

国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

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	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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
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	58
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	58
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	58
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	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.12 投资组合报告附注	59

8	基金份额持有人信息	60
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
8.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	60
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	61
9	开放式基金份额变动	61
10	重大事件揭示	61
10.1	基金份额持有人大会决议	61
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	61
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
10.4	基金投资策略的改变	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
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	62
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
10.8	其他重大事件	63
11	备查文件目录	64
11.1	备查文件目录	64
11.2	存放地点	64
11.3	查阅方式	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国联安中证 1000 指数增强	
基金主代码	016962	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 5 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	292,947,611.56 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 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016962	016963
报告期末下属分级基金的份额总额	126,612,614.85 份	166,334,996.71 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以中证 1000 指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。正常情况下，本基金力争控制净值增长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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股

及其备选成份股，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	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	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	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 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	2,751,394.07	1,635,298.16
本期利润	1,642,176.88	5,025,892.39
加权平均基金份额本期利润	0.0135	0.0587
本期加权平均净值利润率	1.34%	5.85%
本期基金份额净值增长率	1.16%	1.05%
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 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
期末可供分配利润	489,797.23	434,734.34
期末可供分配基金份额利润	0.0039	0.0026
期末基金资产净值	127,102,412.08	166,769,731.05
期末基金份额净值	1.0039	1.0026
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	国联安中证 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	0.39%	0.26%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安中证 1000 指数增强 A

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	1.92%	0.95%	0.59%	0.99%	1.33%	-0.04%
过去三个月	-1.56%	0.81%	-3.77%	0.87%	2.21%	-0.06%
过去六个月	1.16%	0.73%	4.87%	0.84%	-3.71%	-0.11%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.39%	0.68%	-1.08%	0.84%	1.47%	-0.16%

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 1000 指数增强 C

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	1.90%	0.95%	0.59%	0.99%	1.31%	-0.04%
过去三个月	-1.62%	0.81%	-3.77%	0.87%	2.15%	-0.06%
过去六个月	1.05%	0.73%	4.87%	0.84%	-3.82%	-0.11%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	0.26%	0.68%	-1.08%	0.84%	1.34%	-0.16%

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。

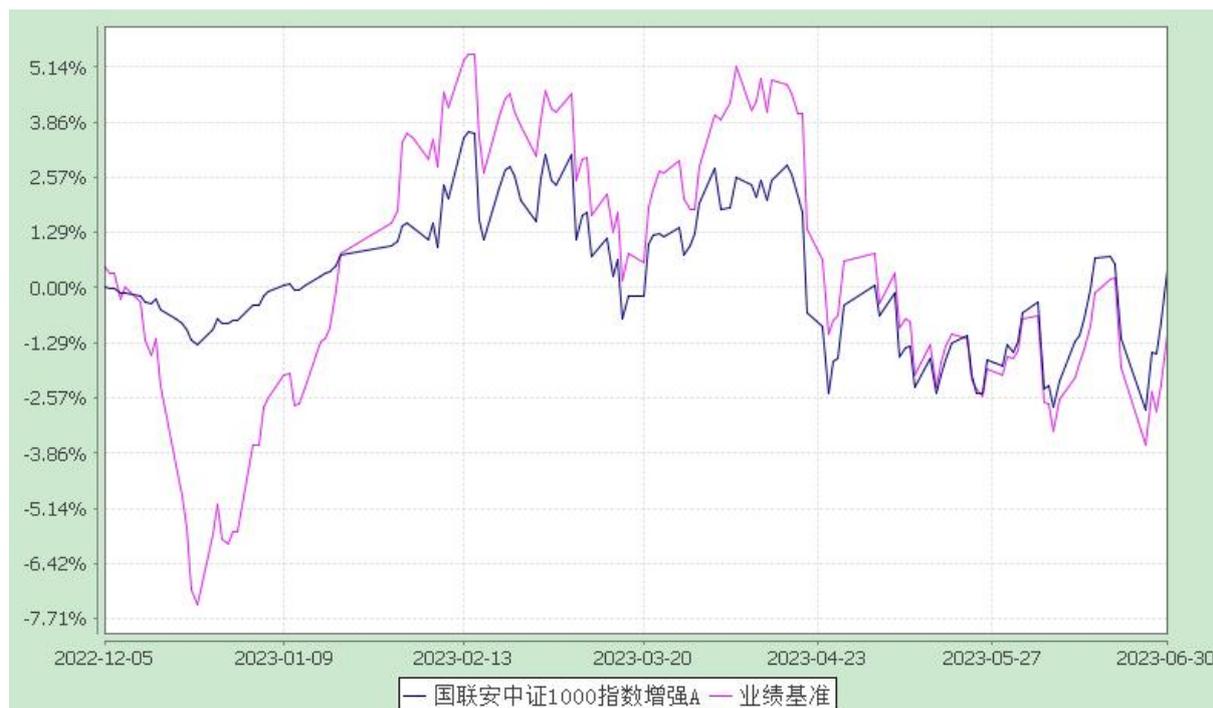
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

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

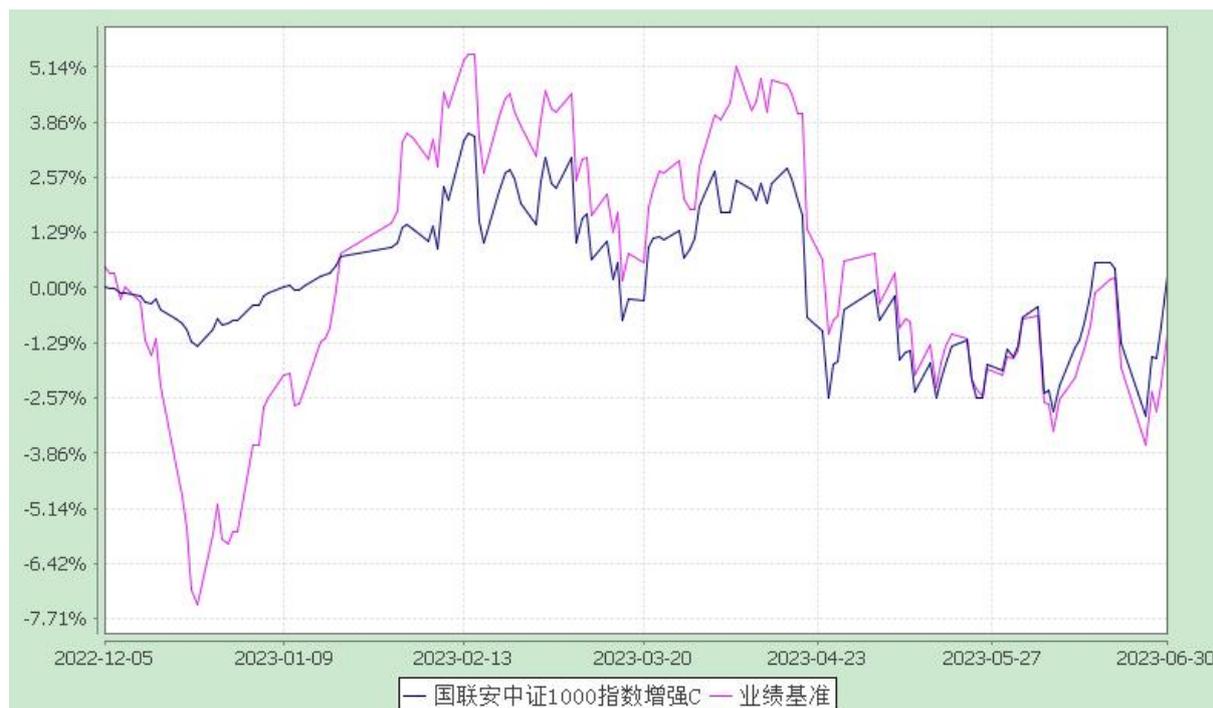
(2022 年 12 月 5 日至 2023 年 6 月 30 日)

国联安中证 1000 指数增强 A



- 注：1、本基金业绩比较基准为中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%；
- 2、本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 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。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，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。

国联安中证 1000 指数增强 C



- 注：1、本基金业绩比较基准为中证 1000 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%；
- 2、本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 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。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，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。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		
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	2022-12-05	-	15 年（自 2008 年起）	章榭元先生，硕士研究生。曾任建信基金管理有限公司任研究员，富国基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，融通基金管理有限公司专户投资经理、基金经理、指数与量化投资部总经理。2019 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，担任量化投资部总经理。2020 年 5 月起担任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 8 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金、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；2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 5 月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 11 月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月起兼任国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证

	<p>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 安新精选 灵活配置 混合型证 券投资基 金基金经 理、国联 安添鑫灵 活配置混 合型证 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</p>				<p>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>
--	--	--	--	--	--

	消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、量化投资部总经理。				
--	------------------------------------	--	--	--	--

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》、《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金合同》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

二季度,市场震荡下行,投资者对于经济复苏的前景仍然处于观望状态。PMI 指数虽然低于 50%,但已经开始逐步上行,表明经济增长预期已逐步好转。人民币贬值短期不利于资产价格,但中长期看对出口会有正贡献。市场目前主要关注点仍然在于经济复苏的程度能否超预期,相信超预期的经济数据会较大提振当前的市场信心。在行业方面,一些质量较高、成长性较强的科技、新兴产业板块仍然值得关注。高科技板块国产替代进程正进入攻坚阶段,有望取得实质性突破。

报告期内,本基金坚持采用定量的投资方式,通过基本面模型选择合适的资产配置比例和个股配置比例,此外通过量化的方式精选基本面优秀上市企业,以期获得超越市场的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末,国联安中证 1000 指数增强 A 的份额净值为 1.0039 元,国联安中证 1000 指数增强 C 的份额净值为 1.0026 元。本报告期内,国联安中证 1000 指数增强 A 的份额净值增长率为 1.16%,同期业绩比较基准收益率为 4.87%;国联安中证 1000 指数增强 C 的份额净值增长率为 1.05%,同期业绩比较基准收益率为 4.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,我们预计经济将继续修复性增长。投资方面,房地产行业有望出台更多的支持政策,助力地产行业投资情绪的恢复。内需仍然是经济增长最重要的支柱,整体经济活动有望进一步恢复,食品饮料等消费行业在业绩数据边际上或大大改善。外需方面,虽然面临欧美贸易政策的限制,但人民币贬值有望使得出口总量有所增加。从资本市场情绪来看,目前市场整体低迷情绪已经进入底部区域,相信任何经济数据的改善和支持政策的出台都有望提振市场信心,使得市场回到上升轨道。目前市场整体的估值已经进入合理配置区间,A 股中长期投资价值已显现。

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 1000 指数增强型证券投资基金托管过程中，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国联安中证 1000 指数增强型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、基金费用开支及利润分配等问题上，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 1000 指数增强型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 1000 指数增强型证券投资基金

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	24,597,692.95	234,604,546.20
结算备付金		1,251,235.94	-
存出保证金		8,218,219.29	10,321,341.55
交易性金融资产	6.4.7.2	248,334,866.05	57,472,589.10
其中：股票投资		248,334,866.05	57,472,589.10
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		16,708,822.27	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		299,110,836.50	302,398,476.85
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		4,922,701.57	-
应付管理人报酬		159,096.08	215,618.47
应付托管费		15,909.62	21,561.85
应付销售服务费		11,485.78	25,086.48
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	129,500.32	13,086.63
负债合计		5,238,693.37	275,353.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	292,947,611.56	304,476,911.97
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	924,531.57	-2,353,788.55
净资产合计		293,872,143.13	302,123,123.42
负债和净资产总计		299,110,836.50	302,398,476.85

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，A 类基金的份额净值 1.0039 元，C 类基金的份额净值 1.0026 元，基金份额总额 292,947,611.56 份，其中 A 类基金的份额总额 126,612,614.85 份，C 类基金的份额总额 166,334,996.71 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

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	
一、营业总收入			8,001,501.80
1.利息收入			275,015.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9		147,483.93
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			127,531.66
证券出借利息收入			-
其他利息收入			-
2.投资收益(损失以“-”填列)			5,443,489.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10		3,808,929.21
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		-668.08
股利收益	6.4.7.13		1,635,227.99
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	2,281,377.04
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	1,620.05
减：二、营业总支出		1,333,432.53
1. 管理人报酬		1,051,881.60
2. 托管费		105,188.13
3. 销售服务费		88,633.91
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	87,728.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,668,069.27
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,668,069.27
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		6,668,069.27

注：本基金于 2022 年 12 月 5 日成立，截至本报告期末本基金成立未满一年，无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

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）	304,476,911.97	-	-2,353,788.55	302,123,123.42

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）	304,476,911.97	-	-2,353,788.55	302,123,123.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-11,529,300.41	-	3,278,320.12	-8,250,980.29
（一）、综合收益总额	-	-	6,668,069.27	6,668,069.27
（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）	-11,529,300.41	-	-3,389,749.15	-14,919,049.56
其中：1.基金申购款	172,583,907.73	-	-765,850.26	171,818,057.47
2.基金赎回款	-184,113,208.14	-	-2,623,898.89	-186,737,107.03
（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）	292,947,611.56	-	924,531.57	293,872,143.13

注：本基金于 2022 年 12 月 5 日成立，截至本报告期末本基金成立未满一年，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：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 1000 指数增强型证券投资基金(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[2022]2355 号《关于准予国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，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《国联安中

证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 304,440,797.10 元，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(2023)第 1013 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 304,476,911.97 基金份额，其中认购资金利息折合 36,114.87 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(以下简称“交通银行”)。

根据《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别的基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》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。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会准予上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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》、

《国联安中证 1000 指数增强型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

本基金中期财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净资产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。

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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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在初始确认时以公允价值计量。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金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

本基金持有的债券投资和资产支持证券投资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资产比例计算的金额。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资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除相关交易费用及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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别/级别的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，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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债券投资和资产支持证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》，根据具体情况采用现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 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

本报告期内本基金无会计政策和会计估计变更，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[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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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 2023 年 6 月 30 日
活期存款	24,597,692.95
等于：本金	24,596,257.61
加：应计利息	1,435.34
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	24,597,692.95

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	248,625,944.18	-	248,334,866.05	-291,078.13
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	248,625,944.18	-	248,334,866.05	-291,078.13

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	25,892,080.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	25,892,080.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2307	IM2307	20.00	26,299,200.00	407,120.00
合计	-	-	-	407,120.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	407,120.00
净额	-	-	-	-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

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

本报告期末本基金无买入返售金融资产。

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

本报告期末本基金无其他资产。

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	28,684.80
预提审计费	37,142.56
预提信息披露费	63,672.96
合计	129,500.32

6.4.7.7 实收基金

国联安中证 1000 指数增强 A

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	127,347,614.96	127,347,614.96
本期申购	34,598,396.23	34,598,396.23
本期赎回（以“-”号填列）	-35,333,396.34	-35,333,396.34
本期末	126,612,614.85	126,612,614.85

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国联安中证 1000 指数增强 C

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	177,129,297.01	177,129,297.01
本期申购	137,985,511.50	137,985,511.50
本期赎回（以“-”号填列）	-148,779,811.80	-148,779,811.80
本期末	166,334,996.71	166,334,996.71

注：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 1000 指数增强 A

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	-68,330.52	-905,666.49	-973,997.01
本期利润	2,751,394.07	-1,109,217.19	1,642,176.88
本期基金份额交易产生的 变动数	395,104.14	-573,486.78	-178,382.64
其中：基金申购款	789,236.10	-501,042.67	288,193.43
基金赎回款	-394,131.96	-72,444.11	-466,576.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,078,167.69	-2,588,370.46	489,797.23

国联安中证 1000 指数增强 C

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	-120,122.86	-1,259,668.68	-1,379,791.54
本期利润	1,635,298.16	3,390,594.23	5,025,892.39
本期基金份额交易产生的变动数	2,317,677.24	-5,529,043.75	-3,211,366.51
其中：基金申购款	2,985,284.55	-4,039,328.24	-1,054,043.69
基金赎回款	-667,607.31	-1,489,715.51	-2,157,322.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,832,852.54	-3,398,118.20	434,734.34

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	102,646.63
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	688.02
其他	44,149.28
合计	147,483.93

注：此处其他列示的是券商保证金利息收入。

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	644,468,805.84
减：卖出股票成本总额	638,707,259.23
减：交易费用	1,952,617.40
买卖股票差价收入	3,808,929.21

6.4.7.11 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-668.08

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	1,635,227.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,635,227.99

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	1,874,257.04
——股票投资	1,874,257.04
——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	407,120.00
——权证投资	-
——期货投资	407,120.00
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	2,281,377.04
----	--------------

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	1,607.77
转换费收入	12.28
合计	1,620.05

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	32,321.17
信息披露费	55,407.72
证券出借违约金	-
合计	87,728.89

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
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

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。本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，无上年度可比期间数据。

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

本报告期内本基金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

本报告期内本基金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

本报告期内本基金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

本报告期内本基金无支付关联方的佣金。

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 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,051,881.60
其中：支付销售机构的客户维护费	254,865.26

注：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 1.00% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，无上年度可比期间数据（下同）。

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
当期发生的基金应支付的托管费	105,188.13

注：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 0.10% 的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 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 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C	合计
国联安基金管理有限公司	-	0.99	0.99
交通银行	-	436.44	436.44
合计	-	437.43	437.43

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国联安基金管理有限公司，再由国联安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

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

本报告期内本基金未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，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

本报告期内本基金未与关联方进行转融通出借业务。本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，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，基金管理人未运用固有资金投资本基金。本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，无上年度可比期间数据（下同）。

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 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	24,597,692.95	102,646.63

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，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购入过由关联方承销的证券。本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，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其他关联交易事项。本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 日生效，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（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
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	130	3,286.40	3,883.10	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股锁定	9.26	18.59	422	3,907.72	7,844.98	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新股锁定	125.88	86.79	44	5,538.72	3,818.76	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股锁定	10.68	12.34	456	4,870.08	5,627.04	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新股待上市并锁定	55.00	55.00	87	4,785.00	4,785.00	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新股待上市	55.00	55.00	782	43,010.00	43,010.00	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	375	4,192.50	5,471.25	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股锁定	26.74	40.68	188	5,027.12	7,647.84	-
688581	安杰	2023-	6 个月	新股	125.80	118.03	43	5,409.40	5,075.29	-

	思	05-12		锁定						
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新股锁定	135.80	120.41	57	7,740.60	6,863.37	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股锁定	30.26	25.33	193	5,840.18	4,888.69	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股锁定	12.68	22.31	378	4,793.04	8,433.18	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	205	4,339.85	4,817.50	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股锁定	21.86	23.85	228	4,984.08	5,437.80	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股锁定	33.99	29.49	111	3,772.89	3,273.39	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股锁定	32.52	42.37	181	5,886.12	7,668.97	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股锁定	11.10	17.04	592	6,571.20	10,087.68	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新股锁定	5.69	5.41	690	3,926.10	3,732.90	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	67	5,025.00	6,080.92	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股锁定	37.88	29.49	304	11,515.52	8,964.96	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股锁定	19.20	25.53	162	3,110.40	4,135.86	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股锁定	23.60	64.67	167	3,941.20	10,799.89	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	433	5,239.30	5,226.31	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股锁定	14.16	16.21	304	4,304.64	4,927.84	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股锁定	19.86	18.06	864	17,159.04	15,603.84	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股锁定	36.15	38.13	159	5,747.85	6,062.67	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	61	889.38	983.93	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股锁定	15.90	17.09	120	1,908.00	2,050.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股锁定	17.80	17.89	168	2,990.40	3,005.52	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股锁定	25.98	24.53	54	1,402.92	1,324.62	-
601133	柏诚	2023-	6 个月	新股	11.66	12.26	148	1,725.68	1,814.48	-

	股份	03-31		锁定						
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	146	1,512.56	1,728.64	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股锁定	6.58	7.58	459	3,020.22	3,479.22	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股待上市并锁定	39.78	39.78	150	5,967.00	5,967.00	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新股待上市	39.78	39.78	1,346	53,543.88	53,543.88	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股待上市并锁定	57.66	57.66	110	6,342.60	6,342.60	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新股待上市	57.66	57.66	985	56,795.10	56,795.10	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股锁定	19.99	16.90	206	4,117.94	3,481.40	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股锁定	26.35	30.60	129	3,399.15	3,947.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股锁定	43.99	51.57	141	6,202.59	7,271.37	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股锁定	53.27	40.20	109	5,806.43	4,381.80	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股锁定	29.99	23.79	155	4,648.45	3,687.45	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股锁定	23.80	32.84	164	3,903.20	5,385.76	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股锁定	24.66	22.51	210	5,178.60	4,727.10	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股锁定	71.88	92.60	67	4,815.96	6,204.20	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新股锁定	50.00	48.39	95	4,750.00	4,597.05	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股锁定	17.55	16.75	243	4,264.65	4,070.25	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股锁定	73.45	46.64	53	3,892.85	2,471.92	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股锁定	32.60	30.37	122	3,977.20	3,705.14	-
301325	曼恩	2023-	6 个月	新股	76.80	107.95	69	5,299.20	7,448.55	-

	斯特	05-04		锁定						
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股锁定	39.06	39.36	100	3,906.00	3,936.00	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股锁定	32.29	51.12	124	4,003.96	6,338.88	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股锁定	32.34	31.86	183	5,918.22	5,830.38	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股锁定	25.25	19.69	251	6,337.75	4,942.19	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新股锁定	37.40	36.07	151	5,647.40	5,446.57	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股锁定	29.60	71.42	167	4,943.20	11,927.14	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新股待上市并锁定	19.99	19.99	292	5,837.08	5,837.08	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新股待上市	19.99	19.99	2,620	52,373.80	52,373.80	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6 个月(含)	新股锁定	-	25.10	48	-	1,204.80	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股锁定	44.18	25.10	121	5,345.78	3,037.10	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新股锁定	30.22	25.50	208	6,285.76	5,304.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新股待上市并锁定	36.90	36.90	102	3,763.80	3,763.80	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新股待上市	36.90	36.90	912	33,652.80	33,652.80	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股锁定	72.50	58.42	74	5,365.00	4,323.08	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新股锁定	46.13	34.40	113	5,212.69	3,887.20	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股待上市并锁定	25.82	25.82	133	3,434.06	3,434.06	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新股待上市	25.82	25.82	1,197	30,906.54	30,906.54	-

301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	100	3,400.00	3,493.00	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股锁定	56.50	52.93	75	4,237.50	3,969.75	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股锁定	41.20	42.69	153	6,303.60	6,531.57	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新股锁定	28.84	30.78	85	2,451.40	2,616.30	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	28	1,245.44	1,105.44	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	89	1,368.82	1,323.43	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	68	1,406.24	1,733.32	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	74	1,397.12	1,450.40	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	192	2,280.96	4,035.84	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	53	1,480.29	1,750.59	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、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。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，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 2023 年 6 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，无抵押债券。

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为 0.00 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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 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%。本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 30%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 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%。

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	24,597,692.95	-	-	-	-	-	24,597,692.95
结算备付金	1,251,235.94	-	-	-	-	-	1,251,235.94
存出保证金	8,218,219.29	-	-	-	-	-	8,218,219.29
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	248,334,866.05	248,334,866.05
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	16,708,822.27	16,708,822.27

资产总计	34,067,148.18	-	-	-	-	265,043,688.32	299,110,836.50
负债							
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,922,701.57	4,922,701.57
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	159,096.08	159,096.08
应付托管费	-	-	-	-	-	15,909.62	15,909.62
应付销售服 务费	-	-	-	-	-	11,485.78	11,485.78
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	129,500.32	129,500.32
负债总计	-	-	-	-	-	5,238,693.37	5,238,693.37
利率敏感度 缺口	34,067,148.18	-	-	-	-	259,804,994.95	293,872,143.13
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	234,604,546.20	-	-	-	-	-	234,604,546.20
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	10,321,341.55	-	-	-	-	-	10,321,341.55
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	57,472,589.10	57,472,589.10
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	244,925,887.75	-	-	-	-	57,472,589.10	302,398,476.85
负债							
卖出回购金 融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人	-	-	-	-	-	215,618.47	215,618.47

报酬							
应付托管费	-	-	-	-	-	21,561.85	21,561.85
应付销售服务费	-	-	-	-	-	25,086.48	25,086.48
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	13,086.63	13,086.63
负债总计	-	-	-	-	-	275,353.43	275,353.43
利率敏感度缺口	244,925,887.75	-	-	-	-	57,197,235.67	302,123,123.42

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 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。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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，本基金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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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 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 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	248,334,866.05	84.50	57,472,589.10	19.02
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	248,334,866.05	84.50	57,472,589.10	19.02

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 11,681,461.02	-
	业绩比较基准下降 5%	减少 11,681,461.02	-

注：于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为 19.02%，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响，所以未进行其他价格风险的敏感性分析。

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：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

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	247,682,679.31	57,472,589.10
第二层次	300,411.66	-
第三层次	351,775.08	-
合计	248,334,866.05	57,472,589.10

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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(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资产和负债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相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

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	248,334,866.05	83.02
	其中：股票	248,334,866.05	83.02
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	25,848,928.89	8.64
8	其他各项资产	24,927,041.56	8.33
9	合计	299,110,836.50	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	1,790,133.00	0.61
B	采矿业	4,519,604.00	1.54
C	制造业	163,396,720.02	55.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,044,486.00	3.08
E	建筑业	2,879,346.00	0.98
F	批发和零售业	10,101,865.10	3.44
G	交通运输、仓储和邮政业	3,791,755.80	1.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	25,710,560.39	8.75
J	金融业	8,568,040.00	2.92
K	房地产业	5,223,164.00	1.78
L	租赁和商务服务业	913,363.00	0.31

M	科学研究和技术服务业	2,667,364.00	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	448,641.00	0.15
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,434,848.00	0.49
R	文化、体育和娱乐业	7,192,789.00	2.45
S	综合	-	-
	合计	247,682,679.31	84.28

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	534,676.61	0.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01
E	建筑业	3,865.28	0.00
F	批发和零售业	12,242.16	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	40,270.85	0.01
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	4,927.84	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,829.39	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	11,927.14	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	652,186.74	0.22

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	600129	太极集团	35,100	2,088,099.00	0.71
2	002402	和而泰	110,100	1,869,498.00	0.64
3	000860	顺鑫农业	55,300	1,863,057.00	0.63
4	688037	芯源微	10,719	1,832,413.05	0.62
5	600100	同方股份	224,000	1,818,880.00	0.62
6	000921	海信家电	66,400	1,789,480.00	0.61
7	600572	康恩贝	255,800	1,752,230.00	0.60
8	603345	安井食品	11,900	1,746,920.00	0.59
9	603368	柳药集团	70,000	1,729,700.00	0.59
10	600583	海油工程	291,100	1,702,935.00	0.58
11	002484	江海股份	79,700	1,696,813.00	0.58
12	600761	安徽合力	84,800	1,690,064.00	0.58
13	603027	千禾味业	78,900	1,666,368.00	0.57
14	300633	开立医疗	30,400	1,656,800.00	0.56
15	600612	老凤祥	23,700	1,656,156.00	0.56
16	000951	中国重汽	96,400	1,624,340.00	0.55
17	300294	博雅生物	44,500	1,614,460.00	0.55
18	600312	平高电气	130,100	1,611,939.00	0.55
19	600456	宝钛股份	47,500	1,607,400.00	0.55
20	002335	科华数据	44,700	1,606,965.00	0.55

21	688106	金宏气体	58,900	1,602,080.00	0.55
22	000028	国药一致	36,610	1,596,562.10	0.54
23	301039	中集车辆	120,400	1,592,892.00	0.54
24	603690	至纯科技	45,700	1,592,188.00	0.54
25	300109	新开源	63,900	1,589,193.00	0.54
26	002212	天融信	163,000	1,581,100.00	0.54
27	002605	姚记科技	34,000	1,578,620.00	0.54
28	601137	博威合金	101,400	1,577,784.00	0.54
29	000811	冰轮环境	99,600	1,569,696.00	0.53
30	600750	江中药业	71,300	1,563,609.00	0.53
31	600483	福能股份	135,300	1,562,715.00	0.53
32	601567	三星医疗	123,700	1,562,331.00	0.53
33	300457	赢合科技	87,700	1,548,782.00	0.53
34	002004	华邦健康	309,700	1,548,500.00	0.53
35	000686	东北证券	222,500	1,544,150.00	0.53
36	605123	派克新材	14,200	1,542,830.00	0.53
37	300638	广和通	67,800	1,537,704.00	0.52
38	300775	三角防务	45,500	1,536,990.00	0.52
39	002727	一心堂	58,200	1,536,480.00	0.52
40	600285	羚锐制药	95,400	1,532,124.00	0.52
41	300855	图南股份	43,260	1,527,943.20	0.52
42	300910	瑞丰新材	30,300	1,524,090.00	0.52
43	600320	振华重工	407,700	1,520,721.00	0.52
44	002737	葵花药业	62,400	1,518,816.00	0.52
45	300693	盛弘股份	41,000	1,513,720.00	0.52
46	601908	京运通	249,900	1,511,895.00	0.51
47	601311	骆驼股份	162,500	1,508,000.00	0.51
48	600064	南京高科	228,100	1,507,741.00	0.51
49	000685	中山公用	198,400	1,501,888.00	0.51
50	601126	四方股份	98,800	1,500,772.00	0.51
51	601369	陕鼓动力	164,500	1,498,595.00	0.51
52	600098	广州发展	241,900	1,494,942.00	0.51
53	600210	紫江企业	281,000	1,494,920.00	0.51
54	002847	盐津铺子	17,500	1,488,375.00	0.51
55	300133	华策影视	209,600	1,486,064.00	0.51
56	600688	上海石化	477,100	1,483,781.00	0.50
57	300674	宇信科技	83,800	1,481,584.00	0.50
58	002158	汉钟精机	59,300	1,480,128.00	0.50
59	601619	嘉泽新能	325,100	1,479,205.00	0.50
60	002611	东方精工	257,600	1,478,624.00	0.50
61	300366	创意信息	119,600	1,478,256.00	0.50
62	600635	大众公用	445,200	1,478,064.00	0.50
63	002233	塔牌集团	191,300	1,476,836.00	0.50
64	000928	中钢国际	153,000	1,476,450.00	0.50

65	002367	康力电梯	161,700	1,476,321.00	0.50
66	600888	新疆众和	186,200	1,474,704.00	0.50
67	002171	楚江新材	206,400	1,469,568.00	0.50
68	600977	中国电影	104,200	1,464,010.00	0.50
69	688676	金盘科技	48,204	1,460,099.16	0.50
70	601519	大智慧	203,500	1,457,060.00	0.50
71	301087	可孚医疗	29,490	1,453,857.00	0.49
72	001696	宗申动力	204,300	1,446,444.00	0.49
73	002215	诺普信	192,300	1,444,173.00	0.49
74	600458	时代新材	120,200	1,441,198.00	0.49
75	600197	伊力特	53,000	1,440,010.00	0.49
76	002258	利尔化学	111,500	1,439,465.00	0.49
77	002967	广电计量	71,600	1,438,444.00	0.49
78	600531	豫光金铅	228,200	1,437,660.00	0.49
79	002851	麦格米特	39,400	1,436,918.00	0.49
80	002612	朗姿股份	60,300	1,433,934.00	0.49
81	300206	理邦仪器	95,000	1,432,600.00	0.49
82	002017	东信和平	109,260	1,432,398.60	0.49
83	300131	英唐智控	272,600	1,431,150.00	0.49
84	002635	安洁科技	103,500	1,428,300.00	0.49
85	600328	中盐化工	158,170	1,423,530.00	0.48
86	600929	雪天盐业	179,100	1,422,054.00	0.48
87	002106	莱宝高科	167,200	1,421,200.00	0.48
88	300143	盈康生命	124,800	1,415,232.00	0.48
89	603328	依顿电子	170,900	1,415,052.00	0.48
90	002254	泰和新材	57,800	1,414,366.00	0.48
91	600971	恒源煤电	180,900	1,409,211.00	0.48
92	002815	崇达技术	113,100	1,408,095.00	0.48
93	603567	珍宝岛	93,900	1,404,744.00	0.48
94	688711	宏微科技	24,074	1,404,477.16	0.48
95	600508	上海能源	95,600	1,403,408.00	0.48
96	600502	安徽建工	265,700	1,402,896.00	0.48
97	002895	川恒股份	71,200	1,402,640.00	0.48
98	600633	浙数文化	86,500	1,402,165.00	0.48
99	002234	民和股份	76,900	1,400,349.00	0.48
100	000990	诚志股份	183,600	1,399,032.00	0.48
101	600783	鲁信创投	108,100	1,397,733.00	0.48
102	603010	万盛股份	128,400	1,395,708.00	0.47
103	002929	润建股份	32,000	1,389,120.00	0.47
104	603871	嘉友国际	88,180	1,385,307.80	0.47
105	600864	哈投股份	270,400	1,381,744.00	0.47
106	300634	彩讯股份	52,300	1,380,720.00	0.47
107	002053	云南能投	122,000	1,368,840.00	0.47
108	688556	高测股份	25,637	1,362,350.18	0.46

109	600073	上海梅林	186,400	1,360,720.00	0.46
110	002139	拓邦股份	104,200	1,359,810.00	0.46
111	688330	宏力达	38,737	1,358,893.96	0.46
112	600007	中国国贸	73,300	1,357,516.00	0.46
113	600639	浦东金桥	109,200	1,355,172.00	0.46
114	300738	奥飞数据	132,700	1,353,540.00	0.46
115	000789	万年青	174,500	1,352,375.00	0.46
116	603881	数据港	59,720	1,349,074.80	0.46
117	300085	银之杰	114,500	1,346,520.00	0.46
118	002987	京北方	61,340	1,344,572.80	0.46
119	000062	深圳华强	117,600	1,342,992.00	0.46
120	002782	可立克	87,800	1,342,462.00	0.46
121	002636	金安国纪	145,300	1,341,119.00	0.46
122	688100	威胜信息	44,973	1,340,645.13	0.46
123	603609	禾丰股份	147,200	1,339,520.00	0.46
124	603989	艾华集团	63,500	1,337,310.00	0.46
125	002746	仙坛股份	169,100	1,332,508.00	0.45
126	601801	皖新传媒	141,900	1,332,441.00	0.45
127	600908	无锡银行	247,300	1,325,528.00	0.45
128	600662	外服控股	229,900	1,315,028.00	0.45
129	688508	芯朋微	22,492	1,304,311.08	0.44
130	002990	盛视科技	35,000	1,288,000.00	0.44
131	003040	楚天龙	71,000	1,287,940.00	0.44
132	001269	欧晶科技	17,500	1,286,775.00	0.44
133	603466	风语筑	92,400	1,284,360.00	0.44
134	688318	财富趋势	12,643	1,263,920.71	0.43
135	002959	小熊电器	15,000	1,252,500.00	0.43
136	603071	物产环能	74,300	1,232,637.00	0.42
137	300416	苏试试验	57,000	1,228,920.00	0.42
138	603103	横店影视	72,700	1,224,268.00	0.42
139	002698	博实股份	69,900	1,222,551.00	0.42
140	300185	通裕重工	423,200	1,180,728.00	0.40
141	002048	宁波华翔	88,000	1,179,200.00	0.40
142	600211	西藏药业	19,800	1,176,120.00	0.40
143	300666	江丰电子	17,200	1,168,912.00	0.40
144	600874	创业环保	199,200	1,167,312.00	0.40
145	600459	贵研铂业	76,100	1,164,330.00	0.40
146	300224	正海磁材	90,400	1,162,544.00	0.40
147	000969	安泰科技	117,000	1,107,990.00	0.38
148	600420	国药现代	98,100	1,107,549.00	0.38
149	688261	东微半导	7,911	1,106,511.57	0.38
150	300777	中简科技	23,300	1,101,158.00	0.37
151	000885	城发环境	82,000	1,091,420.00	0.37
152	002283	天润工业	163,000	1,046,460.00	0.36

153	603636	南威软件	70,600	1,035,702.00	0.35
154	600742	一汽富维	125,800	1,030,302.00	0.35
155	002539	云图控股	113,100	1,015,638.00	0.35
156	002724	海洋王	116,600	1,012,088.00	0.34
157	300377	赢时胜	122,500	992,250.00	0.34
158	603170	宝立食品	46,600	990,716.00	0.34
159	002314	南山控股	296,000	976,800.00	0.33
160	600696	岩石股份	38,800	965,732.00	0.33
161	300319	麦捷科技	111,600	955,296.00	0.33
162	002344	海宁皮城	193,100	913,363.00	0.31
163	601929	吉视传媒	492,100	905,464.00	0.31
164	002174	游族网络	53,300	895,440.00	0.30
165	301095	广立微	10,000	826,500.00	0.28
166	000682	东方电子	80,000	777,600.00	0.26
167	002948	青岛银行	203,400	636,642.00	0.22
168	000627	天茂集团	185,100	555,300.00	0.19
169	300502	新易盛	7,420	504,337.40	0.17
170	000528	柳工	57,800	456,620.00	0.16
171	600323	瀚蓝环境	23,700	448,641.00	0.15
172	300123	亚光科技	58,000	422,240.00	0.14
173	603298	杭叉集团	17,800	419,190.00	0.14
174	601019	山东出版	43,800	401,646.00	0.14
175	002467	二六三	79,600	395,612.00	0.13
176	002276	万马股份	32,500	393,575.00	0.13
177	000735	罗牛山	59,600	389,784.00	0.13
178	603032	德新科技	11,160	385,466.40	0.13
179	002416	爱施德	52,200	385,236.00	0.13
180	002267	陕天然气	45,500	360,360.00	0.12
181	000030	富奥股份	70,600	355,824.00	0.12
182	600618	氯碱化工	39,300	352,521.00	0.12
183	600273	嘉化能源	37,100	349,482.00	0.12
184	000829	天音控股	38,500	348,040.00	0.12
185	605388	均瑶健康	27,300	346,983.00	0.12
186	301367	怡和嘉业	2,300	341,182.00	0.12
187	002446	盛路通信	34,200	323,190.00	0.11
188	000913	钱江摩托	17,400	317,202.00	0.11
189	300226	上海钢联	9,700	314,280.00	0.11
190	300236	上海新阳	7,900	313,235.00	0.11
191	000851	高鸿股份	56,800	308,992.00	0.11
192	300232	洲明科技	32,100	293,394.00	0.10
193	600006	东风汽车	47,100	278,361.00	0.09
194	688019	安集科技	1,672	275,595.76	0.09
195	688128	中国电研	10,579	269,764.50	0.09
196	601222	林洋能源	30,900	253,071.00	0.09

197	688617	惠泰医疗	661	247,048.75	0.08
198	002701	奥瑞金	50,100	225,951.00	0.08
199	600577	精达股份	52,600	221,972.00	0.08
200	300443	金雷股份	6,100	216,245.00	0.07
201	603916	苏博特	15,100	199,924.00	0.07
202	000612	焦作万方	39,600	191,664.00	0.07
203	603719	良品铺子	7,600	190,076.00	0.06
204	603093	南华期货	15,500	168,795.00	0.06
205	601609	金田股份	25,500	165,495.00	0.06
206	002351	漫步者	7,600	157,168.00	0.05
207	002216	三全食品	9,300	144,894.00	0.05
208	688639	华恒生物	1,253	113,371.44	0.04
209	600933	爱柯迪	4,800	111,792.00	0.04
210	300398	飞凯材料	6,300	108,297.00	0.04
211	688366	昊海生科	1,204	101,400.88	0.03
212	000712	锦龙股份	8,100	101,088.00	0.03
213	603187	海容冷链	3,600	71,964.00	0.02
214	300869	康泰医学	3,000	68,880.00	0.02
215	300685	艾德生物	2,800	67,928.00	0.02
216	603013	亚普股份	4,200	65,856.00	0.02
217	300981	中红医疗	4,300	65,145.00	0.02
218	001308	康冠科技	2,300	63,158.00	0.02
219	601515	东风股份	8,200	35,916.00	0.01
220	002389	航天彩虹	1,600	35,536.00	0.01
221	300130	新国都	1,100	31,163.00	0.01
222	688033	天宜上佳	1,599	30,572.88	0.01
223	300352	北信源	5,200	26,208.00	0.01
224	000718	苏宁环球	9,500	25,935.00	0.01
225	301239	普瑞眼科	200	19,616.00	0.01
226	002583	海能达	2,100	12,201.00	0.00
227	000923	河钢资源	300	4,050.00	0.00

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	301486	致尚科技	1,095.00	63,137.70	0.02
2	301488	豪恩汽电	1,496.00	59,510.88	0.02
3	301292	海科新源	2,912.00	58,210.88	0.02
4	688603	天承科技	869.00	47,795.00	0.02
5	301261	恒工精密	1,014.00	37,416.60	0.01
6	001286	陕西能源	3,767.00	35,447.47	0.01
7	301202	朗威股份	1,330.00	34,340.60	0.01

8	688249	晶合集成	864.00	15,603.84	0.01
9	301293	三博脑科	167.00	11,927.14	0.00
10	688361	中科飞测	167.00	10,799.89	0.00
11	688472	阿特斯	592.00	10,087.68	0.00
12	688443	智翔金泰	304.00	8,964.96	0.00
13	688562	航天软件	378.00	8,433.18	0.00
14	688629	华丰科技	422.00	7,844.98	0.00
15	688478	晶升股份	181.00	7,668.97	0.00
16	688582	芯动联科	188.00	7,647.84	0.00
17	301325	曼恩斯特	69.00	7,448.55	0.00
18	301399	英特科技	141.00	7,271.37	0.00
19	688576	西山科技	57.00	6,863.37	0.00
20	301141	中科磁业	153.00	6,531.57	0.00
21	301315	威士顿	124.00	6,338.88	0.00
22	301360	荣旗科技	67.00	6,204.20	0.00
23	688458	美芯晟	67.00	6,080.92	0.00
24	688146	中船特气	159.00	6,062.67	0.00
25	301307	美利信	183.00	5,830.38	0.00
26	688620	安凯微	456.00	5,627.04	0.00
27	688593	新相微	375.00	5,471.25	0.00
28	301295	美硕科技	151.00	5,446.57	0.00
29	688523	航天环宇	228.00	5,437.80	0.00
30	301382	蜂助手	164.00	5,385.76	0.00
31	301262	海看股份	208.00	5,304.00	0.00
32	688352	顾中科技	433.00	5,226.31	0.00
33	688581	安杰思	43.00	5,075.29	0.00
34	301305	朗坤环境	251.00	4,942.19	0.00
35	688334	西高院	304.00	4,927.84	0.00
36	688570	天玛智控	193.00	4,888.69	0.00
37	688552	航天南湖	205.00	4,817.50	0.00
38	301376	致欧科技	210.00	4,727.10	0.00
39	301357	北方长龙	95.00	4,597.05	0.00
40	301397	溯联股份	109.00	4,381.80	0.00
41	301232	飞沃科技	74.00	4,323.08	0.00
42	301281	科源制药	169.00	4,241.90	0.00
43	688429	时创能源	162.00	4,135.86	0.00
44	301355	南王科技	243.00	4,070.25	0.00
45	001287	中电港	192.00	4,035.84	0.00
46	301157	华塑科技	75.00	3,969.75	0.00
47	301428	世纪恒通	129.00	3,947.40	0.00
48	301323	新莱福	100.00	3,936.00	0.00
49	301203	国泰环保	113.00	3,887.20	0.00
50	688631	莱斯信息	130.00	3,883.10	0.00
51	688623	双元科技	44.00	3,818.76	0.00

52	688469	中芯集成	690.00	3,732.90	0.00
53	301337	亚华电子	122.00	3,705.14	0.00
54	301386	未来电器	155.00	3,687.45	0.00
55	301170	锡南科技	100.00	3,493.00	0.00
56	301439	泓淋电力	206.00	3,481.40	0.00
57	601061	中信金属	459.00	3,479.22	0.00
58	688479	友车科技	111.00	3,273.39	0.00
59	603135	中重科技	168.00	3,005.52	0.00
60	001380	华纬科技	85.00	2,616.30	0.00
61	301345	涛涛车业	53.00	2,471.92	0.00
62	603137	恒尚节能	120.00	2,050.80	0.00
63	601133	柏诚股份	148.00	1,814.48	0.00
64	001282	三联锻造	53.00	1,750.59	0.00
65	001328	登康口腔	68.00	1,733.32	0.00
66	601065	江盐集团	146.00	1,728.64	0.00
67	001324	长青科技	74.00	1,450.40	0.00
68	603125	常青科技	54.00	1,324.62	0.00
69	001360	南矿集团	89.00	1,323.43	0.00
70	001367	海森药业	28.00	1,105.44	0.00
71	603172	万丰股份	61.00	983.93	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	300487	蓝晓科技	6,489,571.00	2.15
2	300633	开立医疗	5,310,234.00	1.76
3	300855	图南股份	4,691,485.00	1.55
4	688037	芯源微	4,475,465.74	1.48
5	600320	振华重工	4,363,290.00	1.44
6	002847	盐津铺子	4,283,639.00	1.42
7	000423	东阿阿胶	4,054,302.00	1.34
8	600483	福能股份	4,031,449.00	1.33
9	002262	恩华药业	3,970,795.00	1.31
10	300133	华策影视	3,914,247.00	1.30
11	600100	同方股份	3,846,541.00	1.27
12	600285	羚锐制药	3,792,220.00	1.26
13	301039	中集车辆	3,756,605.00	1.24

14	300109	新开源	3,752,496.00	1.24
15	002139	拓邦股份	3,698,522.00	1.22
16	300634	彩讯股份	3,665,860.05	1.21
17	000811	冰轮环境	3,662,808.00	1.21
18	002126	银轮股份	3,556,977.00	1.18
19	601929	吉视传媒	3,525,713.00	1.17
20	603328	依顿电子	3,510,100.00	1.16

7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300487	蓝晓科技	6,640,881.89	2.20
2	000423	东阿阿胶	4,163,700.00	1.38
3	002262	恩华药业	4,044,696.00	1.34
4	300633	开立医疗	4,001,554.45	1.32
5	601375	中原证券	3,896,098.00	1.29
6	688019	安集科技	3,699,946.98	1.22
7	002126	银轮股份	3,475,936.00	1.15
8	300855	图南股份	3,406,458.00	1.13
9	600320	振华重工	3,397,658.00	1.12
10	600363	联创光电	3,371,468.00	1.12
11	002847	盐津铺子	3,309,003.00	1.10
12	000933	神火股份	3,249,044.00	1.08
13	300685	艾德生物	3,183,882.00	1.05
14	300634	彩讯股份	3,119,240.00	1.03
15	000036	华联控股	3,062,469.00	1.01
16	601827	三峰环境	3,052,938.00	1.01
17	002139	拓邦股份	2,983,779.00	0.99
18	688037	芯源微	2,978,995.24	0.99
19	001308	康冠科技	2,964,750.00	0.98
20	002733	雄韬股份	2,951,527.75	0.98

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	827,695,279.14
卖出股票收入（成交）总额	644,468,805.84

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

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的股指期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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，重庆太极实业(集团)股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆市涪陵区林业局的处罚。同方股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所上市公司管理一部、北京市海淀区人民法院的处罚。广西柳药集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广西壮族自治区药品监督管理局的处罚。

本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，除上述主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

本基金管理人在严格遵守法律法规、本基金《基金合同》和公司管理制度的前提下履行了相关的投资决策程序，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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	8,218,219.29
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	16,708,822.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	24,927,041.56

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

本报告期末本基金前十名指数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	63,137.70	0.02	新股待上市
2	301488	豪恩汽电	53,543.88	0.02	新股待上市
2	301488	豪恩汽电	5,967.00	0.00	新股待上市 并锁定
3	301292	海科新源	58,210.88	0.02	新股待上市
4	688603	天承科技	47,795.00	0.02	新股待上市
5	301261	恒工精密	37,416.60	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

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 1000 指数增强 A	549	230,624.07	94,799,148.73	74.87%	31,813,466.12	25.13%
国联安中证 1000 指数增强 C	1,462	113,772.23	5,169,371.82	3.11%	161,165,624.89	96.89%
合计	2,011	145,672.61	99,968,520.55	34.13%	192,979,091.01	65.87%

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 1000 指数增强 A	168,752.11	0.13%
	国联安中证 1000 指数增强 C	40,018.80	0.02%
	合计	208,770.91	0.07%

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 1000 指数增强 A	10~50
	国联安中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安中证 1000 指数增强 A	10~50
	国联安中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安中证 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 12 月 5 日）基金份额总额	127,347,614.96	177,129,297.01
本报告期期初基金份额总额	127,347,614.96	177,129,297.01
本报告期基金总申购份额	34,598,396.23	137,985,511.50
减：本报告期基金总赎回份额	35,333,396.34	148,779,811.80
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	126,612,614.85	166,334,996.71

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	
西南证券股份有限公司	2	1,468,379,614.27	100.00%	1,198,522.56	100.00%	-

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

报告期内本基金租用证券公司交易单元无变更。

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
西南证券股份有限公司	-	-	600,000,000.00	100.00%	-	-

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 1000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务公告	规定报刊、规定网站	2023-02-02
2	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金参与西南证券相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2023-02-03
3	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
4	国联安中证 1000 指数增强型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
5	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2023-05-18
6	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2023-05-18
7	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加伯嘉基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-05-26
8	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

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 1000 指数增强型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安中证 1000 指数增强型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