

国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）
(原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资
基金转型)

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：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：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。

基金托管人中国建设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
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.1.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）.....	5
2.1.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	5
2.2 基金产品说明.....	6
2.2.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）.....	6
2.2.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	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.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）.....	7
3.1.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.1.2 基金净值表现.....	8
3.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	10
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2.2 基金净值表现.....	10
4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	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.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
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遵规守信情况声明.....	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）.....	16
6.1.1 资产负债表.....	16
6.1.2 利润表.....	17
6.1.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.1.4 报表附注.....	19
6.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	38
6.2.1 资产负债表.....	38
6.2.2 利润表.....	39
6.2.3 净资产（基金净值）变动表.....	40
6.2.4 报表附注.....	42

7 投资组合报告	62
7.1 国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)	62
7.1.1 期末基金资产组合情况.....	62
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	63
7.1.3 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.....	64
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	64
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	66
7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	66
7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..	66
7.1.8 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..	66
7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	66
7.1.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	66
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	66
7.1.12 投资组合报告附注.....	67
7.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	67
7.2.1 期末基金资产组合情况.....	68
7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	68
7.2.3 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.....	69
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	70
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	72
7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细.....	72
7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细..	72
7.2.8 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..	72
7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细.....	72
7.2.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	72
7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
7.2.12 投资组合报告附注.....	72
8 基金份额持有人信息	73
8.1 国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)	73
8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	73
8.1.2 期末上市基金前十名持有人.....	74
8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
8.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	74
8.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	74
8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
8.2.2 期末上市基金前十名持有人.....	75
8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
8.2.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	75
9 开放式基金份额变动	75
9.1 国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)	75
9.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	76
10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议.....	76
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.....	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76

10.4 基金投资策略的改变.....	76
10.5 报告期内改聘会计师事务所情况.....	77
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.....	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	77
10.7.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）.....	77
10.7.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金.....	80
10.8 其他重大事件.....	82
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	83
12 备查文件目录.....	85
12.1 备查文件目录.....	85
12.2 存放地点.....	85
12.3 查阅方式.....	85

2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

基金名称	国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）
基金简称	国联安科创混合（LOF）
场内简称	国联安科创
基金主代码	501096
交易代码	501096
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020年3月20日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	444,720,893.49份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年7月22日

2.1.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

基金名称	国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国联安科创3年灵活配置混合
场内简称	国联安科创
基金主代码	501096
交易代码	501096

基金运作方式	契约型
基金合同生效日	2020年3月20日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	556,025,745.68份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020年7月22日

2.2 基金产品说明

2.2.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	本基金投资策略的核心在于重点关注并跟踪具备较强盈利能力和可持续成长能力的科技创新主题上市公司，挖掘其中具备核心竞争优势的个股，通过积极的股票选择，采取以合理价格买入的投资方式，通过上市公司价值的回归或兑现，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。

2.2.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的稳健回报。
投资策略	本基金投资策略的核心在于重点关注并跟踪具备较强盈利能力和可持续成长能力的科技创新主题上市公司，挖掘其中具备核心竞争优势的个股，通过积极的股票选择，采取以合理价格买入的投资方式，通过上市公司价值的回归或兑现，实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）×10%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金为混合型基金，理论上其预期风险和预期收益水平高于债券型基金及货币市场基金，低于股票型基金。

注：本基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金（LOF），基金名称调整为“国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）”，并接受场外、场内申购赎回。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	王小飞
	联系电话	021-38992888	021-60637103
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	021-60637228
传真		021-50151582	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区金融大街25号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200121	100033
法定代表人		于业明	田国立

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、上交所网站
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 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年3月20日至2023年6月30日)
本期已实现收益	-30,907,151.74
本期利润	41,451,438.91
加权平均基金份额本期利润	0.0887

本期加权平均净值利润率	10.58%
本期基金份额净值增长率	11.28%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-118,800,826.30
期末可供分配基金份额利润	-0.2671
期末基金资产净值	386,515,237.41
期末基金份额净值	0.8691
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	11.28%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

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

3、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。

3.1.2 基金净值表现

3.1.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月 (2023年6月1日起至2023年6月30日)	0.39%	2.49%	1.53%	0.76%	-1.14%	1.73%
过去三个月 (2023年4月1日起至2023年6月30日)	8.94%	2.56%	-4.66%	0.69%	13.60%	1.87%
自基金转型起至今(2023年3月20日起至2023年6月30日)	11.28%	2.44%	-2.29%	0.67%	13.57%	1.77%

注：1、2023年3月20日起原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金转型

为国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF），国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）的基金合同亦于该日同时生效；

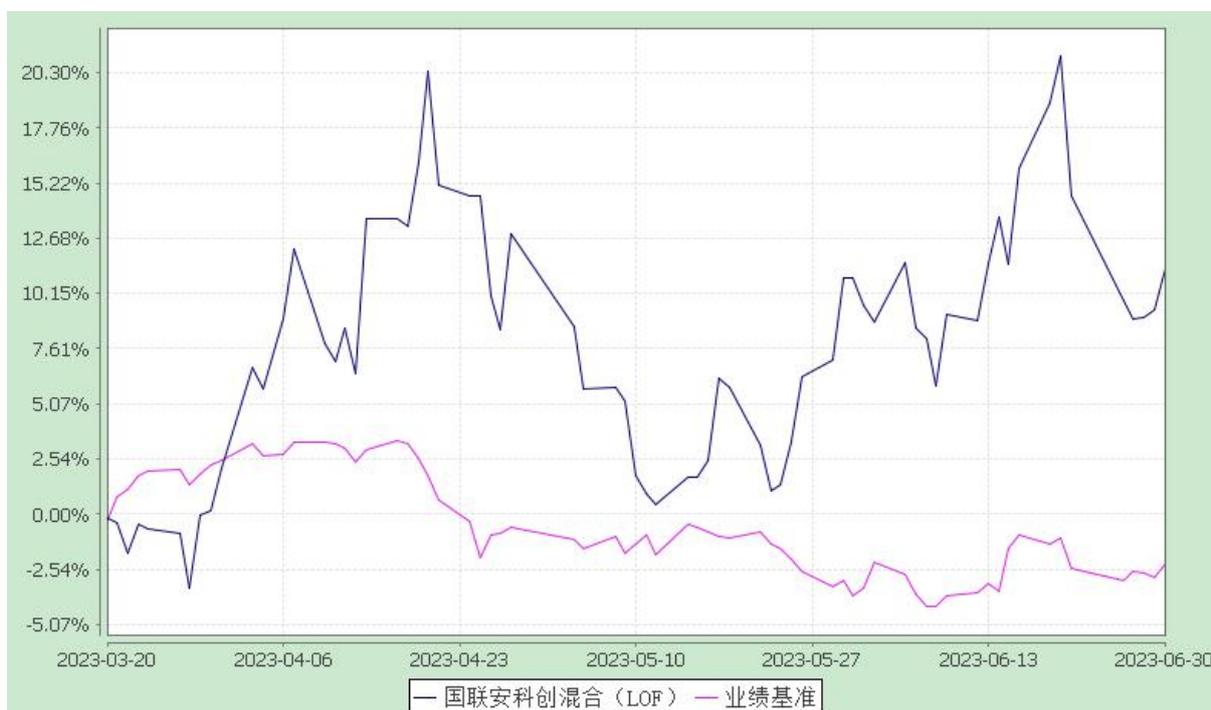
2、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.1.2.2 自基金转型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

国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

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

(2023年3月20日至2023年6月30日)



注：1、本基金的业绩比较基准为：中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+中债综合指数收益率×40%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%；

2、本基金基金合同于2023年3月20日生效。截至本报告期末，基金合同生效未满1年；

3、本基金的投资转型期为基金合同生效日起的3个月。截止本报告期末，本基金尚在投资转型期；

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。

3.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日至2023年3月19日)
本期已实现收益	-32,293,175.80
本期利润	-21,019,943.99
加权平均基金份额本期利润	-0.0378
本期加权平均净值利润率	-4.59%
本期基金份额净值增长率	-4.62%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年3月19日)
期末可供分配利润	-121,791,610.29
期末可供分配基金份额利润	-0.2190
期末基金资产净值	434,234,135.39
期末基金份额净值	0.7810
3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年3月19日)
基金份额累计净值增长率	-21.90%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

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

3、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。

3.2.2 基金净值表现

3.2.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去六个月 (2023年1月1日起至2023年3月19日)	-4.62%	1.38%	-1.70%	0.63%	-2.92%	0.75%
过去一年	-22.93%	1.82%	-14.20%	0.78%	-8.73%	1.04%

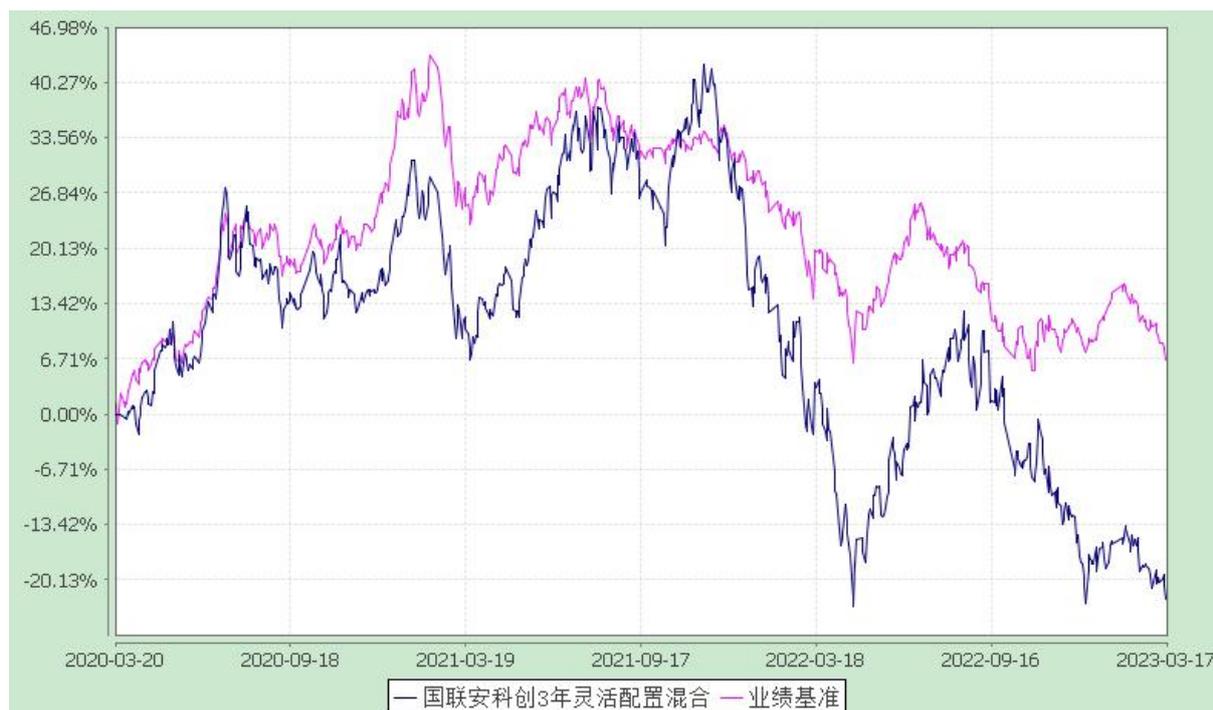
(2022年7月1日起至2023年3月19日)						
过去三年 (2020年7月1日起至2023年3月19日)	-31.78%	1.70%	-7.25%	0.91%	-24.53%	0.79%
自基金合同生效起至至本基金转型日前一日 (2020年3月20日起至2023年3月19日)	-21.90%	1.66%	6.93%	0.91%	-28.83%	0.75%

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。

3.2.2.2 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

国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金
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

(2020年3月20日至2023年3月19日)



注：1、原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准为中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+中债综合指数收益率×40%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%；

2、原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的基金合同于2020年3月20日生效；

3、原国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金的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。

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		
潘明	本基金基金经理、兼任国联安科技动力股票型证券投资基金基金经理、国联安优选	2020-03-20	-	14年（自2009年起）	潘明先生,硕士研究生。曾任计算机科学公司咨询师,摩托罗拉公司高级行政工程师,扎克斯投资管理公司投资分析师,短剑投资公司执行董事,指导资本公司基金经理兼大宗商品研究总监,海通证券股份有限公司投资经理,GCS母基金公司、GCS有限公司、

	<p>行业混合型证券投资基金基金经理、国联安匠心科技1个月滚动持有混合型证券投资基金基金经理、国联安气候变化责任投资混合型证券投资基金基金经理。</p>			<p>GCS 有限责任合伙公司独立董事，光大证券资产管理有限公司投资经理助理、投资经理。2014年1月起加入国联安基金管理有限公司，历任基金经理助理，基金经理、权益投资部总监等职。2014年2月起担任国联安优选行业混合型证券投资基金的基金经理；2015年4月至2018年7月兼任国联安德盛红利混合型证券投资基金的基金经理；2015年4月至2017年2月兼任国联安主题驱动混合型证券投资基金的基金经理；2016年1月起兼任国联安科技动力股票型证券投资基金的基金经理；2020年3月起兼任国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）（2023年3月20日由国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金转型而来）的基金经理；2021年5月起兼任国联安匠心科技1个月滚动持有混合型证券投资基金的基金经理；2022年9月起兼任国联安气候变化责任投资混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
潘明	公募基金	5.00	2,714,606,329.65	2014-02-15
	私募资产管理计划	1.00	222,773,007.09	2022-08-01
	其他组合	0.00	0.00	-
	合计	6.00	2,937,379,336.74	

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

2023 年上半年，国内经济持续复苏，但二季度开始的复苏程度似乎不及市场预期。在此背景下，充分展示人工智能涌现能力的 ChatGPT 横空出世，让市场相信一次颠覆性的技术变革或已到来，科技行业和数字经济重新成为市场亮点。上半年，中信 TMT 指数大幅跑赢沪深 300 指数近 26%。具体来看，申万一级行业中的通信、传媒、计算机和电子分别上涨 50.7%、42.8%、27.6%和 11.3%。

上半年本基金仓位基本维持在高位，自上而下增加了对传统 TMT 板块的配置并大幅降低对新能源的配置。从自下而上优选个股的角度出发，本基金大幅增配解决 GPU 集群部署训练推理过程中瓶颈问题的光模块、AI 云端算力服务和半导体量测设备等标的。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自本基金转型日起至本报告期末（2023 年 3 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日），本基金份额净值增长率为 11.28%，同期业绩比较基准收益率为-2.29%。

自本报告期初起至本基金转型日前一日（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 19 日），原国联

安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金份额净值增长率为-4.62%，同期业绩比较基准收益率为-1.70%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

随着异构形式的 AI 服务器在数据中心逐步取代传统通用服务器和大模型驱动的原生 AI 应用在中国的逐步涌现，“中国的英伟达”和“中国的微软”有望崛起。在半导体领域中，除了国产替代相关赛道，与 AI 密切相关的 2.5D 先进封装也值得关注。

虽然 ChatGPT 是里程碑式的突破，AI 变革仍将会是一个长期过程。如果 AI 被短期高估，AI 赛道的波动必然加大，但不影响它的战略价值和发展过程中产生的投资机会。

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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支、等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

6.1.1 资产负债表

会计主体：国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

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
资产：		-
银行存款	6.1.4.7.1	37,985,453.05
结算备付金		605,220.65
存出保证金		93,300.12
交易性金融资产	6.1.4.7.2	352,357,145.85
其中：股票投资		352,357,145.85
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	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		39,790.17
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.5	-

资产总计		391,080,909.84
负债和净资产	附注号	本期末 2023年6月30日
负 债：		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		3,032,760.93
应付赎回款		369,593.31
应付管理人报酬		483,275.51
应付托管费		80,545.92
应付销售服务费		-
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	6.1.4.7.6	599,496.76
负债合计		4,565,672.43
净资产：		
实收基金	6.1.4.7.7	444,720,893.49
其他综合收益		-
未分配利润	6.1.4.7.8	-58,205,656.08
净资产合计		386,515,237.41
负债和净资产总计		391,080,909.84

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8691 元，基金份额总额 444,720,893.49 份。

6.1.2 利润表

会计主体：国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 3 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年3月20日至 2023年6月30日
一、营业总收入		43,443,071.03
1.利息收入		40,554.77
其中：存款利息收入	6.1.4.7.9	40,554.77
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）		-29,014,550.26
其中：股票投资收益	6.1.4.7.10	-29,787,998.62
基金投资收益		-
债券投资收益	6.1.4.7.11	1,451.37
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.1.4.7.12	-
股利收益	6.1.4.7.13	771,996.99
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.14	72,358,590.65
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.1.4.7.15	58,475.87
减：二、营业总支出		1,991,632.12
1. 管理人报酬		1,663,206.61
2. 托管费		277,201.11
3. 销售服务费		-
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	6.1.4.7.16	51,224.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		41,451,438.91
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		41,451,438.91
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		41,451,438.91

6.1.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023年3月20日至2023年6月30日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023年3月20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	556,025,745.68	-	-121,791,610.29	434,234,135.39

资产(基金净值)				
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)	556,025,745.68	-	-121,791,610.29	434,234,135.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-111,304,852.19	-	63,585,954.21	-47,718,897.98
(一)、综合收益总额	-	-	41,451,438.91	41,451,438.91
(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)	-111,304,852.19	-	22,134,515.30	-89,170,336.89
其中: 1.基金申购款	6,310,076.13	-	-958,203.55	5,351,872.58
2.基金赎回款	-117,614,928.32	-	23,092,718.85	-94,522,209.47
(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)	444,720,893.49	-	-58,205,656.08	386,515,237.41

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王琤，主管会计工作负责人：叶培智，会计机构负责人：仲晓峰

6.1.4 报表附注

6.1.4.1 基金基本情况

国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）（原国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金，以下简称“本基金”）是根据《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的约定，由国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(以下

简称“原基金”)转型而来。根据本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司于 2023 年 3 月 17 日发布的《关于国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满及相关安排的公告》，原基金已触发了《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定的转型条款。经与基金托管人中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)备案，原基金于 2023 年 3 月 20 日由封闭式基金转型为上市开放式基金(LOF)，基金名称相应变更为“国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)”。修改后的《国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)基金合同》于该日生效，原《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

原国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金于基金合同失效前的基金资产净值为人民币 434,234,135.39 元，已于本基金的基金合同生效日全部转为本基金的基金资产净值。对于投资者在本基金更名前持有的基金份额，其持有期将自投资者持有基金份额的注册登记日起连续计算。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]204 号核准，本基金 34,408,394 份基金份额于 2020 年 7 月 22 日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)基金合同》的有关规定，本基金的投资范围主要包括国内依法发行上市的股票(含科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、政府机构债券、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、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。本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：封闭运作期内，本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-100%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；封闭运作期届满后，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；封闭运作期届满后，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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；封闭运作期内，本基金不受前述 5%的限制，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交

易保证金一倍的现金；其中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：中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%+中债综合指数收益率×40%。

6.1.4.2 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》、《国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.1.4.4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。

6.1.4.3 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2023年6月30日的财务状况以及2023半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.1.4.4 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。

6.1.4.5 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。

6.1.4.6 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。

6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

6.1.4.7.1 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	37,985,453.05
等于：本金	37,981,934.59
加：应计利息	3,518.46
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	37,985,453.05

6.1.4.7.2 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	288,669,216.35	-	352,357,145.85	63,687,929.50
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	288,669,216.35	-	352,357,145.85	63,687,929.50

6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产/负债。

6.1.4.7.4 买入返售金融资产

6.1.4.7.4.1 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。

6.1.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.1.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

6.1.4.7.6 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	16.79
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	510,219.82
其中：交易所市场	510,219.82
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
合计	599,496.76

6.1.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年3月20日至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	556,025,745.68	556,025,745.68
本期申购	6,310,076.13	6,310,076.13
本期赎回（以“-”号填列）	117,614,928.32	117,614,928.32
本期末	444,720,893.49	444,720,893.49

注： 1. 申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

2. 根据本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司于2023年3月17日发布的《关于国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满及相关安排的公告》，本基金由国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金转型而来。转型方案实施后，基金份额持有人持有的国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金份额转为国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）基金份额。

3.截至2023年6月30日止，本基金于上交所上市的基金份额为24,672,774.00份，托管在场

外未上市交易的基金份额为 420,048,119.49 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.1.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-113,120,949.14	-8,670,661.15	-121,791,610.29
本期利润	-30,907,151.74	72,358,590.65	41,451,438.91
本期基金份额交易产生的变动数	25,227,274.58	-3,092,759.28	22,134,515.30
其中：基金申购款	-1,602,747.97	644,544.42	-958,203.55
基金赎回款	26,830,022.55	-3,737,303.70	23,092,718.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-118,800,826.30	60,595,170.22	-58,205,656.08

6.1.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月20日至2023年6月30日
活期存款利息收入	35,828.26
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	4,347.66
其他	378.85
合计	40,554.77

注：此处其他列示基金存于上交所和深交所的交易保证金利息、直销申购款利息。

6.1.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月20日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	356,924,715.85
减：卖出股票成本总额	385,671,259.85
减：交易费用	1,041,454.62
买卖股票差价收入	-29,787,998.62

6.1.4.7.11 债券投资收益

6.1.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月20日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,101.37
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	350.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,451.37

6.1.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月20日至2023年6月30日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	1,006,513.42
减：卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	999,390.00
减：应计利息总额	6,773.42
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	350.00

6.1.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券赎回差价收入。

6.1.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券申购差价收入。

6.1.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.1.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年3月20日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	771,996.99

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	771,996.99

6.1.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年3月20日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	72,358,590.65
——股票投资	72,358,590.65
——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	72,358,590.65

6.1.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月20日至2023年6月30日
基金赎回费收入	58,475.87
合计	58,475.87

6.1.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月20日至2023年6月30日
审计费	16,931.14
信息披露费	33,863.31

证券出借违约金	-
沪股通_证券组合费	114.14
银行汇划费用	315.81
合计	51,224.40

6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.1.4.8.1 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。

6.1.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，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。

6.1.4.9 关联方关系

6.1.4.9.1 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。

6.1.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

6.1.4.10 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。

6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.1.4.10.1.1 股票交易

本报告期本基金未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.1.4.10.1.2 权证交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.1.4.10.1.3 债券交易

本报告期内本基金未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.1.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期本基金未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.1.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期本基金未有应支付关联方的佣金。

6.1.4.10.2 关联方报酬

6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月20日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,663,206.61
其中：支付销售机构的客户维护费	403,938.88

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 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.50% / 当年天数。

6.1.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年3月20日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	277,201.11

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数。

6.1.4.10.3 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。

6.1.4.10.4 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发生转融通出借业务。

6.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.1.4.10.5.1 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。

6.1.4.10.5.2 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

本报告期末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.1.4.10.6 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3月20日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	37,985,453.05	35,828.26

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“中国建设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605,220.65元。（2022年6月30日：人民币507,364.20元）

6.1.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内本基金未在承销期内参与过由关联方承销的证券。

6.1.4.10.8 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。

6.1.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.1.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.1.4.12.1 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

6.1.4.12.1.1 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
688072	拓荆科技	2023-04-28	6个月	新股锁定	352.00	387.02	20,000	7,040,000.00	7,740,400.00	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	新股锁定	23.60	64.67	359	8,472.40	23,216.53	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	新股锁定	152.38	135.97	127	19,352.26	17,268.19	-

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。

6.1.4.12.2 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。

6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.1.4.12.3.1 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为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

6.1.4.12.3.2 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 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。

6.1.4.13 金融工具风险及管理

6.1.4.13.1 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。

6.1.4.13.2 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%。本基金基金合同于2023年3月20日生效，无上年度末数据。

6.1.4.13.3 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。

6.1.4.13.3.1 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不超过该证券的10%。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。

6.1.4.13.4 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。

6.1.4.13.4.1 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。

6.1.4.13.4.1.1 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	37,985,453.05	-	-	-	-	-	37,985,453.05
结算备付金	605,220.65	-	-	-	-	-	605,220.65
存出保证金	93,300.12	-	-	-	-	-	93,300.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	352,357,145.85	352,357,145.85
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	39,790.17	39,790.17
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	38,683,973.82	-	-	-	-	352,396,936.02	391,080,909.84
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	3,032,760.93	3,032,760.93
应付赎回款	-	-	-	-	-	369,593.31	369,593.31
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	483,275.51	483,275.51
应付托管费	-	-	-	-	-	80,545.92	80,545.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-

应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	599,496.76	599,496.76
负债总计	-	-	-	-	-	4,565,672.43	4,565,672.43
利率敏感度缺口	38,683,973.82	-	-	-	-	347,831,263.59	386,515,237.41

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。

6.1.4.13.4.1.2 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%，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。本基金合同于2023年3月20日生效，无上年度末数据。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。

6.1.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.1.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	170,264.81	170,264.81
资产合计	-	170,264.81	170,264.81
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 外汇风险敞口净	-	170,264.81	170,264.81

额			
---	--	--	--

6.1.4.13.4.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变	
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
	假设人民币对一揽子货币平均升值5%	-8,513.24
	假设人民币对一揽子货币平均贬值5%	8,513.24

注：本基金合同于2023年3月20日生效，无上年度末数据。

6.1.4.13.4.3 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。封闭运作期内，本基金股票资产投资比例为基金资产的0%-100%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%；封闭运作期届满后，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的60%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0-50%；封闭运作期届满后，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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%；封闭运作期内，本基金不受前述5%的限制，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交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

6.1.4.13.4.3.1 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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	352,357,145.85	91.16
交易性金融资产—基金投资	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
合计	352,357,145.85	91.16

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

6.1.4.13.4.3.2 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
	业绩比较基准上升5%	15,561,130.02
	业绩比较基准下降5%	-15,561,130.02

注：本基金合同于2023年3月20日生效，无上年度末数据。

6.1.4.14 公允价值

6.1.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

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。

6.1.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.1.4.14.2.1 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
第一层次	344,576,261.13
第二层次	-
第三层次	7,780,884.72
合计	352,357,145.85

6.1.4.14.2.2 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债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.1.4.14.3 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。

6.1.4.14.4 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。

6.1.4.15 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。

6.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

6.2.1 资产负债表

会计主体：国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2023年3月19日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年3月19日	上期末 2022年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.2.4.7.1	90,326,067.27	53,512,439.83
结算备付金		345,982.26	301,966.68
存出保证金		64,370.68	77,997.86
交易性金融资产	6.2.4.7.2	343,713,452.15	404,800,077.60
其中：股票投资		343,713,452.15	363,078,261.00
基金投资		-	-
债券投资		-	41,721,816.60
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-

衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
应收清算款		433,609.26	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.5	-	-
资产总计		434,883,481.62	458,692,481.97
负债和净资产	附注号	本期末 2023年3月19日	上期末 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	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1.93	2,482,021.56
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		276,120.14	477,561.17
应付托管费		46,020.00	79,593.50
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		72.57	520.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.6	327,131.59	398,705.83
负债合计		649,346.23	3,438,402.59
净资产:			
实收基金	6.2.4.7.7	556,025,745.68	556,025,745.68
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.2.4.7.8	-121,791,610.29	-100,771,666.30
净资产合计		434,234,135.39	455,254,079.38
负债和净资产总计		434,883,481.62	458,692,481.97

注：报告截止日 2023 年 3 月 19 日，基金份额净值 0.7810 元，基金份额总额 556,025,745.68 份。

6.2.2 利润表

会计主体：国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 3 月 19 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至 2023年3月19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		-19,610,091.85	-140,779,841.48

1.利息收入		44,798.33	117,761.40
其中：存款利息收入	6.2.4.7.9	44,798.33	117,761.40
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）		-30,928,121.99	-36,078,148.47
其中：股票投资收益	6.2.4.7.10	-23,488,071.73	-45,469,495.30
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.2.4.7.11	-7,434,148.96	8,608,172.12
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.12	-	-
股利收益	6.2.4.7.13	-5,901.30	783,174.71
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.14	11,273,231.81	-104,819,454.41
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.15	-	-
减：二、营业总支出		1,409,852.14	3,951,254.99
1. 管理人报酬		1,175,157.12	3,304,823.52
2. 托管费		195,859.43	550,803.92
3. 销售服务费		-	-
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		111.04	818.07
8. 其他费用	6.2.4.7.16	38,724.55	94,809.48
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-21,019,943.99	-144,731,096.47
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-21,019,943.99	-144,731,096.47
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-21,019,943.99	-144,731,096.47

6.2.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2023年1月1日至2023年3月19日

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月19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)	556,025,745.68	-	-100,771,666.30	455,254,079.38
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)	556,025,745.68	-	-100,771,666.30	455,254,079.38
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-21,019,943.99	-21,019,943.99
(一)、综合收益总额	-	-	-21,019,943.99	-21,019,943.99
(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)	-	-	-	-
其中: 1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	556,025,745.68	-	-121,791,610.29	434,234,135.39
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)	556,025,745.68	-	152,157,684.45	708,183,430.13
二、本期期初净	-	-	-	-

资产(基金净值)				
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-144,731,096.47	-144,731,096.47
(一)、综合收益总额	-	-	-144,731,096.47	-144,731,096.47
(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)	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)	556,025,745.68	-	7,426,587.98	563,452,333.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：王琤，主管会计工作负责人：叶培智，会计机构负责人：仲晓峰

6.2.4 报表附注

6.2.4.1 基金基本情况

国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金(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[2020]76 号《关于准予国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 555,746,030.90 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(2020)第 0132 号验资报告验证。经向中国证监会备案，《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型

证券投资基金基金合同》于2020年3月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为556,025,745.68份基金份额，其中认购资金利息折合279,714.78份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司(以下简称“中国建设银行”)。

根据《国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。封闭运作期届满后，本基金转为上市开放式基金(LOF)，基金名称调整为“国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)”，并接受场外、场内申购赎回。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]204号核准，本基金34,408,394份基金份额于2020年7月22日在上交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至上交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(含科创板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票)、港股通标的股票、债券(包括国债、政府机构债券、地方政府债券、金融债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、证券公司短期公司债券、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可分离交易可转债、可交换债券等)、债券回购、同业存单、银行存款(包含协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、资产支持证券、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)。本基金可根据法律法规的规定，参与转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：封闭运作期内，本基金股票投资占基金资产的比例为0%-100%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%；封闭运作期届满后，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的60%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的0%-50%；封闭运作期届满后，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，本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的5%；封闭运作期内，本基金不受前述5%的限制，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交易保证金一倍的现金；其中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：中国战略新兴产业成份指数收益率×50%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)×10%+中债综合指数收益率×40%。

根据本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司于2023年3月17日发布的《关于国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满及相关安排的公告》，本基金

的封闭运作期于 2023 年 3 月 19 日届满，触发了《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》约定的转型条款，经与本基金的基金托管人为中国建设银行股份有限公司协商一致，并报中国证监会备案，本基金于 2023 年 3 月 20 日由封闭式基金转型为上市开放式基金（LOF），基金名称相应变更为“国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）”。修改后的《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》于该日生效，原《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于同日失效。

6.2.4.2 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》、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》、《国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.2.4.4 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。

经中国证监会批准，基金管理人国联安基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

6.2.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年度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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 半年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.2.4.4 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。

6.2.4.5 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。

6.2.4.6 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。

6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年3月19日
活期存款	90,326,067.27
等于：本金	90,276,823.84
加：应计利息	49,243.43
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	90,326,067.27

6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年3月19日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	352,384,113.30	-	343,713,452.15	-8,670,661.15
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	352,384,113.30	-	343,713,452.15	-8,670,661.15

6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.2.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末本基金无衍生金融资产/负债。

6.2.4.7.4 买入返售金融资产

6.2.4.7.4.1 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。

6.2.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.2.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

6.2.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年3月19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	228,665.89
其中：交易所市场	228,665.89
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	72,821.64
预提信息披露费	25,644.06
合计	327,131.59

6.2.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月19日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	556,025,745.68	556,025,745.68
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	556,025,745.68	556,025,745.68

注：1.此处申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

2.根据《国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，
 第47页，共85页

本基金基金合同生效后的前三年为封闭运作期。在封闭运作期内，本基金不办理申购与赎回业务。封闭运作期内基金上市交易后，投资者可将其持有的场外基金份额通过办理跨系统转托管业务转至场内后上市交易。

3.截至2023年3月19日止，本基金于上交所上市的基金份额为55,767,483.00份，托管在场外未上市交易的基金份额为500,258,262.68份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通或按基金份额净值申购或赎回；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

6.2.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-80,827,773.34	-19,943,892.96	-100,771,666.30
本期利润	-32,293,175.80	11,273,231.81	-21,019,943.99
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-113,120,949.14	-8,670,661.15	-121,791,610.29

6.2.4.7.9 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3月19日
活期存款利息收入	42,774.71
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	1,769.95
其他	253.67
合计	44,798.33

注：此处其他列示基金存于上交所和深交所的交易保证金利息。

6.2.4.7.10 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3月19日

卖出股票成交总额	123,262,671.38
减：卖出股票成本总额	146,365,882.72
减：交易费用	384,860.39
买卖股票差价收入	-23,488,071.73

6.2.4.7.11 债券投资收益

6.2.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月19日
债券投资收益——利息收入	30,835.18
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-7,464,984.14
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	-7,434,148.96

6.2.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月19日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	43,847,676.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	51,288,036.89
减：应计利息总额	22,870.06
减：交易费用	1,753.99
买卖债券差价收入	-7,464,984.14

6.2.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券赎回差价收入。

6.2.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券申购差价收入。

6.2.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.2.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月19日
股票投资产生的股利收益	-5,901.30
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	-5,901.30

6.2.4.7.14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3月19日
1.交易性金融资产	11,273,231.81
——股票投资	1,666,979.82
——债券投资	9,606,251.99
——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	11,273,231.81

6.2.4.7.15 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.2.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月19日
审计费	12,821.64

信息披露费	25,644.06
证券出借违约金	-
沪股通_证券组合费	163.85
银行汇划费用	95.00
合计	38,724.55

6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.2.4.8.1 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。

6.2.4.8.2 资产负债表日后事项

《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》自2023年3月20日起生效，《国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金合同》自同日起失效，同时本基金更名为国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）。

6.2.4.9 关联方关系

6.2.4.9.1 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。

6.2.4.9.2 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
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	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

6.2.4.10 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。

6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.2.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.2.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.2.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.2.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.2.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有应支付关联方的佣金。

6.2.4.10.2 关联方报酬

6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月 19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管理费	1,175,157.12	3,304,823.52
其中：支付销售机构的客户维护费	316,861.01	404,344.04

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 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年3月 19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	195,859.43	550,803.92

注：支付基金托管人中国建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.2.4.10.3 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进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.2.4.10.4 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发生转融通出借业务。

6.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.2.4.10.5.1 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。

6.2.4.10.5.2 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，除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.2.4.10.6 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3月19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
中国建设银行	90,326,067.27	42,774.71	40,265,300.24	103,529.65

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“中国建设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3月19日的相关余额为人民币345,982.26元。（2022年6月30日：人民币507,364.20元）

6.2.4.10.7 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参与过由关联方承销的证券。

6.2.4.10.8 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。

6.2.4.11 利润分配情况

本报告期内，本基金未进行利润分配。

6.2.4.12 期末（2023年3月19日）本基金持有的流通受限证券

6.2.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.2.4.12.2 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。

6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.2.4.12.3.1 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为0元，因此没有作为抵押的债券。

6.2.4.12.3.2 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。

6.2.4.13 金融工具风险及管理

6.2.4.13.1 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。

6.2.4.13.2 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3月19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：9.16%）。

6.2.4.13.3 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。

6.2.4.13.3.1 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不超过该证券的 10%。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。

6.2.4.13.4 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。

6.2.4.13.4.1 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。

6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年3 月19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	90,326,067.27	-	-	-	-	-	90,326,067.27
结算备付金	345,982.26	-	-	-	-	-	345,982.26
存出保证金	64,370.68	-	-	-	-	-	64,370.68
交易性金融资产	-	-	-	-	-	343,713,452.15	343,713,452.15
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	433,609.26	433,609.26

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	90,736,420.21	-	-	-	-	344,147,061.41	434,883,481.62
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	1.93	1.93
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	276,120.14	276,120.14
应付托管费	-	-	-	-	-	46,020.00	46,020.00
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	72.57	72.57
其他负债	-	-	-	-	-	327,131.59	327,131.59
负债总计	-	-	-	-	-	649,346.23	649,346.23
利率敏感度缺口	90,736,420.21	-	-	-	-	343,497,715.18	434,234,135.39
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	53,512,439.83	-	-	-	-	-	53,512,439.83
结算备付金	301,966.68	-	-	-	-	-	301,966.68
存出保证金	77,997.86	-	-	-	-	-	77,997.86
交易性金融资产	14,185,653.40	14,363,144.48	13,173,018.72	-	-	363,078,261.00	404,800,077.60
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	68,078,057.77	14,363,144.48	13,173,018.72	-	-	363,078,261.00	458,692,481.97
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	2,482,021.56	2,482,021.56
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	477,561.17	477,561.17
应付托管费	-	-	-	-	-	79,593.50	79,593.50
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	520.53	520.53
其他负债	-	-	-	-	-	398,705.83	398,705.83
负债总计	-	-	-	-	-	3,438,402.59	3,438,402.59
利率敏感度缺口	68,078,057.77	14,363,144.48	13,173,018.72	-	-	359,639,858.41	455,254,079.38

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。

6.2.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年3月19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：9.16%，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。

6.2.4.13.4.2 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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.2.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2023年3月19日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	9,107,782.44	9,107,782.44
资产合计	-	9,107,782.44	9,107,782.44
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	9,107,782.44	9,107,782.44
项目	上年度末 2022年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	9,920,201.05	9,920,201.05
资产合计	-	9,920,201.05	9,920,201.05
以外币计价的 的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外 汇风险敞口净额	-	9,920,201.05	9,920,201.05

6.2.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率外其他因素保持不变		
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3月19日	上年度末 2022年12月31日

	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-455,389.12	-496,010.05
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	455,389.12	496,010.05

6.2.4.13.4.3 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。封闭运作期内，本基金股票资产投资比例为基金资产的 0%-100%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；封闭运作期届满后，本基金股票资产投资比例不低于基金资产的 60%，投资于科技创新主题证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%；封闭运作期届满后，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，本基金持有现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金资产净值的 5%；封闭运作期内，本基金不受前述 5%的限制，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交易保证金一倍的现金；其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年3月19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	343,713,452.15	79.15	363,078,261.00	79.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	343,713,452.15	79.15	363,078,261.00	79.75

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

6.2.4.13.4.3.2 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3月19日	上年度末 2022年12月31日
业绩比较基准上升 5%	31,586,938.27	34,700,185.82
业绩比较基准下降 5%	-31,586,938.27	-34,700,185.82

6.2.4.14 公允价值

6.2.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由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决定：

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。

6.2.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.2.4.14.2.1 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3月19日	上期末 2022年12月31日
第一层次	343,713,452.15	404,800,077.60
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	343,713,452.15	404,800,077.60

6.2.4.14.2.2 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债券，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，本基金不会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将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.2.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年3月19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:同)。

6.2.4.14.4 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。

6.2.4.15 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 国联安科技创新混合型证券投资基金(LOF)

(报告期:2023年3月20日-2023年6月30日)

7.1.1 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	352,357,145.85	90.10
	其中:股票	352,357,145.85	90.10
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	38,590,673.70	9.87
8	其他各项资产	133,090.29	0.03
9	合计	391,080,909.84	100.00

注:1、由于四舍五入的原因,分项之和与合计项可能存在尾差;

2、报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为170,264.81元，占基金资产净值的比例为0.04%。

7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.1.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	289,527,208.38	74.91
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	-	-
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	62,326,640.66	16.13
J	金融业	333,032.00	0.09
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
T	合计	352,186,881.04	91.12

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.1.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	170,264.81	0.04
合计	170,264.81	0.04

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.1.3 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

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	300308	中际旭创	217,900	32,129,355.00	8.31
2	688072	拓荆科技	76,058	31,619,426.26	8.18
3	688111	金山办公	55,218	26,075,043.96	6.75
4	688256	寒武纪	131,369	24,697,372.00	6.39
5	002371	北方华创	74,200	23,569,630.00	6.10
6	688120	华海清科	89,318	22,512,601.90	5.82
7	603019	中科曙光	432,000	21,988,800.00	5.69
8	300567	精测电子	209,600	19,943,440.00	5.16
9	688037	芯源微	114,951	19,650,873.45	5.08
10	002920	德赛西威	115,500	17,996,055.00	4.66
11	688041	海光信息	260,358	17,774,640.66	4.60
12	688012	中微公司	113,297	17,725,315.65	4.59
13	301165	锐捷网络	263,800	16,281,736.00	4.21
14	300394	天孚通信	142,600	15,233,958.00	3.94
15	688498	源杰科技	45,644	13,008,540.00	3.37
16	688147	微导纳米	172,263	9,092,041.14	2.35
17	688777	中控技术	142,550	8,949,289.00	2.32
18	002463	沪电股份	146,400	3,065,616.00	0.79
19	601138	工业富联	105,100	2,648,520.00	0.69
20	300442	润泽科技	53,460	1,644,429.60	0.43
21	300624	万兴科技	12,758	1,494,599.70	0.39
22	688361	中科飞测	17,417	1,439,201.11	0.37
23	002230	科大讯飞	15,600	1,060,176.00	0.27
24	000977	浪潮信息	19,800	960,300.00	0.25
25	300820	英杰电气	9,300	766,134.00	0.20
26	300033	同花顺	1,900	333,032.00	0.09
27	688502	茂莱光学	1,509	289,728.00	0.07
28	688531	日联科技	1,269	186,866.61	0.05
29	03690	美团-W	1,510	170,264.81	0.04
30	601360	三六零	4,000	50,160.00	0.01

7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.1.4.1 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	688256	寒武纪	25,725,041.04	5.92
2	688012	中微公司	25,195,782.44	5.80
3	300308	中际旭创	23,664,340.30	5.45
4	603019	中科曙光	23,375,914.68	5.38
5	688041	海光信息	20,494,765.72	4.72
6	002463	沪电股份	20,454,204.83	4.71
7	300033	同花顺	20,222,361.20	4.66
8	301165	锐捷网络	16,985,195.15	3.91
9	300394	天孚通信	15,530,378.72	3.58
10	688777	中控技术	15,205,369.68	3.50
11	688498	源杰科技	10,580,353.49	2.44
12	002920	德赛西威	9,428,391.00	2.17
13	688475	萤石网络	9,120,976.56	2.10
14	688147	微导纳米	9,014,420.44	2.08
15	300624	万兴科技	7,572,703.80	1.74
16	300567	精测电子	7,430,191.00	1.71
17	688037	芯源微	7,159,658.63	1.65
18	688072	拓荆科技	7,040,000.00	1.62
19	601360	三六零	6,365,501.00	1.47
20	002371	北方华创	5,945,769.00	1.37

7.1.4.2 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	688072	拓荆科技	25,365,322.03	5.84
2	688063	派能科技	21,510,125.94	4.95
3	688032	禾迈股份	19,631,115.87	4.52
4	300666	江丰电子	18,036,385.00	4.15
5	688777	中控技术	16,382,061.28	3.77
6	300308	中际旭创	15,942,248.00	3.67
7	300033	同花顺	15,176,590.00	3.50
8	688409	富创精密	14,911,289.80	3.43
9	688385	复旦微电	14,133,398.87	3.25
10	002463	沪电股份	13,885,718.39	3.20
11	300438	鹏辉能源	12,619,354.37	2.91
12	688052	纳芯微	12,367,565.91	2.85
13	688234	天岳先进	12,097,277.19	2.79
14	688348	昱能科技	9,484,447.69	2.18
15	00700	腾讯控股	9,194,040.73	2.12
16	688475	萤石网络	8,219,004.49	1.89
17	688107	安路科技	7,913,374.63	1.82

18	000821	京山轻机	6,938,449.00	1.60
19	603444	吉比特	6,864,510.00	1.58
20	002865	钧达股份	6,307,710.00	1.45

7.1.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	321,956,362.90
卖出股票的收入（成交）总额	356,924,715.85

注：不考虑相关交易费用。

7.1.5 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。

7.1.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.1.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.1.8 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。

7.1.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.1.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。若本基金投资股指期货，在股指期货投资上，本基金以套期保值为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.1.11.1 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。

7.1.11.2 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。

7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，武汉精测电子集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到苏州工业园区人民法院的处罚。

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。

7.1.12.2 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。

7.1.12.3 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	93,300.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	39,790.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	133,090.29

7.1.12.4 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。

7.1.12.5 期末前十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	688072	拓荆科技	7,740,400.00	2.00	新股锁定

7.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

(报告期：2023年1月1日-2023年3月19日)

7.2.1 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	343,713,452.15	79.04
	其中：股票	343,713,452.15	79.04
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	90,672,049.53	20.85
8	其他各项资产	497,979.94	0.11
9	合计	434,883,481.62	100.00

注：1、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

2、报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 9,107,782.44 元，占基金资产净值的比例为 2.10%。

7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	287,632,480.21	66.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	42,824,959.50	9.86

J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,148,230.00	0.96
S	综合	-	-
T	合计	334,605,669.71	77.06

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
消费者非必需品	173,214.48	0.04
电信服务	8,934,567.96	2.06
合计	9,107,782.44	2.10

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.3 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

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	688072	拓荆科技	121,491	35,675,832.15	8.22
2	688032	禾迈股份	32,533	21,673,159.27	4.99
3	300666	江丰电子	266,000	21,625,800.00	4.98
4	688063	派能科技	83,327	19,601,843.48	4.51
5	002371	北方华创	70,500	19,035,000.00	4.38
6	688385	复旦微电	233,458	16,647,889.98	3.83
7	688409	富创精密	133,529	16,558,931.29	3.81
8	688111	金山办公	45,074	16,113,955.00	3.71
9	688120	华海清科	51,110	15,695,881.00	3.61
10	688777	中控技术	128,041	13,124,202.50	3.02
11	300438	鹏辉能源	224,200	12,514,844.00	2.88
12	688037	芯源微	56,867	12,365,729.15	2.85
13	688052	纳芯微	40,034	12,330,472.00	2.84
14	300567	精测电子	184,900	12,205,249.00	2.81

15	688234	天岳先进	164,210	11,680,257.30	2.69
16	688348	昱能科技	26,973	10,117,842.03	2.33
17	00700	腾讯控股	28,400	8,479,296.72	1.95
18	002920	德赛西威	84,400	8,085,520.00	1.86
19	688107	安路科技	110,237	6,970,285.51	1.61
20	000821	京山轻机	325,100	6,576,773.00	1.51
21	002865	钧达股份	43,300	6,451,700.00	1.49
22	688261	东微半导	27,364	5,971,372.08	1.38
23	300820	英杰电气	60,400	5,410,028.00	1.25
24	300413	芒果超媒	113,000	4,148,230.00	0.96
25	688378	奥来德	75,174	4,128,556.08	0.95
26	300750	宁德时代	9,000	3,383,820.00	0.78
27	300661	圣邦股份	22,150	3,311,203.50	0.76
28	300442	润泽科技	29,700	2,070,090.00	0.48
29	688041	海光信息	34,652	1,992,490.00	0.46
30	600537	亿晶光电	246,000	1,694,940.00	0.39
31	301165	锐捷网络	34,400	1,606,136.00	0.37
32	003031	中瓷电子	16,600	1,558,574.00	0.36
33	603444	吉比特	2,000	765,680.00	0.18
34	002487	大金重工	18,700	605,693.00	0.14
35	688515	裕太微	2,390	500,083.60	0.12
36	002410	广联达	7,500	490,650.00	0.11
37	603019	中科曙光	14,100	467,556.00	0.11
38	09626	哔哩哔哩-W	2,880	455,271.24	0.10
39	688333	铂力特	2,821	398,071.31	0.09
40	300724	捷佳伟创	3,400	370,158.00	0.09
41	688502	茂莱光学	1,509	352,849.47	0.08
42	688533	上声电子	7,383	328,322.01	0.08
43	03690	美团-W	1,510	173,214.48	0.04

7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.2.4.1 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	688120	华海清科	15,316,062.46	3.36
2	300567	精测电子	11,969,557.00	2.63
3	688409	富创精密	8,912,392.05	1.96
4	000821	京山轻机	8,645,129.00	1.90
5	688111	金山办公	8,062,420.09	1.77
6	300820	英杰电气	5,744,102.00	1.26

7	688378	奥来德	5,024,685.20	1.10
8	688496	清越科技	4,679,107.49	1.03
9	00700	腾讯控股	4,308,227.41	0.95
10	688777	中控技术	4,008,886.30	0.88
11	688032	禾迈股份	3,984,552.90	0.88
12	300413	芒果超媒	3,954,697.00	0.87
13	002371	北方华创	3,487,990.00	0.77
14	688037	芯源微	2,763,279.87	0.61
15	300750	宁德时代	2,639,312.00	0.58
16	03690	美团-W	2,563,609.35	0.56
17	000977	浪潮信息	2,239,368.54	0.49
18	688063	派能科技	2,213,427.35	0.49
19	003031	中瓷电子	1,848,978.00	0.41
20	688041	海光信息	1,838,675.16	0.40

7.2.4.2 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	688234	天岳先进	12,930,105.33	2.84
2	688348	昱能科技	12,546,415.68	2.76
3	688800	瑞可达	12,004,876.84	2.64
4	002920	德赛西威	9,104,516.00	2.00
5	03690	美团-W	6,244,052.12	1.37
6	688063	派能科技	5,832,354.48	1.28
7	603290	斯达半导	5,422,244.00	1.19
8	688533	上声电子	4,959,141.95	1.09
9	688032	禾迈股份	4,912,785.57	1.08
10	603606	东方电缆	4,598,397.00	1.01
11	688052	纳芯微	4,553,738.93	1.00
12	300438	鹏辉能源	4,476,780.50	0.98
13	688385	复旦微电	4,150,225.54	0.91
14	688496	清越科技	3,932,825.61	0.86
15	688409	富创精密	3,543,075.38	0.78
16	002865	钧达股份	2,523,561.00	0.55
17	300661	圣邦股份	2,417,308.00	0.53
18	000977	浪潮信息	2,057,712.00	0.45
19	688223	晶科能源	1,840,544.99	0.40
20	002368	太极股份	1,674,470.00	0.37

7.2.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	125,334,094.05
卖出股票的收入（成交）总额	123,262,671.38

注：不考虑相关交易费用。

7.2.5 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。

7.2.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.2.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.2.8 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。

7.2.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.2.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未投资股指期货。若本基金投资股指期货，在股指期货投资上，本基金以套期保值为目标，在控制风险的前提下，谨慎适当参与股指期货的投资。本基金在进行股指期货投资中，将分析股指期货的收益性、流动性及风险特征，主要选择流动性好、交易活跃的期货合约，通过研究现货和期货市场的发展趋势，运用定价模型对其进行合理估值，谨慎利用股指期货，调整投资组合的风险暴露，及时调整投资组合仓位，以降低组合风险、提高组合的运作效率。

7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.2.11.1 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。

7.2.11.2 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。

7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 本报告期内，经查询上海证券交易所、深圳证券交易所等机构公开信息披露平台，本基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.2.12.2 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。

7.2.12.3 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	64,370.68
2	应收清算款	433,609.26
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	497,979.94

7.2.12.4 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。

7.2.12.5 期末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股票中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2023年3月20日-2023年6月30日）

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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
7,643	58,186.69	201,030,342.02	45.20%	243,690,551.47	54.80%

8.1.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司一分红一个人分红	199,999,000.00	44.97%
2	张瀚文	2,996,846.98	0.67%
3	韦永亮	2,996,846.97	0.67%
4	谭志娟	2,996,711.98	0.67%
5	梁忠军	1,997,897.98	0.45%
6	杜建功	1,997,897.00	0.45%
7	姚湘炬	1,997,357.98	0.45%
8	高洁君	1,901,490.08	0.43%
9	姚绍鑫	1,600,038.00	0.36%
10	张淑芝	1,577,272.91	0.35%

8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	121,948.58	0.03%

8.1.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

8.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

（报告期：2023年1月1日-2023年3月19日）

8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

			比例		比例
10,217	54,421.63	203,112,294.02	36.53%	352,913,451.66	63.47%

8.2.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	199,999,000.00	35.97%
2	吴迅	10,519,908.00	1.89%
3	刘军	5,005,726.89	0.90%
4	熊英	3,496,321.47	0.63%
5	张瀚文	2,996,846.98	0.54%
6	韦永亮	2,996,846.97	0.54%
7	谭志娟	2,996,711.98	0.54%
8	姚绍鑫	2,200,038.00	0.40%
9	高洁君	2,001,490.08	0.36%
10	梁忠军	1,997,897.98	0.36%

8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	121,450.12	0.02%

8.2.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	-

注：截止本报告期末，本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为0。

9 开放式基金份额变动

9.1 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2023年3月20日-2023年6月30日）

单位：份

基金合同生效日(2020年3月20日)基金份额总额	556,025,745.68
本报告期期初基金份额总额	556,025,745.68
本报告期基金总申购份额	6,310,076.13
减:本报告期基金总赎回份额	117,614,928.32
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	444,720,893.49

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。

9.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

(报告期:2023年1月1日-2023年3月19日)

单位:份

基金合同生效日(2020年3月20日)基金份额总额	556,025,745.68
本报告期期初基金份额总额	556,025,745.68
本报告期基金总申购份额	-
减:本报告期基金总赎回份额	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	556,025,745.68

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 报告期内改聘会计师事务所情况

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 国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）

（报告期：2023年3月20日-2023年6月30日）

10.7.1.1 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	
华福证券有限责任公司	1	227,211,098.07	33.83%	211,602.34	34.11%	-
东北证券股份有限公司	1	208,436,665.99	31.04%	192,032.67	30.96%	-
中国国际金融股份有限公司	2	92,698,684.28	13.80%	86,119.82	13.88%	-
国泰君安证券股份有限公司	2	67,565,172.65	10.06%	60,531.47	9.76%	-
西部证券股份有限公司	1	42,151,253.57	6.28%	38,833.64	6.26%	-
兴业证券股份有限公司	1	33,500,180.77	4.99%	31,198.79	5.03%	-
中信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股	1	-	-	-	-	-

份有限公司						
西南证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

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

F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内租用证券公司交易单元无变更。

3、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

10.7.1.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华福证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1,999,130.00	100.00%	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

股份有限 公司						
------------	--	--	--	--	--	--

10.7.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

(报告期: 2023年1月1日-2023年3月19日)

10.7.2.1 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	
东方财富证 券股份有限 公司	1	78,485,684.09	31.61%	73,094.06	31.97%	-
华福证券有 限责任公司	1	59,642,688.72	24.02%	55,545.53	24.29%	-
东北证券股 份有限公司	1	46,234,411.04	18.62%	42,595.63	18.63%	-
西部证券股 份有限公司	1	21,862,770.00	8.81%	20,142.43	8.81%	-
西南证券股 份有限公司	1	19,419,628.40	7.82%	18,085.39	7.91%	-
国泰君安证 券股份有限 公司	2	13,544,416.70	5.46%	10,835.51	4.74%	-
中国国际金 融股份有限 公司	2	9,082,079.00	3.66%	8,367.34	3.66%	-
中信证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
华创证券有 限责任公司	1	-	-	-	-	-
东兴证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券股 份有限公司	1	-	-	-	-	-

注: 1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

A 实力雄厚, 信誉良好, 注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好, 各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范, 近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

D 内部管理规范、严格, 具备健全的内部控制制度, 并能满足基金运作高度保密的要求。

E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件, 交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求, 并能为本基金提供全面的信息服务。

F 研究实力较强, 有固定的研究机构和专门的研究人员, 能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

A 提供的研究报告质量和数量;

B 研究报告被基金采纳的情况;

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益;

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失;

E 由基金管理人提出课题, 证券经营机构提供的研究论文质量;

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况;

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况;

H 其他可评价的量化标准。

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

本报告期内租用证券公司交易单元无变更。

3、由于四舍五入的原因, 分项之和与合计项可能存在尾差。

10.7.2.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
东方财富证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华福证券有限责任公司	29,790,540.88	67.94%	-	-	-	-
东北证券股份有限公司	14,057,135.92	32.06%	-	-	-	-
西部证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华创证券有限责任公司	-	-	-	-	-	-
东兴证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合	规定网站、上海证券	2023-01-20

	型证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	交易所	
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国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金封闭运作期届满及相关安排的公告	规定报刊、规定网站、上海证券交易所	2023-03-17
4	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 基金合同	规定网站、上海证券交易所	2023-03-17
5	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 托管协议	规定网站、上海证券交易所	2023-03-17
6	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 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、上海证券交易所	2023-03-17
7	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书(更新)(2023 年第 1 号)	规定网站、上海证券交易所	2023-03-17
8	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	规定网站、上海证券交易所	2023-03-17
9	国联安科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-03-31
10	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
11	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 2023 年 1 季度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-04-22
12	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
13	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 招募说明书更新(2023 年第 2 号)	规定网站、上海证券交易所	2023-05-18
14	国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF) 基金产品资料概要更新	规定网站、上海证券交易所	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腾安基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-06-30

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 国联安科技创新混合型证券投资基金 (LOF)

11.1.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

机构	1	2023年3月20日至2023年6月30日	199,999,000.0	-	-	199,999,000.00	44.97%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

11.2 国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金

11.2.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年1月1日至2023年3月19日	199,999,000.0	-	-	199,999,000.00	35.97%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

11.3 影响投资者决策的其他重要信息

根据基金合同约定，本基金的封闭运作期将于2023年3月19日届满，本基金自2023年3月20日起进入开放期，基金名称变更为“国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）”。本基金更名

后，基金场外简称变更为“国联安科创混合（LOF）”，场内简称仍为“科创国联”，扩位证券简称变更为“国联安科创 LOF”，基金代码仍为“501096”。本基金基金合同、托管协议的修订符合相关法律法规，对基金份额持有人利益无实质性不利影响。修订的基金合同和托管协议自 2023 年 3 月 20 日起生效。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金（现国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF））发行及募集的文件
- 2、《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）基金合同》
- 3、《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）招募说明书》
- 4、《国联安科技创新混合型证券投资基金（LOF）托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日