	303	7,150. 80	19,595 .01	-
68847 2	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月	新股 锁定	11.10	17.04	1,030	11,433 .00	17,551 .20	-
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	新股 锁定	5.69	5.41	3,154	17,946 .26	17,063 .14	-
30132 5	曼恩 斯特	2023-0 5-04	6 个月	新股 锁定	76.80	107.95	155	11,904 .00	16,732 .25	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月	新股 锁定	23.77	42.89	371	8,818. 67	15,912 .19	-
68844 3	智翔 金泰	2023-0 6-13	6 个月	新股 锁定	37.88	29.49	529	20,038 .52	15,600 .21	-
68847 8	晶升 股份	2023-0 4-13	6 个月	新股 锁定	32.52	42.37	358	11,642 .16	15,168 .46	-
68856 2	航天 软件	2023-0 5-15	6 个月	新股 锁定	12.68	22.31	674	8,546. 32	15,036 .94	-
30141 9	阿莱 德	2023-0 2-02	6 个月	新股 锁定	24.80	43.85	330	8,184. 00	14,470 .50	-
30131 7	鑫磊 股份	2023-0 1-12	6 个月	新股 锁定	20.67	26.17	534	11,037 .78	13,974 .78	-
68853 1	日联 科技	2023-0 3-24	6 个月	新股 锁定	152.38	135.97	99	15,085 .62	13,461 .03	-
30139 9	英特 科技	2023-0 5-16	6 个月	新股 锁定	43.99	51.57	257	11,305 .43	13,253 .49	-
68857 6	西山 科技	2023-0 5-30	6 个月	新股 锁定	135.80	120.41	109	14,802 .20	13,124 .69	-
68862 9	华丰 科技	2023-0 6-16	6 个月	新股 锁定	9.26	18.59	678	6,278. 28	12,604 .02	-
30130 7	美利 信	2023-0 4-14	6 个月	新股 锁定	32.34	31.86	376	12,159 .84	11,979 .36	-
30130 3	真兰 仪表	2023-0 2-13	6 个月	新股 锁定	26.80	22.32	529	14,177 .20	11,807 .28	-
30140 8	华人 健康	2023-0 2-22	6 个月	新股 锁定	16.24	16.95	671	10,897 .04	11,373 .45	-
68858 2	芯动 联科	2023-0 6-21	6 个月	新股 锁定	26.74	40.68	277	7,406. 98	11,268 .36	-
68814 6	中船 特气	2023-0 4-13	6 个月	新股 锁定	36.15	38.13	295	10,664 .25	11,248 .35	-

301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股锁定	71.88	92.60	121	8,697.48	11,204.60	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股锁定	32.29	51.12	216	6,974.64	11,041.92	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	121	9,075.00	10,981.96	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股锁定	23.80	32.84	327	7,782.60	10,738.68	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
688352	顾中科技	2023-04-11	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	846	10,236.60	10,211.22	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新股锁定	39.99	36.71	275	10,997.25	10,095.25	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股锁定	21.86	23.85	420	9,181.20	10,017.00	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	685	7,658.30	9,994.15	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新股锁定	58.32	45.36	220	12,830.40	9,979.20	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新股锁定	43.67	53.05	188	8,209.96	9,973.40	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	420	8,891.40	9,870.00	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新股锁定	30.22	25.50	365	11,030.30	9,307.50	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股锁定	14.16	16.21	551	7,802.16	8,931.71	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股锁定	245.56	122.11	49	12,032.44	5,983.39	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6 个月(含)	新股锁定	0.00	122.11	24	0.00	2,930.64	送股
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股锁定	25.25	19.69	452	11,413.00	8,899.88	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股锁定	125.80	118.03	75	9,435.00	8,852.25	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新股锁定	50.00	48.39	181	9,050.00	8,758.59	-
68843	华曙	2023-0	6 个月	新股	26.66	31.50	278	7,411.	8,757.	-

3	高科	4-07		锁定				48	00	
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股锁定	30.26	25.33	342	10,348.92	8,662.86	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股锁定	10.68	12.34	701	7,486.68	8,650.34	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股待上市并锁定	39.78	39.78	217	8,632.26	8,632.26	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股锁定	14.81	13.73	624	9,241.44	8,567.52	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	388	4,609.44	8,155.76	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新股锁定	131.11	53.24	99	12,979.89	5,270.76	-
301322	绿通科技	2023-05-25	1-6 个月(含)	新股锁定	0.00	53.24	50	0.00	2,662.00	送股
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股锁定	24.66	22.51	346	8,532.36	7,788.46	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股锁定	72.50	58.42	132	9,570.00	7,711.44	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股锁定	53.27	40.20	188	10,014.76	7,557.60	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股锁定	39.06	39.36	185	7,226.10	7,281.60	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股锁定	29.99	23.79	306	9,176.94	7,279.74	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股锁定	44.18	25.10	207	9,145.26	5,195.70	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6 个月(含)	新股锁定	0.00	25.10	83	0.00	2,083.30	送股
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
30143	泓淋	2023-0	6 个月	新股	19.99	16.90	408	8,155.	6,895.	-

9	电力	3-10		锁定				92	20	
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股锁定	19.20	25.53	270	5,184.00	6,893.10	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股锁定	6.58	7.58	902	5,935.16	6,837.16	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	185	6,290.00	6,462.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新股锁定	46.13	34.40	187	8,626.31	6,432.80	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股锁定	33.99	29.49	213	7,239.87	6,281.37	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	199	5,030.72	5,944.13	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股锁定	17.55	16.75	348	6,107.40	5,829.00	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股锁定	17.80	17.89	312	5,553.60	5,581.68	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股锁定	73.45	46.64	100	7,345.00	4,664.00	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股锁定	11.66	12.26	300	3,498.00	3,678.00	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	295	3,056.20	3,492.80	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	103	2,876.79	3,402.09	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	125	2,585.00	3,186.25	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	170	2,614.60	2,527.90	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股锁定	25.98	24.53	100	2,598.00	2,453.00	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股锁定	5.00	8.96	1,671	8,355.00	14,972.16	-

注：根据中国证监会和交易所相关规定，证券投资基金参与配售、询价，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 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，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 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，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出

回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	19,761,174.96	-	-	-	-	-	19,761,174.96
结算备付金	675.83	-	-	-	-	-	675.83
存出保证金	34,755.62	-	-	-	-	-	34,755.62
交易性金融资产	-	-	-	-	-	252,075,306.70	252,075,306.70
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	72,164.01	72,164.01
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,163,945.07	1,163,945.07
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	19,796,606.41	-	-	-	-	253,311,415.78	273,108,022.19
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	207,653.77	207,653.77
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	181,947.78	181,947.78
应付托管费	-	-	-	-	-	45,486.98	45,486.98
应付销售服务费	-	-	-	-	-	29,174.78	29,174.78
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	229,345.82	229,345.82
负债总计	-	-	-	-	-	693,609.13	693,609.13

利率敏感度缺口	19,796,606.41	-	-	-	-	252,617,806.65	272,414,413.06
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	22,348,239.52	-	-	-	-	-	22,348,239.52
结算备付金	227.89	-	-	-	-	-	227.89
存出保证金	8,005.64	-	-	-	-	-	8,005.64
交易性金融资产	-	-	-	-	-	268,553,546.90	268,553,546.90
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	181,779.03	181,779.03
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	275,525.48	275,525.48
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	22,356,473.05	-	-	-	-	269,010,851.41	291,367,324.46
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	715,617.63	715,617.63
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	160,043.20	160,043.20
应付托管费	-	-	-	-	-	40,010.81	40,010.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	13,387.85	13,387.85
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	354,835.6	354,835.65

						5	
负债总计	-	-	-	-	-	1,283,895.14	1,283,895.14
利率敏感度缺口	22,356,473.05	-	-	-	-	267,726,956.27	290,083,429.32

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的债券、同业存单和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2022 年 12 月 31 日：0.00%)，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，因而未进行敏感性分析(2022 年 12 月 31 日：同)。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。本基金投资组合中股票的资产市值不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产市值不低于股票资产的 90%；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，应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	252,075,306.70	92.53	268,553,546.90	92.58
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	252,075,306.70	92.53	268,553,546.90	92.58

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 13,368,103.02	增加 14,057,596.88
	业绩比较基准下降 5%	减少 13,368,103.02	减少 14,057,596.88

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	250,829,358.58	267,709,323.28
第二层次	454,161.99	-
第三层次	791,786.13	844,223.62
合计	252,075,306.70	268,553,546.90

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	252,075,306.70	92.30
	其中：股票	252,075,306.70	92.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返	-	-

	售金融资产		
7	银行存款和结算备付金合计	19,761,850.79	7.24
8	其他各项资产	1,270,864.70	0.47
9	合计	273,108,022.19	100.00

注：1、本报告期末本基金未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

2、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末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	193,199,600.26	70.92
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	25,923,004.11	9.52
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	-	-
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	16,631,317.04	6.11
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	14,953,167.16	5.49
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	250,707,088.57	92.03

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.1.2 积极投资期末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	1,144,687.35	0.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	6,053.51	0.00
F	批发和零售业	34,154.83	0.01
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	81,317.81	0.03
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	29,798.48	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	15,332.68	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	21,426.00	0.01

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,368,218.13	0.50

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	600276	恒瑞医药	114,763	5,497,147.70	2.02
2	000963	华东医药	66,432	2,881,155.84	1.06
3	002223	鱼跃医疗	78,706	2,832,628.94	1.04
4	300595	欧普康视	93,108	2,810,930.52	1.03
5	301363	美好医疗	62,983	2,770,622.17	1.02
6	603939	益丰药房	74,785	2,767,045.00	1.02
7	600529	山东药玻	101,400	2,760,108.00	1.01
8	603707	健友股份	202,332	2,731,482.00	1.00
9	603392	万泰生物	40,571	2,708,925.67	0.99
10	603233	大参林	96,604	2,705,878.04	0.99
11	600511	国药股份	69,640	2,705,514.00	0.99
12	000423	东阿阿胶	50,076	2,676,562.20	0.98
13	688050	爱博医疗	12,994	2,668,058.02	0.98
14	603882	金域医学	35,316	2,666,358.00	0.98
15	300676	华大基因	44,400	2,663,556.00	0.98
16	600196	复星医药	86,154	2,662,158.60	0.98
17	688617	惠泰医疗	7,110	2,657,362.50	0.98
18	603087	甘李药业	68,980	2,655,730.00	0.97
19	002007	华兰生物	118,290	2,650,878.90	0.97
20	300244	迪安诊断	102,977	2,639,300.51	0.97
21	300832	新产业	44,730	2,639,070.00	0.97
22	000513	丽珠集团	67,772	2,637,008.52	0.97
23	600161	天坛生物	97,107	2,636,455.05	0.97
24	002044	美年健康	370,471	2,634,048.81	0.97
25	688739	成大生物	79,900	2,633,504.00	0.97
26	300760	迈瑞医疗	8,700	2,608,260.00	0.96

27	600521	华海药业	141,457	2,604,223.37	0.96
28	600079	人福医药	96,568	2,601,541.92	0.95
29	002001	新 和 成	168,517	2,595,161.80	0.95
30	600085	同仁堂	44,869	2,582,659.64	0.95
31	000538	云南白药	49,183	2,581,123.84	0.95
32	300896	爱美客	5,800	2,580,710.00	0.95
33	300009	安科生物	257,752	2,577,520.00	0.95
34	300294	博雅生物	70,900	2,572,252.00	0.94
35	300677	英科医疗	116,670	2,566,740.00	0.94
36	002262	恩华药业	83,100	2,561,973.00	0.94
37	688301	奕瑞科技	9,048	2,555,426.64	0.94
38	688331	荣昌生物	45,765	2,551,398.75	0.94
39	600739	辽宁成大	193,700	2,547,155.00	0.94
40	000739	普洛药业	143,500	2,545,690.00	0.93
41	002399	海普瑞	220,370	2,527,643.90	0.93
42	300003	乐普医疗	111,629	2,523,931.69	0.93
43	688029	南微医学	30,938	2,523,303.28	0.93
44	301301	川宁生物	281,471	2,521,980.16	0.93
45	002422	科伦药业	84,928	2,520,663.04	0.93
46	600566	济川药业	86,681	2,517,216.24	0.92
47	301207	华兰疫苗	75,600	2,514,456.00	0.92
48	600436	片仔癀	8,780	2,514,240.80	0.92
49	601607	上海医药	112,119	2,512,586.79	0.92
50	600062	华润双鹤	144,200	2,511,964.00	0.92
51	002653	海思科	106,400	2,511,040.00	0.92
52	688161	威高骨科	57,969	2,510,637.39	0.92
53	603456	九洲药业	91,538	2,506,310.44	0.92
54	002019	亿帆医药	171,611	2,505,520.60	0.92
55	002727	一心堂	94,700	2,500,080.00	0.92
56	000999	华润三九	41,200	2,499,192.00	0.92
57	300363	博腾股份	83,800	2,479,642.00	0.91
58	000623	吉林敖东	154,377	2,476,207.08	0.91
59	603259	药明康德	39,721	2,475,015.51	0.91
60	603658	安图生物	47,796	2,472,487.08	0.91
61	688276	百克生物	39,490	2,472,074.00	0.91
62	300122	智飞生物	55,759	2,464,547.80	0.90
63	300633	开立医疗	45,100	2,457,950.00	0.90
64	600763	通策医疗	25,354	2,455,788.44	0.90
65	600998	九州通	235,803	2,447,635.14	0.90
66	300142	沃森生物	92,501	2,446,651.45	0.90
67	600056	中国医药	188,300	2,444,134.00	0.90
68	300601	康泰生物	96,169	2,441,730.91	0.90
69	603858	步长制药	118,477	2,439,441.43	0.90
70	600867	通化东宝	233,422	2,436,925.68	0.89

71	688185	康希诺	29,883	2,435,464.50	0.89
72	300357	我武生物	72,214	2,428,556.82	0.89
73	688690	纳微科技	62,500	2,428,125.00	0.89
74	600380	健康元	190,650	2,423,161.50	0.89
75	688105	诺唯赞	79,289	2,417,521.61	0.89
76	603883	老百姓	80,798	2,411,820.30	0.89
77	300725	药石科技	49,800	2,411,814.00	0.89
78	600535	天士力	165,911	2,407,368.61	0.88
79	600332	白云山	75,492	2,406,684.96	0.88
80	688202	美迪西	28,012	2,388,023.00	0.88
81	603127	昭衍新药	58,364	2,387,087.60	0.88
82	688139	海尔生物	46,161	2,375,906.67	0.87
83	688180	君实生物	61,542	2,371,828.68	0.87
84	002603	以岭药业	91,904	2,361,013.76	0.87
85	300026	红日药业	432,700	2,345,234.00	0.86
86	300558	贝达药业	48,764	2,342,134.92	0.86
87	002294	信立泰	74,947	2,337,596.93	0.86
88	002821	凯莱英	19,801	2,333,745.86	0.86
89	300015	爱尔眼科	125,768	2,332,996.40	0.86
90	688520	神州细胞	41,100	2,332,014.00	0.86
91	300482	万孚生物	87,439	2,328,500.57	0.85
92	000661	长春高新	16,562	2,257,400.60	0.83
93	301267	华夏眼科	36,500	2,224,675.00	0.82
94	002432	九安医疗	62,400	2,197,104.00	0.81
95	300529	健帆生物	94,594	2,192,688.92	0.80
96	688298	东方生物	57,852	2,182,177.44	0.80
97	300759	康龙化成	56,530	2,163,968.40	0.79
98	300347	泰格医药	33,098	2,136,144.92	0.78
99	002030	达安基因	179,740	1,792,007.80	0.66

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	688582	芯动联科	2,761.00	127,643.76	0.05
2	301486	致尚科技	1,709.00	98,540.94	0.04
3	301292	海科新源	4,387.00	87,696.13	0.03
4	301488	豪恩汽电	2,169.00	86,282.82	0.03
5	688603	天承科技	1,251.00	68,805.00	0.03
6	301261	恒工精密	1,550.00	57,195.00	0.02
7	301202	朗威股份	2,155.00	55,642.10	0.02
8	001286	陕西能源	3,767.00	35,447.47	0.01
9	688249	晶合集成	1,234.00	22,286.04	0.01

10	301293	三博脑科	300.00	21,426.00	0.01
11	301297	富乐德	927.00	20,866.77	0.01
12	688361	中科飞测	303.00	19,595.01	0.01
13	688472	阿特斯	1,030.00	17,551.20	0.01
14	688469	中芯集成	3,154.00	17,063.14	0.01
15	301325	曼恩斯特	155.00	16,732.25	0.01
16	301358	湖南裕能	371.00	15,912.19	0.01
17	688443	智翔金泰	529.00	15,600.21	0.01
18	688478	晶升股份	358.00	15,168.46	0.01
19	688562	航天软件	674.00	15,036.94	0.01
20	301419	阿莱德	330.00	14,470.50	0.01
21	301317	鑫磊股份	534.00	13,974.78	0.01
22	688531	日联科技	99.00	13,461.03	0.00
23	301399	英特科技	257.00	13,253.49	0.00
24	688576	西山科技	109.00	13,124.69	0.00
25	688629	华丰科技	678.00	12,604.02	0.00
26	301307	美利信	376.00	11,979.36	0.00
27	301303	真兰仪表	529.00	11,807.28	0.00
28	301408	华人健康	671.00	11,373.45	0.00
29	688146	中船特气	295.00	11,248.35	0.00
30	301360	荣旗科技	121.00	11,204.60	0.00
31	301141	中科磁业	262.00	11,184.78	0.00
32	301315	威士顿	216.00	11,041.92	0.00
33	688458	美芯晟	121.00	10,981.96	0.00
34	301382	蜂助手	327.00	10,738.68	0.00
35	301429	森泰股份	499.00	10,488.98	0.00
36	688352	颀中科技	846.00	10,211.22	0.00
37	688484	南芯科技	275.00	10,095.25	0.00
38	688523	航天环宇	420.00	10,017.00	0.00
39	688593	新相微	685.00	9,994.15	0.00
40	301387	光大同创	220.00	9,979.20	0.00
41	688543	国科军工	188.00	9,973.40	0.00
42	688552	航天南湖	420.00	9,870.00	0.00
43	301262	海看股份	365.00	9,307.50	0.00
44	688334	西高院	551.00	8,931.71	0.00
45	688507	索辰科技	73.00	8,914.03	0.00
46	301305	朗坤环境	452.00	8,899.88	0.00
47	688581	安杰思	75.00	8,852.25	0.00
48	301373	凌玮科技	277.00	8,822.45	0.00
49	301357	北方长龙	181.00	8,758.59	0.00
50	688433	华曙高科	278.00	8,757.00	0.00
51	688570	天玛智控	342.00	8,662.86	0.00
52	688620	安凯微	701.00	8,650.34	0.00
53	301332	德尔玛	624.00	8,567.52	0.00

54	688535	华海诚科	161.00	8,248.03	0.00
55	001287	中电港	388.00	8,155.76	0.00
56	301157	华塑科技	150.00	7,939.50	0.00
57	301322	绿通科技	149.00	7,932.76	0.00
58	301376	致欧科技	346.00	7,788.46	0.00
59	301295	美硕科技	215.00	7,755.05	0.00
60	301232	飞沃科技	132.00	7,711.44	0.00
61	301397	溯联股份	188.00	7,557.60	0.00
62	301323	新莱福	185.00	7,281.60	0.00
63	301386	未来电器	306.00	7,279.74	0.00
64	301281	科源制药	290.00	7,279.00	0.00
65	301337	亚华电子	232.00	7,045.84	0.00
66	301428	世纪恒通	229.00	7,007.40	0.00
67	301439	泓淋电力	408.00	6,895.20	0.00
68	688429	时创能源	270.00	6,893.10	0.00
69	601061	中信金属	902.00	6,837.16	0.00
70	301170	锡南科技	185.00	6,462.05	0.00
71	301203	国泰环保	187.00	6,432.80	0.00
72	688479	友车科技	213.00	6,281.37	0.00
73	688631	莱斯信息	199.00	5,944.13	0.00
74	301355	南王科技	348.00	5,829.00	0.00
75	603135	中重科技	312.00	5,581.68	0.00
76	001380	华纬科技	170.00	5,232.60	0.00
77	301345	涛涛车业	100.00	4,664.00	0.00
78	601133	柏诚股份	300.00	3,678.00	0.00
79	601065	江盐集团	295.00	3,492.80	0.00
80	001282	三联锻造	103.00	3,402.09	0.00
81	001328	登康口腔	125.00	3,186.25	0.00
82	001360	南矿集团	170.00	2,527.90	0.00
83	603125	常青科技	100.00	2,453.00	0.00
84	603137	恒尚节能	139.00	2,375.51	0.00
85	001324	长青科技	114.00	2,234.40	0.00
86	001367	海森药业	55.00	2,171.40	0.00
87	603172	万丰股份	122.00	1,967.86	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	688331	荣昌生物	3,030,663.84	1.04
2	688105	诺唯赞	2,818,466.02	0.97
3	301363	美好医疗	2,738,172.27	0.94
4	300633	开立医疗	2,733,827.96	0.94
5	301267	华夏眼科	2,717,499.00	0.94
6	600739	辽宁成大	2,662,112.00	0.92
7	301301	川宁生物	2,627,775.00	0.91
8	688520	神州细胞	2,614,279.08	0.90
9	002262	恩华药业	2,610,569.00	0.90
10	002653	海思科	2,541,214.00	0.88
11	603456	九洲药业	1,592,140.00	0.55
12	688202	美迪西	1,507,447.64	0.52
13	688185	康希诺	1,498,368.52	0.52
14	688298	东方生物	1,329,495.05	0.46
15	603392	万泰生物	1,236,177.00	0.43
16	603707	健友股份	1,078,149.00	0.37
17	300725	药石科技	1,056,412.00	0.36
18	603882	金域医学	1,052,884.00	0.36
19	002603	以岭药业	1,008,187.00	0.35
20	688690	纳微科技	1,002,487.26	0.35

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	600771	广誉远	3,910,269.00	1.35
2	002773	康弘药业	3,765,938.00	1.30
3	000403	派林生物	3,228,835.00	1.11
4	600276	恒瑞医药	2,707,602.00	0.93
5	688016	心脉医疗	2,674,951.57	0.92
6	002901	大博医疗	2,608,778.00	0.90
7	300841	康华生物	2,574,952.00	0.89
8	300630	普利制药	2,464,382.98	0.85
9	301047	义翘神州	2,402,160.00	0.83
10	605507	国邦医药	2,351,979.00	0.81
11	688289	圣湘生物	2,254,820.89	0.78
12	600535	天士力	1,550,353.00	0.53
13	600511	国药股份	1,527,909.00	0.53
14	002422	科伦药业	1,510,173.00	0.52
15	000423	东阿阿胶	1,478,279.00	0.51
16	688617	惠泰医疗	1,425,100.35	0.49

17	002044	美年健康	1,366,613.00	0.47
18	300832	新产业	1,359,346.00	0.47
19	600161	天坛生物	1,207,181.00	0.42
20	600079	人福医药	1,204,095.00	0.42

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	94,092,343.40
卖出股票收入（成交）总额	89,687,055.50

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金利用股指期货流动性好、交易成本低和杠杆操作等特点，通过股指期货就本基金投资组合对标的指数的拟合效果进行及时、有效地调整，并提高投资组合的运作效率等。例如在本基金的建仓期或发生大额净申购时，可运用股指期货有效减少基金组合资产配置与跟踪标的之间的差距；在本基金发生大额净赎回时，可运用股指期货控制基金较大幅度减仓时可能存在的冲击成本，从而确保投资组合对指数跟踪的效果。

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 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 本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏鱼跃医疗设备股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到山西省朔州市市场监管局、镇江市市场监管局的处罚。益丰大药房连锁股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到益阳市赫山区人民法院的处罚。

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。

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	34,755.62
2	应收清算款	72,164.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,163,945.07
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,270,864.70

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	301486	致尚科技	88,681.08	0.04	新股待上市
1	301486	致尚科技	9,859.86	0.00	新股待上市 并锁定
2	301292	海科新源	78,920.52	0.03	新股待上市
2	301292	海科新源	8,775.61	0.00	新股待上市 并锁定
3	301488	豪恩汽电	77,650.56	0.03	新股待上市
3	301488	豪恩汽电	8,632.26	0.00	新股待上市 并锁定
4	688603	天承科技	61,875.00	0.03	新股待上市
4	688603	天承科技	6,930.00	0.00	新股待上市 并锁定
5	688582	芯动联科	11,268.36	0.00	新股锁定

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户 数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
国联安中证医药 100A	29,097	5,902.26	45,379.84	0.03%	171,692,779.48	99.97%
国联安中证医药	7,101	11,659.91	54,400,280.78	65.70%	28,396,723.14	34.30%

100C						
合计	36,198	7,031.75	54,445,660.62	21.39%	200,089,502.62	78.61%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安中证医药 100A	338,185.93	0.20%
	国联安中证医药 100C	7.35	0.00%
	合计	338,193.28	0.13%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国联安中证医药 100A	-
	国联安中证医药 100C	-
	合计	-
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安中证医药 100A	10~50
	国联安中证医药 100C	0
	合计	10~50

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安中证医药 100A	国联安中证医药 100C
基金合同生效日（2013 年 8 月 21 日）基金份额总额	414,529,636.08	-
本报告期期初基金份额总额	169,469,144.03	83,548,666.42
本报告期基金总申购份额	60,965,630.10	23,089,895.09
减：本报告期基金总赎回份额	58,696,614.81	23,841,557.59
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	171,738,159.32	82,797,003.92

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

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
山西证券股份有限公司	1	69,371,698.61	39.64%	63,912.89	39.43%	-
中泰证券股份有限公司	2	66,093,031.53	37.77%	61,550.46	37.97%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	39,543,347.88	22.60%	36,634.67	22.60%	-

东兴证券股份 有限公司	2	-	-	-	-	-
华宝证券股份 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

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

报告期内本基金新增租用山西证券股份有限公司1个交易单元。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华宝证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	国联安中证医药 100 指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	规定网站	2023-01-20
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
3	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加众禄基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-02-08
4	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加新华信通为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-03-24
5	国联安中证医药 100 指数证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站	2023-03-31
6	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	规定报刊	2023-03-31

7	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金财富证券为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-04-13
8	国联安中证医药 100 指数证券投资基金 2023 年 1 季度报告	规定网站	2023-04-22
9	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-22
10	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安中证医药 100 指数证券投资基金增加平安证券为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-05-05
11	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加工商银行作为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-05-18
12	国联安中证医药 100 指数证券投资基金招募说明书更新（2023 年第 1 号）	规定网站	2023-05-18
13	国联安中证医药 100 指数证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2023-05-18
14	国联安中证医药 100 指数证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2023-05-18
15	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加平安银行股份有限公司相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2023-05-29
16	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海证券为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-06-02

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安中证医药 100 指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安中证医药 100 指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安中证医药 100 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

11.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

11.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日