

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

2021 年中期报告

2021 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：二〇二一年八月三十一日

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 2021 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 2021 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	48
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.....	48
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.....	48
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.....	48
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	48
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	49
8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	51
9 开放式基金份额变动.....	51
10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	55
12 备查文件目录.....	56
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)
基金简称	国联安中小综指(LOF)
场内简称	国安中小
基金主代码	162510
交易代码	162510
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2012年3月23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	5,934,947.35 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2015年5月20日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，通过严谨的数量化管理和投资纪律约束，力争保持基金净值收益率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年跟踪误差不超过 4%，为投资者提供一个投资中小板综合指数的有效工具，从而分享中国经济中长期增长的稳定收益。
投资策略	本基金采用市值优先兼顾行业分层的抽样复制的方法来复制标的指数。选择数量合理的成分股，构建目标组合，实现稳定地跟踪目标指数的目的。
业绩比较基准	95%×中小企业综合指数收益率+5%×活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为被动投资型指数基金，具有较高风险、较高预期收益的特征，其风险和预期收益均高于货币市场基金和债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	李申
	联系电话	021-38992888	021-60637102
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	021-60637111
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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	267,680.53
本期利润	187,664.00
加权平均基金份额本期利润	0.0297
本期加权平均净值利润率	2.73%
本期基金份额净值增长率	2.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,078,064.57
期末可供分配基金份额利润	0.1816
期末基金资产净值	6,674,148.31
期末基金份额净值	1.125
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	10.31%

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

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

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

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	2.46%	0.88%	2.59%	0.87%	-0.13%	0.01%
过去三个月	7.97%	0.82%	9.37%	0.84%	-1.40%	-0.02%
过去六个月	2.09%	1.12%	4.97%	1.14%	-2.88%	-0.02%
过去一年	12.05%	1.27%	19.22%	1.27%	-7.17%	0.00%
过去三年	26.69%	1.40%	39.25%	1.42%	-12.56%	-0.02%
自基金份额转换日次日起至今	10.31%	1.64%	24.59%	1.63%	-14.28%	0.01%

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

国联安中小企业综合指数证券投资基金(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

(2015年3月24日至2021年6月30日)



注：1、本基金转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金

（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”，原“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”于 2021 年 4 月 6 日更名为“国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)”；

2、本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小企业综合指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ ；

3、原国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同于 2012 年 3 月 23 日生效。本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；

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

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）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安中证 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理、上证	2016-08-19	-	19 年（自 2002 年起）	黄欣先生，硕士研究生。2003 年 10 月加入国联安基金管理有限公司，历任产品开发部经理助理、总经理特别助理、债券投资助理、基金经理助理。现任量化投资部总监助理。2010 年 4 月起担任国联安

	<p>大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理、国联安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、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理</p>			<p>中证 100 指数证券投资基金(LOF)的基金经理, 2010 年 5 月至 2012 年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理, 2010 年 11 月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2010 年 12 月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2013 年 6 月至 2017 年 3 月兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金的基金经理, 2016 年 8 月起兼任国联安中证医药 100 指数证券投资基金和国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF) (原国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF))的基金经理, 2018 年 3 月至 2019 年 7 月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 5 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 6 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2019 年 11 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 12 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 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。</p>
--	---	--	--	---

	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。				
--	-------------------------------------	--	--	--	--

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》、《国联安中小企业综合指数证券投资基金（LOF）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

2021 年上半年，在新冠疫情方面，虽然多国大力推进疫苗接种，但全球范围内疫苗分配不均，加上各类病毒变种的出现，使全球范围内经济恢复正常的预期再次推迟。我们依旧强调，由于中国政府疫情管控得当，社会全面复工复产，A 股的资产在可预见的未来，应该还是全球范围内资产配置的首选投资标的之一。股市方面，年初整体股市出现了大幅的上涨，春节之后，经历了一波较大的下跌调整，之后股市分化较大，以半导体为代表的科技类公司，在全球“缺芯”的大环境下，盈利水平有了大幅的提升，伴随而来的也是股价的大幅度反弹。

上半年大小盘股表现分化较大，小盘股表现较好。上半年沪深 300 指数上涨 0.24%，中小板综指上涨 5.19%，创业板综指上涨 14.13%。

依据基金合同的约定，本基金始终保持较高的仓位，采用抽样复制的方法跟踪标的指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.125 元，本报告期份额净值增长率为 2.09%，同期业绩比较基准收益率为 4.97%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.10%，年化跟踪误差为 2.00%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.35%，以及年化跟踪误差不超过 4.0%的限制。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

短期内全球范围新冠疫情得到完全的控制仍看不到希望，经济将复苏也存在很大的不确定性，预计全球范围内流动性依旧处于相对宽松的状态，各类资产价格预计将在高位波动。对于 A 股投资来说，当下建议选择业绩增长确定性较强的公司，多多关注在科技、医药领域的投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司内部建立估值工作小组对证券估值负责。估值工作小组由公司运营部、权益投资部、交易部、监察稽核部、风险管理部、量化投资部、研究部部门经理组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值工作小组成员 1/2 以上多数票通过，量化投资部、研究部、权益投资部对估值决策必须达成一致，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性

与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金资产净值低于 5000 万元。

基金管理人拟通过持续营销活动增加基金规模。

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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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，本基金未实施利润分配。

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 资产负债表

会计主体：国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

报告截止日：2021年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
资产：		-	-
银行存款	6.4.7.1	555,047.98	745,232.86
结算备付金		-	-
存出保证金		345.10	478.78
交易性金融资产	6.4.7.2	6,312,696.08	7,079,358.64
其中：股票投资		6,226,635.88	7,079,358.64
基金投资		-	-
债券投资		86,060.20	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		207,769.49	-
应收利息	6.4.7.5	976.51	85.95
应收股利		-	-
应收申购款		1,397.25	1,097.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		7,078,232.41	7,826,254.08
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		87,007.89	-
应付赎回款		256,480.95	14,731.30
应付管理人报酬		4,195.48	4,986.85
应付托管费		1,230.67	1,462.80
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	230.55	698.00
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	54,938.56	50,419.89
负债合计		404,084.10	72,298.84
所有者权益：		-	-
实收基金	6.4.7.9	5,596,083.74	6,634,348.67
未分配利润	6.4.7.10	1,078,064.57	1,119,606.57
所有者权益合计		6,674,148.31	7,753,955.24
负债和所有者权益总计		7,078,232.41	7,826,254.08

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.125 元，基金份额总额 5,934,947.35 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		378,123.41	1,218,459.87
1.利息收入		1,059.46	2,485.51
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,059.46	2,485.51
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）		455,957.10	149,496.67
其中：股票投资收益	6.4.7.12	411,216.36	82,670.74
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	44,740.74	66,825.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-80,016.53	1,064,626.97
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,123.38	1,850.72
减：二、费用		190,459.41	201,195.21
1. 管理人报酬		25,675.69	32,591.16

2. 托管费		7,531.49	9,560.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,368.51	3,964.39
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	154,883.72	155,079.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		187,664.00	1,017,264.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		187,664.00	1,017,264.66

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	6,634,348.67	1,119,606.57	7,753,955.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	187,664.00	187,664.00
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,038,264.93	-229,206.00	-1,267,470.93
其中：1.基金申购款	598,333.03	95,650.99	693,984.02
2.基金赎回款	-1,636,597.96	-324,856.99	-1,961,454.95
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,596,083.74	1,078,064.57	6,674,148.31
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	9,936,794.57	-527,244.01	9,409,550.56
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利	-	1,017,264.66	1,017,264.66

润)			
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,640,042.50	49,110.12	-1,590,932.38
其中: 1.基金申购款	1,098,718.23	-4,346.64	1,094,371.59
2.基金赎回款	-2,738,760.73	53,456.76	-2,685,303.97
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	8,296,752.07	539,130.77	8,835,882.84

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

国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)(原国联安双力中小板综指分级证券投资基金、国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF))(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[2011]1593 号《关于核准国联安双力中小板综指分级证券投资基金募集的批复》批准，由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安双力中小板综指分级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，在基金合同生效后三年内(含三年)为基金分级运作期，基金分级运作期届满，本基金转为上市开放式基金(LOF)，存续期不定。本基金首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 808,948,084.30 元，业经毕马威华振会计师事务所 KPMG-B(2012)CR No.0018 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》于 2012 年 3 月 23 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 809,109,186.27 份基金份额，其中认购资金利息折合 161,101.97 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《国联安双力中小板综指分级证券投资基金基金合同》及本基金的基金管理人发布的《国联安双力中小板综指分级证券投资基金封闭期届满转型后基金名称变更及转换日等事项的公告》，本基金的分级运作期自 2012 年 3 月 23 日(基金合同生效日)起至 2015 年 3 月 23 日止。自 2015 年 3 月 24 日起，国联安双力中小板综指分级证券投资基金自动转换为上市开放式基金(LOF)，并更名为“国

联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”。于基金分级运作期届满日 2015 年 3 月 23 日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金份额。本基金为上市契约型开放式，存续期限不定，转型后首日基金规模为 18,332,807.68 份基金份额。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2015]207 号核准，本基金 11,000,077.00 份基金份额于 2015 年 5 月 20 日在深交所挂牌交易。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深交所场内后即可上市流通。

根据深圳证券交易所《关于合并主板与中小板相关安排的通知》及本基金的基金管理人发布的《国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)更名的公告》。自 2021 年 4 月 6 日起，国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)更名为“国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)”，将国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的标的指数名称由“中小板综合指数”调整为“中小企业综合指数”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为包括标的指数成份股及其备选成份股、新股(包含原中小板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、权证、股指期货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的相关规定)。基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等；权证以及其他金融工具的投资比例符合法律法规和中国证监会的规定。本基金业绩比较基准为： $95\% \times \text{中小企业综合指数收益率} + 5\% \times \text{活期存款利率(税后)}$ 。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连

续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2021 年 6 月 30 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并在评估后续处理方案，故本财务报表仍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 2021 上半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 2021 年 6 月 30 日的财务状况以及 2021 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内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[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生

的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、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。

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	活期存款	555,047.98
定期存款	-	
其他存款	-	
合计	555,047.98	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	4,548,151.33	6,226,635.88	1,678,484.55
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	86,086.00	86,060.20
	银行间市场	-	-
	合计	86,086.00	86,060.20
资产支持证券	-	-	-

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	4,634,237.33	6,312,696.08	1,678,458.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	54.51
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	921.80
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	0.20
合计	976.51

注：此处其他列示的是深交所结算保证金利息。

6.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	230.55
银行间市场应付交易费用	-
合计	230.55

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	57.33
应付证券出借违约金	-
应付指数使用费	333.26
预提审计费	24,795.19
预提上市费	29,752.78
合计	54,938.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,035,908.86	6,634,348.67
本期申购	634,564.63	598,333.03
本期赎回（以“-”号填列）	-1,735,526.14	-1,636,597.96
本期末	5,934,947.35	5,596,083.74

注：此处申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,368,604.15	-1,248,997.58	1,119,606.57
本期利润	267,680.53	-80,016.53	187,664.00
本期基金份额交易产生的变动数	-387,456.31	158,250.31	-229,206.00
其中：基金申购款	231,241.27	-135,590.28	95,650.99
基金赎回款	-618,697.58	293,840.59	-324,856.99
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,248,828.37	-1,170,763.80	1,078,064.57

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,055.93
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	-
其他	3.53
合计	1,059.46

注：此处其他列示的是基金上交所与深交所结算保证金利息以及基金申购款滞留利息。

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,183,948.39
减：卖出股票成本总额	772,732.03
买卖股票差价收入	411,216.36

6.4.7.13 债券投资收益**6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成**

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	44,740.74
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	44,740.74

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-80,016.53
——股票投资	-79,990.73
——债券投资	-25.80
——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	-80,016.53

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,123.38
合计	1,123.38

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	2,368.51
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-

其中：申购费	-
赎回费	-
合计	2,368.51

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	-
证券出借违约金	-
上市费	29,752.78
其他费用	-
银行汇划费用	410.00
指数使用费	99,925.75
合计	154,883.72

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人、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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,675.69	32,591.16
其中：支付销售机构的客户维护费	7,749.64	12,188.50

注：在本基金分级运作期到期后，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 0.75%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金管理费=前一日基金资产净值×0.75%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,531.49	9,560.04

注：支付基金托管人建设银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.22%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：每日应计提的基金托管费=前一日基金资产净值×0.22%/

当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方发生转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人以外的其他关联方均未投资本基金。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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	555,047.98	1,055.93	745,664.06	2,481.85

注：本基金通过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2021年6月30日无相关余额（2020年6月30日无相关余额）。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未实施利润分配。

6.4.12 期末（2021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

本报告期末本基金未持有因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021-06-16	重大事项	5.59	2021-07-06	6.15	4,200.00	48,618.87	23,478.00	-

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**

本报告期末本基金无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本报告期末本基金无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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 2021 年 06 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%（2020 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 06 月 30 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.35%。

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。于 2021 年 06 月 30 日，本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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 2021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	555,047.98	-	-	-	-	-	555,047.98
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	345.10	-	-	-	-	-	345.10
交易性金融资产	-	-	86,060.20	-	-	6,226,635.88	6,312,696.08
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	207,769.49	207,769.49
应收利息	-	-	-	-	-	976.51	976.51
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,397.25	1,397.25
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	555,393.08	-	86,060.20	-	-	6,436,779.13	7,078,232.41
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	87,007.89	87,007.89
应付赎回款	-	-	-	-	-	256,480.95	256,480.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,195.48	4,195.48
应付托管费	-	-	-	-	-	1,230.67	1,230.67
应付交易费用	-	-	-	-	-	230.55	230.55
应交税费	-	-	-	-	-	-	-

应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	54,938.56	54,938.56
负债总计	-	-	-	-	-	404,084.10	404,084.10
利率敏感度缺口	555,393.08	-	86,060.20	-	-	6,032,695.03	6,674,148.31
上年度末 2020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	745,232.86	-	-	-	-	-	745,232.86
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	478.78	-	-	-	-	-	478.78
交易性金融资产	-	-	-	-	-	7,079,358.64	7,079,358.64
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	85.95	85.95
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,097.85	1,097.85
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	745,711.64	-	-	-	-	7,080,542.44	7,826,254.08
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	14,731.30	14,731.30
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,986.85	4,986.85
应付托管	-	-	-	-	-	1,462.80	1,462.80

费							
应付交易费用	-	-	-	-	-	698.00	698.00
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	50,419.89	50,419.89
负债总计	-	-	-	-	-	72,298.84	72,298.84
利率敏感度缺口	745,711.64	-	-	-	-	7,008,243.60	7,753,955.24

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 2021 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 1.29%(2020 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(2020 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。

本基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用抽样复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。本基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中所持有的股票市值和买入、卖出股指期货合约价值，合计(轧差计算)占基金资产的比例为 85%—100%，其中投资于股票的资产不低于基金资产的 85%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的 90%；每个

交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	6,226,635.88	93.29	7,079,358.64	91.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	86,060.20	1.29	-	-
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	6,312,696.08	94.58	7,079,358.64	91.30

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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 324,556.76	增加 389,131.50
	业绩比较基准下降 5%	减少 324,556.76	减少 389,131.50

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	6,226,635.88	87.97

	其中：股票	6,226,635.88	87.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	86,060.20	1.22
	其中：债券	86,060.20	1.22
	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	555,047.98	7.84
8	其他各项资产	210,488.35	2.97
9	合计	7,078,232.41	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 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	119,718.13	1.79
B	采矿业	40,003.58	0.60
C	制造业	4,838,968.85	72.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	23,426.81	0.35
E	建筑业	60,396.23	0.90
F	批发和零售业	114,879.89	1.72
G	交通运输、仓储和邮政业	99,200.61	1.49
H	住宿和餐饮业	4,832.52	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	477,238.28	7.15

J	金融业	225,470.47	3.38
K	房地产业	38,356.75	0.57
L	租赁和商务服务业	112,886.01	1.69
M	科学研究和技术服务业	3,056.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	22,061.55	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,807.00	0.31
Q	卫生和社会工作	8,199.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	17,134.20	0.26
S	综合	-	-
	合计	6,226,635.88	93.29

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

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

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	002415	海康威视	4,367	281,671.50	4.22
2	002594	比亚迪	854	214,354.00	3.21
3	002304	洋河股份	862	178,606.40	2.68
4	002049	紫光国微	900	138,771.00	2.08
5	002371	北方华创	500	138,690.00	2.08
6	002475	立讯精密	2,798	128,708.00	1.93
7	002142	宁波银行	2,645	103,075.65	1.54
8	002493	荣盛石化	4,513	77,939.51	1.17
9	002821	凯莱英	200	74,520.00	1.12
10	002027	分众传媒	7,700	72,457.00	1.09
11	002311	海大集团	881	71,889.60	1.08
12	002568	百润股份	700	66,353.00	0.99
13	002714	牧原股份	1,075	65,381.50	0.98

14	002230	科大讯飞	950	64,201.00	0.96
15	002179	中航光电	800	63,216.00	0.95
16	002129	中环股份	1,448	55,892.80	0.84
17	002271	东方雨虹	1,009	55,817.88	0.84
18	002410	广联达	800	54,560.00	0.82
19	002352	顺丰控股	800	54,160.00	0.81
20	002736	国信证券	4,400	47,300.00	0.71
21	002648	卫星石化	1,120	43,892.80	0.66
22	002032	苏泊尔	672	42,866.88	0.64
23	002508	老板电器	835	38,827.50	0.58
24	002626	金达威	836	37,369.20	0.56
25	002241	歌尔股份	872	37,269.28	0.56
26	002353	杰瑞股份	785	35,089.50	0.53
27	002541	鸿路钢构	600	35,010.00	0.52
28	002025	航天电器	688	34,516.96	0.52
29	002050	三花智控	1,427	34,219.46	0.51
30	002138	顺络电子	850	32,954.50	0.49
31	002223	鱼跃医疗	850	32,410.50	0.49
32	002008	大族激光	800	32,312.00	0.48
33	002557	洽洽食品	736	31,721.60	0.48
34	002007	华兰生物	850	31,178.00	0.47
35	002430	杭氧股份	884	30,577.56	0.46
36	002601	龙佰集团	883	30,534.14	0.46
37	002507	涪陵榨菜	800	30,128.00	0.45
38	002459	晶澳科技	600	29,400.00	0.44
39	002414	高德红外	1,058	29,179.64	0.44
40	002690	美亚光电	500	27,880.00	0.42
41	002444	巨星科技	806	27,468.48	0.41
42	002180	纳思达	850	27,370.00	0.41
43	002407	多氟多	750	26,655.00	0.40
44	002001	新和成	918	26,328.24	0.39
45	002294	信立泰	798	26,254.20	0.39
46	002242	九阳股份	800	25,992.00	0.39
47	002603	以岭药业	865	25,223.40	0.38
48	002028	思源电气	806	24,816.74	0.37
49	002511	中顺洁柔	884	24,354.20	0.36
50	002597	金禾实业	700	24,290.00	0.36
51	002080	中材科技	921	24,102.57	0.36
52	002024	苏宁易购	4,200	23,478.00	0.35
53	002439	启明星辰	800	23,208.00	0.35
54	002250	联化科技	827	23,073.30	0.35
55	002153	石基信息	973	22,875.23	0.34
56	002624	完美世界	950	22,714.50	0.34
57	002030	达安基因	1,047	22,238.28	0.33

58	002683	宏大爆破	800	22,216.00	0.33
59	002202	金风科技	1,739	21,146.24	0.32
60	002240	盛新锂能	729	20,812.95	0.31
61	002299	圣农发展	870	20,775.60	0.31
62	002236	大华股份	972	20,509.20	0.31
63	002281	光迅科技	800	19,680.00	0.29
64	002156	通富微电	808	19,424.32	0.29
65	002151	北斗星通	450	19,381.50	0.29
66	002572	索菲亚	800	19,360.00	0.29
67	002555	三七互娱	800	19,216.00	0.29
68	002402	和而泰	800	19,176.00	0.29
69	002158	汉钟精机	700	18,795.00	0.28
70	002595	豪迈科技	700	18,690.00	0.28
71	002773	康弘药业	800	18,504.00	0.28
72	002612	朗姿股份	342	18,474.84	0.28
73	002497	雅化集团	800	18,224.00	0.27
74	002258	利尔化学	700	18,060.00	0.27
75	002245	蔚蓝锂芯	900	17,730.00	0.27
76	002389	航天彩虹	800	17,464.00	0.26
77	002254	泰和新材	856	17,351.12	0.26
78	002013	中航机电	1,700	17,119.00	0.26
79	002372	伟星新材	825	17,052.75	0.26
80	002340	格林美	1,820	17,017.00	0.25
81	002422	科伦药业	846	16,877.70	0.25
82	002675	东诚药业	801	16,877.07	0.25
83	002607	中公教育	800	16,712.00	0.25
84	002384	东山精密	799	16,651.16	0.25
85	002326	永太科技	821	16,411.79	0.25
86	002287	奇正藏药	605	16,316.85	0.24
87	002585	双星新材	800	16,104.00	0.24
88	002643	万润股份	900	16,002.00	0.24
89	002212	天融信	800	15,816.00	0.24
90	002747	埃斯顿	400	15,620.00	0.23
91	002268	卫士通	800	15,584.00	0.23
92	002916	深南电路	140	15,558.20	0.23
93	002338	奥普光电	800	15,536.00	0.23
94	002396	星网锐捷	713	15,222.55	0.23
95	002653	海思科	700	15,064.00	0.23
96	002625	光启技术	720	14,983.20	0.22
97	002646	青青稞酒	687	14,935.38	0.22
98	002368	太极股份	740	14,844.40	0.22
99	002048	宁波华翔	759	14,800.50	0.22
100	002463	沪电股份	948	14,665.56	0.22
101	002185	华天科技	941	14,481.99	0.22

102	002139	拓邦股份	800	14,392.00	0.22
103	002152	广电运通	1,097	14,293.91	0.21
104	002184	海得控制	1,167	14,249.07	0.21
105	002739	万达电影	900	14,211.00	0.21
106	002382	蓝帆医疗	672	14,011.20	0.21
107	002123	梦网科技	770	13,906.20	0.21
108	002019	亿帆医药	800	13,800.00	0.21
109	002174	游族网络	800	13,736.00	0.21
110	002216	三全食品	816	13,439.52	0.20
111	002399	海普瑞	841	13,397.13	0.20
112	002373	千方科技	800	13,360.00	0.20
113	002078	太阳纸业	1,000	13,350.00	0.20
114	002727	一心堂	400	13,244.00	0.20
115	002925	盈趣科技	340	13,229.40	0.20
116	002064	华峰化学	910	12,922.00	0.19
117	002534	杭锅股份	866	12,860.10	0.19
118	002851	麦格米特	400	12,492.00	0.19
119	002429	兆驰股份	2,055	12,473.85	0.19
120	002841	视源股份	100	12,429.00	0.19
121	002617	露笑科技	921	12,415.08	0.19
122	002022	科华生物	682	12,214.62	0.18
123	002614	奥佳华	539	12,197.57	0.18
124	002262	恩华药业	793	12,172.55	0.18
125	002041	登海种业	805	12,163.55	0.18
126	002056	横店东磁	932	12,116.00	0.18
127	002023	海特高新	810	12,085.20	0.18
128	002484	江海股份	778	12,043.44	0.18
129	002558	巨人网络	900	11,970.00	0.18
130	002157	正邦科技	1,000	11,950.00	0.18
131	002673	西部证券	1,444	11,913.00	0.18
132	002405	四维图新	805	11,833.50	0.18
133	002293	罗莱生活	881	11,796.59	0.18
134	002201	九鼎新材	756	11,755.80	0.18
135	002273	水晶光电	800	11,752.00	0.18
136	002797	第一创业	1,640	11,709.60	0.18
137	002145	中核钛白	900	11,655.00	0.17
138	002092	中泰化学	1,113	11,430.51	0.17
139	002737	葵花药业	700	11,424.00	0.17
140	002408	齐翔腾达	916	11,376.72	0.17
141	002581	未名医药	622	11,307.96	0.17
142	002695	煌上煌	712	11,270.96	0.17
143	002079	苏州固锴	874	11,012.40	0.17
144	002346	柘中股份	600	10,878.00	0.16
145	002698	博实股份	850	10,820.50	0.16

146	002938	鹏鼎控股	300	10,764.00	0.16
147	002075	沙钢股份	980	10,691.80	0.16
148	002563	森马服饰	886	10,587.70	0.16
149	002332	仙琚制药	842	10,558.68	0.16
150	002518	科士达	731	10,504.47	0.16
151	002705	新宝股份	400	10,500.00	0.16
152	002428	云南锗业	834	10,333.26	0.15
153	002127	南极电商	1,050	10,258.50	0.15
154	002600	领益智造	1,108	10,182.52	0.15
155	002465	海格通信	1,074	10,160.04	0.15
156	002203	海亮股份	949	10,097.36	0.15
157	002182	云海金属	836	10,015.28	0.15
158	002082	万邦德	800	9,888.00	0.15
159	002456	欧菲光	1,100	9,768.00	0.15
160	002222	福晶科技	600	9,726.00	0.15
161	002544	杰赛科技	726	9,684.84	0.15
162	002331	皖通科技	788	9,684.52	0.15
163	002169	智光电气	800	9,664.00	0.14
164	002106	莱宝高科	858	9,652.50	0.14
165	002926	华西证券	1,000	9,630.00	0.14
166	002318	久立特材	800	9,616.00	0.14
167	002237	恒邦股份	835	9,594.15	0.14
168	002010	传化智联	1,244	9,591.24	0.14
169	002436	兴森科技	864	9,504.00	0.14
170	002146	荣盛发展	1,683	9,492.12	0.14
171	002390	信邦制药	900	9,432.00	0.14
172	002191	劲嘉股份	884	9,405.76	0.14
173	002506	协鑫集成	2,700	9,396.00	0.14
174	002745	木林森	700	9,380.00	0.14
175	002481	双塔食品	800	9,248.00	0.14
176	002221	东华能源	836	9,154.20	0.14
177	002670	国盛金控	800	9,112.00	0.14
178	002416	爱施德	900	9,027.00	0.14
179	002531	天顺风能	1,031	8,918.15	0.13
180	002128	露天煤业	853	8,879.73	0.13
181	002301	齐心集团	883	8,865.32	0.13
182	002556	辉隆股份	813	8,821.05	0.13
183	002275	桂林三金	649	8,793.95	0.13
184	002461	珠江啤酒	796	8,708.24	0.13
185	002726	龙大肉食	860	8,703.20	0.13
186	002233	塔牌集团	832	8,552.96	0.13
187	002081	金螳螂	1,076	8,521.92	0.13
188	002647	仁东控股	761	8,386.22	0.13
189	002733	雄韬股份	500	8,280.00	0.12

190	002449	国星光电	818	8,261.80	0.12
191	002038	双鹭药业	784	8,255.52	0.12
192	002063	远光软件	1,043	8,250.13	0.12
193	002386	天原股份	797	8,209.10	0.12
194	002044	美年健康	900	8,199.00	0.12
195	002602	世纪华通	1,262	8,102.04	0.12
196	002378	章源钨业	858	8,048.04	0.12
197	002635	安洁科技	550	8,046.50	0.12
197	002088	鲁阳节能	350	8,046.50	0.12
199	002335	科华数据	353	8,037.81	0.12
200	002261	拓维信息	790	8,034.30	0.12
201	002017	东信和平	700	8,001.00	0.12
202	002065	东华软件	1,000	7,930.00	0.12
203	002043	兔宝宝	800	7,888.00	0.12
204	002099	海翔药业	968	7,811.76	0.12
205	002664	长鹰信质	500	7,805.00	0.12
206	002020	京新药业	917	7,794.50	0.12
207	002317	众生药业	878	7,559.58	0.11
208	002091	江苏国泰	828	7,534.80	0.11
209	002097	山河智能	876	7,516.08	0.11
210	002458	益生股份	750	7,477.50	0.11
211	002777	久远银海	420	7,429.80	0.11
212	002440	闰土股份	839	7,425.15	0.11
213	002111	威海广泰	400	7,252.00	0.11
214	002039	黔源电力	500	7,240.00	0.11
215	002376	新北洋	792	7,238.88	0.11
216	002232	启明信息	607	7,174.74	0.11
217	002171	楚江新材	818	7,141.14	0.11
218	002100	天康生物	800	7,128.00	0.11
219	002120	韵达股份	520	7,035.60	0.11
220	002782	可立克	600	7,026.00	0.11
221	002045	国光电器	562	6,991.28	0.10
222	002498	汉缆股份	1,940	6,945.20	0.10
223	002661	克明食品	500	6,920.00	0.10
224	002945	华林证券	500	6,910.00	0.10
225	002385	大北农	1,016	6,908.80	0.10
226	002187	广百股份	855	6,840.00	0.10
227	002312	川发龙蟒	800	6,832.00	0.10
228	002649	博彦科技	650	6,825.00	0.10
229	002375	亚厦股份	853	6,755.76	0.10
230	002425	凯撒文化	800	6,696.00	0.10
231	002135	东南网架	871	6,663.15	0.10
232	002119	康强电子	400	6,632.00	0.10
233	002155	湖南黄金	853	6,610.75	0.10

234	002364	中恒电气	800	6,608.00	0.10
235	002302	西部建设	832	6,572.80	0.10
236	002912	中新赛克	160	6,555.20	0.10
237	002320	海峡股份	1,107	6,498.09	0.10
238	002055	得润电子	500	6,490.00	0.10
239	002434	万里扬	800	6,488.00	0.10
240	002177	御银股份	851	6,459.09	0.10
241	002322	理工环科	571	6,423.75	0.10
242	002605	姚记科技	293	6,407.91	0.10
243	002423	中粮资本	700	6,335.00	0.09
244	002183	怡亚通	1,100	6,303.00	0.09
245	002035	华帝股份	859	6,201.98	0.09
246	002419	天虹股份	937	6,146.72	0.09
247	002014	永新股份	710	6,141.50	0.09
248	002678	珠江钢琴	877	6,112.69	0.09
249	002107	沃华医药	811	6,082.50	0.09
250	002641	永高股份	878	6,058.20	0.09
251	002488	金固股份	987	6,030.57	0.09
252	002672	东江环保	800	5,992.00	0.09
253	002545	东方铁塔	795	5,978.40	0.09
254	002636	金安国纪	368	5,968.96	0.09
255	002251	步步高	805	5,924.80	0.09
256	002195	二三四五	2,906	5,899.18	0.09
257	002413	雷科防务	880	5,896.00	0.09
258	002006	精工科技	698	5,891.12	0.09
259	002424	贵州百灵	800	5,888.00	0.09
260	002276	万马股份	881	5,876.27	0.09
261	002313	日海智能	500	5,855.00	0.09
262	002117	东港股份	696	5,839.44	0.09
263	002505	鹏都农牧	2,600	5,824.00	0.09
264	002167	东方锆业	837	5,783.67	0.09
265	002367	康力电梯	642	5,739.48	0.09
266	002110	三钢闽光	850	5,729.00	0.09
267	002539	云图控股	652	5,691.96	0.09
268	002226	江南化工	1,109	5,678.08	0.09
269	002068	黑猫股份	748	5,677.32	0.09
270	002520	日发精机	734	5,673.82	0.09
271	002131	利欧股份	2,400	5,616.00	0.08
272	002362	汉王科技	272	5,603.20	0.08
273	002285	世联行	911	5,584.43	0.08
274	002939	长城证券	500	5,565.00	0.08
275	002267	陕天然气	808	5,550.96	0.08
276	002095	生意宝	400	5,544.00	0.08
277	002479	富春环保	855	5,531.85	0.08

278	002383	合众思壮	700	5,523.00	0.08
279	002016	世荣兆业	866	5,516.42	0.08
280	002208	合肥城建	692	5,501.40	0.08
281	002012	凯恩股份	988	5,483.40	0.08
282	002538	司尔特	800	5,480.00	0.08
283	002085	万丰奥威	972	5,443.20	0.08
284	002567	唐人神	815	5,387.15	0.08
285	002154	报喜鸟	843	5,369.91	0.08
286	002093	国脉科技	853	5,348.31	0.08
287	002395	双象股份	450	5,346.00	0.08
288	002101	广东鸿图	650	5,330.00	0.08
289	002327	富安娜	682	5,278.68	0.08
290	002590	万安科技	686	5,275.34	0.08
291	002108	沧州明珠	955	5,262.05	0.08
292	002292	奥飞娱乐	812	5,261.76	0.08
293	002543	万和电气	706	5,259.70	0.08
294	002309	中利集团	842	5,254.08	0.08
295	002249	大洋电机	1,000	5,250.00	0.08
296	002029	七匹狼	786	5,234.76	0.08
297	002398	垒知集团	734	5,233.42	0.08
298	002446	盛路通信	800	5,200.00	0.08
298	002126	银轮股份	500	5,200.00	0.08
300	002432	九安医疗	691	5,168.68	0.08
301	002051	中工国际	810	5,159.70	0.08
302	002130	沃尔核材	800	5,112.00	0.08
303	002004	华邦健康	823	5,110.83	0.08
304	002608	江苏国信	800	5,104.00	0.08
305	002140	东华科技	692	5,093.12	0.08
306	002238	天威视讯	801	5,062.32	0.08
307	002746	仙坛股份	750	5,047.50	0.08
308	002443	金洲管道	800	5,040.00	0.08
309	002274	华昌化工	500	5,035.00	0.08
310	002631	德尔未来	800	5,008.00	0.08
311	002206	海利得	805	4,999.05	0.07
312	002011	盾安环境	844	4,954.28	0.07
313	002522	浙江众成	788	4,932.88	0.07
314	002298	中电兴发	688	4,912.32	0.07
315	002639	雪人股份	700	4,900.00	0.07
316	002674	兴业科技	381	4,895.85	0.07
317	002189	中光学	300	4,875.00	0.07
318	002218	拓日新能	808	4,872.24	0.07
319	002355	兴民智通	800	4,848.00	0.07
320	002244	滨江集团	1,156	4,843.64	0.07
321	002701	奥瑞金	941	4,836.74	0.07

322	002266	浙富控股	969	4,835.31	0.07
323	002186	全聚德	462	4,832.52	0.07
324	002057	中钢天源	700	4,823.00	0.07
325	002239	奥特佳	1,300	4,810.00	0.07
326	002536	飞龙股份	600	4,800.00	0.07
327	002243	力合科创	500	4,755.00	0.07
328	002003	伟星股份	760	4,742.40	0.07
329	002577	雷柏科技	400	4,688.00	0.07
330	002798	帝欧家居	300	4,674.00	0.07
331	002400	省广集团	900	4,671.00	0.07
332	002588	史丹利	880	4,664.00	0.07
333	002570	贝因美	800	4,648.00	0.07
334	002435	长江健康	820	4,633.00	0.07
335	002668	奥马电器	834	4,595.34	0.07
336	002096	南岭民爆	569	4,569.07	0.07
337	002657	中科金财	400	4,544.00	0.07
338	002115	三维通信	795	4,539.45	0.07
339	002610	爱康科技	1,900	4,522.00	0.07
340	002234	民和股份	300	4,509.00	0.07
341	002215	诺普信	800	4,496.00	0.07
342	002104	恒宝股份	759	4,493.28	0.07
343	002059	云南旅游	800	4,480.00	0.07
344	002300	太阳电缆	790	4,455.60	0.07
345	002752	昇兴股份	800	4,448.00	0.07
346	002411	延安必康	800	4,424.00	0.07
347	002474	榕基软件	685	4,404.55	0.07
348	002197	证通电子	600	4,404.00	0.07
349	002161	远望谷	800	4,384.00	0.07
350	002283	天润工业	790	4,376.60	0.07
351	002345	潮宏基	834	4,370.16	0.07
352	002548	金新农	755	4,363.90	0.07
353	002696	百洋股份	844	4,363.48	0.07
354	002839	张家港行	800	4,352.00	0.07
355	002462	嘉事堂	323	4,337.89	0.06
356	002537	海联金汇	794	4,335.24	0.06
357	002002	鸿达兴业	1,100	4,323.00	0.06
358	002559	亚威股份	648	4,322.16	0.06
359	002393	力生制药	231	4,315.08	0.06
360	002042	华孚时尚	885	4,274.55	0.06
361	002412	汉森制药	700	4,242.00	0.06
362	002546	新联电子	1,137	4,241.01	0.06
363	002516	旷达科技	800	4,240.00	0.06
364	002455	百川股份	540	4,217.40	0.06
365	002053	云南能投	546	4,187.82	0.06

366	002627	宜昌交运	675	4,158.00	0.06
367	002073	软控股份	855	4,146.75	0.06
368	002573	清新环境	800	4,128.00	0.06
368	002349	精华制药	800	4,128.00	0.06
370	002521	齐峰新材	634	4,121.00	0.06
371	002622	融钰集团	854	4,116.28	0.06
372	002697	红旗连锁	800	4,112.00	0.06
373	002381	双箭股份	500	4,110.00	0.06
374	002621	美吉姆	780	4,095.00	0.06
375	002406	远东传动	636	4,089.48	0.06
376	002404	嘉欣丝绸	638	4,083.20	0.06
377	002441	众业达	518	4,061.12	0.06
378	002540	亚太科技	830	4,042.10	0.06
379	002483	润邦股份	839	4,035.59	0.06
380	002583	海能达	800	4,032.00	0.06
381	002596	海南瑞泽	832	4,018.56	0.06
382	002339	积成电子	665	4,009.95	0.06
383	002685	华东重机	828	4,007.52	0.06
384	002609	捷顺科技	400	4,004.00	0.06
385	002307	北新路桥	880	3,977.60	0.06
386	002217	合力泰	1,100	3,927.00	0.06
387	002451	摩恩电气	615	3,905.25	0.06
388	002083	孚日股份	882	3,810.24	0.06
389	002468	申通快递	500	3,810.00	0.06
390	002369	卓翼科技	667	3,721.86	0.06
391	002181	粤传媒	867	3,710.76	0.06
392	002611	东方精工	800	3,704.00	0.06
393	002457	青龙管业	400	3,656.00	0.05
394	002589	瑞康医药	825	3,654.75	0.05
395	002204	大连重工	994	3,647.98	0.05
396	002308	威创股份	856	3,638.00	0.05
397	002667	鞍重股份	256	3,596.80	0.05
398	002478	常宝股份	800	3,592.00	0.05
399	002054	德美化工	331	3,591.35	0.05
400	002392	北京利尔	818	3,582.84	0.05
401	002492	恒基达鑫	652	3,559.92	0.05
402	002547	春兴精工	800	3,552.00	0.05
403	002433	太安堂	787	3,541.50	0.05
404	002062	宏润建设	853	3,531.42	0.05
405	002391	长青股份	500	3,505.00	0.05
406	002467	二六三	800	3,504.00	0.05
407	002141	贤丰控股	846	3,493.98	0.05
408	002421	达实智能	900	3,456.00	0.05
409	002565	顺灏股份	878	3,450.54	0.05

410	002533	金杯电工	669	3,438.66	0.05
411	002584	西陇科学	585	3,416.40	0.05
412	002550	千红制药	832	3,411.20	0.05
413	002519	银河电子	810	3,410.10	0.05
414	002528	英飞拓	878	3,380.30	0.05
415	002328	新朋股份	709	3,360.66	0.05
416	002676	顺威股份	798	3,343.62	0.05
417	002060	粤水电	958	3,343.42	0.05
418	002365	永安药业	329	3,342.64	0.05
419	002303	美盈森	952	3,341.52	0.05
420	002394	联发股份	408	3,333.36	0.05
421	002510	天汽模	800	3,304.00	0.05
422	002491	通鼎互联	848	3,290.24	0.05
423	002310	东方园林	960	3,273.60	0.05
424	002564	天沃科技	818	3,263.82	0.05
425	002796	世嘉科技	300	3,243.00	0.05
426	002228	合兴包装	864	3,240.00	0.05
427	002662	京威股份	930	3,236.40	0.05
428	002160	常铝股份	800	3,232.00	0.05
429	002344	海宁皮城	793	3,227.51	0.05
430	002476	宝莫股份	759	3,210.57	0.05
431	002587	奥拓电子	650	3,191.50	0.05
432	002574	明牌珠宝	696	3,111.12	0.05
433	002360	同德化工	401	3,099.73	0.05
434	002165	红宝丽	666	3,096.90	0.05
435	002178	延华智能	800	3,056.00	0.05
436	002170	芭田股份	789	2,990.31	0.04
437	002087	新野纺织	882	2,989.98	0.04
438	002489	浙江永强	851	2,987.01	0.04
439	002314	南山控股	882	2,937.06	0.04
440	002485	希努尔	672	2,936.64	0.04
441	002148	北纬科技	640	2,931.20	0.04
442	002343	慈文传媒	580	2,923.20	0.04
443	002047	宝鹰股份	792	2,779.92	0.04
444	002452	长高集团	500	2,730.00	0.04
445	002277	友阿股份	786	2,719.56	0.04
446	002580	圣阳股份	385	2,687.30	0.04
447	002654	万润科技	700	2,667.00	0.04
448	002628	成都路桥	768	2,618.88	0.04
449	002211	宏达新材	499	2,559.87	0.04
450	002620	瑞和股份	340	2,543.20	0.04
451	002689	远大智能	836	2,533.08	0.04
452	002316	亚联发展	476	2,522.80	0.04
453	002578	闽发铝业	794	2,516.98	0.04

454	002417	深南股份	386	2,466.54	0.04
455	002366	台海核电	692	2,463.52	0.04
456	002542	中化岩土	800	2,416.00	0.04
457	002717	岭南股份	800	2,408.00	0.04
458	002593	日上集团	646	2,403.12	0.04
459	002431	棕榈股份	807	2,348.37	0.04
460	002482	广田集团	815	2,347.20	0.04
461	002437	誉衡药业	900	2,331.00	0.03
462	002471	中超控股	800	2,320.00	0.03
463	002554	惠博普	806	2,297.10	0.03
464	002377	国创高新	666	2,291.04	0.03
465	002118	紫鑫药业	854	2,288.72	0.03
466	002682	龙洲股份	650	2,249.00	0.03
467	002305	南国置业	1,112	2,190.64	0.03
468	002374	中锐股份	820	2,189.40	0.03
469	002665	首航高科	1,008	2,177.28	0.03
470	002037	保利联合	363	2,167.11	0.03
471	002231	奥维通信	400	2,144.00	0.03
472	002347	泰尔股份	496	2,117.92	0.03
473	002325	洪涛股份	833	2,082.50	0.03
474	002495	佳隆股份	860	1,995.20	0.03
475	002523	天桥起重	856	1,951.68	0.03
476	002295	精艺股份	285	1,946.55	0.03
477	002348	高乐股份	800	1,920.00	0.03
478	002031	巨轮智能	1,034	1,850.86	0.03
479	002630	华西能源	790	1,738.00	0.03
480	002694	顾地科技	660	1,689.60	0.03
481	002591	恒大高新	300	1,686.00	0.03
482	002494	华斯股份	446	1,623.44	0.02
483	002503	搜于特	926	1,453.82	0.02
484	002663	普邦股份	800	1,424.00	0.02
485	002807	江阴银行	300	1,182.00	0.02
486	002144	宏达高科	100	914.00	0.01
487	002209	达意隆	100	683.00	0.01

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

本报告期内本基金没有股票买入。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	113,109.00	1.46
2	002714	牧原股份	65,482.00	0.84
3	002475	立讯精密	52,805.00	0.68
4	002142	宁波银行	50,674.00	0.65
5	002493	荣盛石化	38,569.00	0.50
6	002027	分众传媒	37,017.00	0.48
7	002241	歌尔股份	32,596.00	0.42
8	002129	中环股份	29,790.00	0.38
9	002074	国轩高科	29,450.00	0.38
10	002594	比亚迪	25,260.00	0.33
11	002049	紫光国微	24,308.00	0.31
12	002736	国信证券	22,061.00	0.28
13	002304	洋河股份	21,703.00	0.28
14	002050	三花智控	20,126.00	0.26
15	002001	新 和 成	16,960.00	0.22
16	002271	东方雨虹	15,150.00	0.20
17	002311	海大集团	14,833.00	0.19
18	002007	华兰生物	14,824.00	0.19
19	002078	太阳纸业	12,656.00	0.16
20	002414	高德红外	12,362.00	0.16

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	-
卖出股票的收入（成交）总额	1,183,948.39

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比 例(%)
1	国家债券	86,060.20	1.29
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	86,060.20	1.29

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019649	21 国债 01	860	86,060.20	1.29

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期末本基金未持有股指期货，没有相关投资政策。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

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

宁波银行（002142）的发行主体宁波银行股份有限公司，因作为债务融资工具主承销商，在相关债务融资工具承销及发行工作开展中存在以不正当手段承揽业务、发行工作程序执行不到位、未按照规定开展询价工作等违反银行间市场相关自律管理规则的行为，于 2020 年 12 月 31 日被交易商协会采取警告、暂停债务融资工具相关业务、责令整改的行政监管措施。

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	345.10
2	应收证券清算款	207,769.49
3	应收股利	-
4	应收利息	976.51
5	应收申购款	1,397.25
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	210,488.35

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票，不存在积极投资前五名股票流通受限情况。

8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
596	9,957.97	0.00	0.00%	5,934,947.35	100.00%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	郑淑女	932,651.00	15.71%
2	李锦山	543,778.00	9.16%
3	朱洪宏	348,595.00	5.87%
4	许海燕	188,278.00	3.17%
5	陈春宁	188,269.00	3.17%
6	肖瑞华	137,044.00	2.31%
7	巫祖文	126,952.29	2.14%
8	李桂荣	123,542.00	2.08%
9	黄欣	119,647.38	2.02%
10	黄国跃	100,000.00	1.68%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

8.3 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	119,647.38	2.02%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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	-
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 3 月 23 日）基金份额总额	809,109,186.27
本报告期期初基金份额总额	7,035,908.86
本报告期基金总申购份额	634,564.63
减：本报告期基金总赎回份额	1,735,526.14
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,934,947.35

注：1、本基金份额转换日为 2015 年 3 月 23 日，在转换日日终，国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 A 份额（基金代码：150069）、国联安双力中小板综指分级证券投资基金之 B 份额（基金代码：150070）的基金份额以各自的基金份额为基准转换为国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）的基金份额。自 2015 年 3 月 24 日起，本基金的基金名称变更为“国联安双力中小板综指证券投资基金（LOF）”，原“国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)”于 2021 年 4 月 6 日更名为“国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)”；

2、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

1、2021 年 2 月 18 日,基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》,李柯女士不再担任公司副总经理(财务总监、首席运营官)及首席信息官职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国信证券股份有限公司	1	1,183,948.39	100.00%	1,078.95	100.00%	-
东北证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
安信证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
第一创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

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的交易单元无变更。

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		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

国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东北证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
安信证券股份 有限公司	86,086.00	100.00%	-	-	-	-
第一创业证券 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	国联安基金管理有限公司关于终止杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-01-05
2	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2020年第4季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-01-22
3	国联安基金管理有限公司旗下全部基金2020年第四季度报告提示性公告	规定报刊	2021-01-22
4	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书更新(2021年第1号)	规定网站、深圳证券交易所	2021-02-08
5	国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-02-18
6	国联安基金管理有限公司关于终止上海凯石财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-05
7	国联安基金管理有限公司关于终止深圳富济基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-05
8	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加创金启富为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-30
9	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)2020年年度报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-03-31
10	国联安基金管理有限公司旗下全部基金2020年年度报告提示性公告	规定报刊	2021-03-31
11	国联安基金管理有限公司关于旗下指数基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	规定报刊、规定网站、上海证券交易所、深圳证券交易所	2021-03-31
12	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)	规定网站、深圳证券交易所	2021-03-31

	基金合同	所	
13	国联安基金管理有限公司关于国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)更名的公告	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所	2021-04-02
14	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-02
15	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)托管协议	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-02
16	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-06
17	国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-06
18	国联安基金管理有限公司关于在网上直销平台开展货币基金转购/申购业务、网上直销平台汇款交易方式相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-09
19	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-09
20	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书(更新)	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-09
21	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)2021年第1季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2021-04-22
22	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2021年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2021-04-22
23	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书更新(2021年第4号)	规定网站、深圳证券交易所	2021-05-20
24	国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金产品资料概要更新	规定网站、深圳证券交易所	2021-05-20
25	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021-06-29

11 影响投资者决策的其他重要信息

1、2021年3月12日，基金管理人发布了《关于修改国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)基金合同的公告》，根据深圳证券交易所合并主板与中小板工作安排，深圳证券交易所、深圳证券信息有限公司2021年2月5日的相关公告及相应基金合同的有关规定，基金管理人经与相应基金的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备案，对旗下国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)的基金合同和托管协议相关条款进行修改。自2021年4月6日起，国联安双力中小板综指证券投资基金(LOF)正式更名为国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)，修改后的基金合同、托管协议自主板与中小板两板合并日起生效。

2、2021年7月24日，基金管理人发布《国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告》，叶培智先生自2021年7月23日起担任公司副总经理（财务总监兼首席运营官）。

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双力中小板综指证券投资基金(LOF)（现国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)）发行及募集的文件
- 2、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)基金合同》
- 3、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF)招募说明书》
- 4、《国联安中小企业综合指数证券投资基金(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.epicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日