

**国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金**  
**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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

|  |    |
|--|----|
| <b>1 重要提示及目录</b> .....                       | 2  |
| 1.1 重要提示.....                                | 2  |
| <b>2 基金简介</b> .....                          | 5  |
| 2.1 基金基本情况.....                              | 5  |
| 2.2 基金产品说明.....                              | 5  |
| 2.3 基金管理人和基金托管人.....                         | 6  |
| 2.4 信息披露方式.....                              | 6  |
| 2.5 其他相关资料.....                              | 6  |
| <b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....                 | 7  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标.....                         | 7  |
| 3.2 基金净值表现.....                              | 7  |
| <b>4 管理人报告</b> .....                         | 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.....              | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....                 | 11 |
| 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.....             | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....             | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....                | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....                 | 13 |
| 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.....       | 13 |
| <b>5 托管人报告</b> .....                         | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....                  | 13 |
| 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..... | 13 |
| 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.....       | 13 |
| <b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....               | 15 |
| 6.1 资产负债表.....                               | 15 |
| 6.2 利润表.....                                 | 16 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....                      | 17 |
| 6.4 报表附注.....                                | 18 |
| <b>7 投资组合报告</b> .....                        | 41 |
| 7.1 期末基金资产组合情况.....                          | 41 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....                    | 42 |
| 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.....       | 43 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....                     | 52 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....                    | 54 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....      | 54 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....   | 54 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....   | 54 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....      | 55 |
| 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....               | 55 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....               | 55 |
| 7.12 投资组合报告附注.....                           | 55 |
| <b>8 基金份额持有人信息</b> .....                     | 57 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....                   | 57 |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.2 期末上市基金前十名持有人.....                  | 57        |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....          | 58        |
| 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..... | 58        |
| <b>9 开放式基金份额变动.....</b>                | <b>58</b> |
| <b>10 重大事件揭示.....</b>                  | <b>58</b> |
| 10.1 基金份额持有人大会决议.....                  | 58        |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....  | 58        |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....       | 59        |
| 10.4 基金投资策略的改变.....                    | 59        |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....             | 59        |
| 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.....     | 59        |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....            | 59        |
| 10.8 其他重大事件.....                       | 61        |
| <b>11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>          | <b>62</b> |
| <b>12 备查文件目录.....</b>                  | <b>63</b> |
| 12.1 备查文件目录.....                       | 63        |
| 12.2 存放地点.....                         | 63        |
| 12.3 查阅方式.....                         | 63        |

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                          |
|--------------|--------------------------|
| 基金名称         | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 国联安沪深 300ETF             |
| 场内简称         | 沪深 300E                  |
| 基金主代码        | 515660                   |
| 交易代码         | 515660                   |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                   |
| 基金合同生效日      | 2019 年 11 月 25 日         |
| 基金管理人        | 国联安基金管理有限公司              |
| 基金托管人        | 中国工商银行股份有限公司             |
| 报告期末基金份额总额   | 199,594,165.00 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         | 2019 年 12 月 24 日         |

注：本表所列的基金主代码 515660 为本基金二级市场交易代码，本基金一级市场申购赎回代码为 515661。

### 2.2 基金产品说明

|      |  |
|------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。  |
| 投资策略 | <p>1、股票投资策略</p> <p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和定量的全方面分析，评估其相对投资价值后作出相应的投资决策。</p> <p>4、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券，根据基金资产组合情况可适度进行投资。</p> <p>5、金融衍生品投资策略</p> |

|        |  |
|--------|--|
|        | <p>本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，追求对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>6、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率   |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。   |

### 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                    | 中国工商银行股份有限公司        |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 李华                             | 郭明                  |
|             | 联系电话 | 021-38992888                   | 010-66105799        |
|             | 电子邮箱 | customer.service@cpicfunds.com | custody@icbc.com.cn |
| 客户服务电话      |      | 021-38784766/4007000365        | 95588               |
| 传真          |      | 021-50151582                   | 010-66105798        |
| 注册地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路1318号9楼  | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 办公地址        |      | 中国（上海）自由贸易试验区<br>陆家嘴环路1318号9楼  | 北京市西城区复兴门内大街55号     |
| 邮政编码        |      | 200121                         | 100140              |
| 法定代表人       |      | 于业明                            | 陈四清                 |

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

| 项目     | 名称             | 办公地址                    |
|--------|----------------|-------------------------|
| 注册登记机构 | 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       | 131,544,006.37                       |
| 本期利润          | 26,327,458.27                        |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.1089                               |
| 本期加权平均净值利润率   | 1.95%                                |
| 本期基金份额净值增长率   | 1.93%                                |
| 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      | 243,805,750.55                       |
| 期末可供分配基金份额利润  | 1.2215                               |
| 期末基金资产净值      | 1,120,560,178.70                     |
| 期末基金份额净值      | 5.6142                               |
| 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   | 45.00%                               |

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。

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

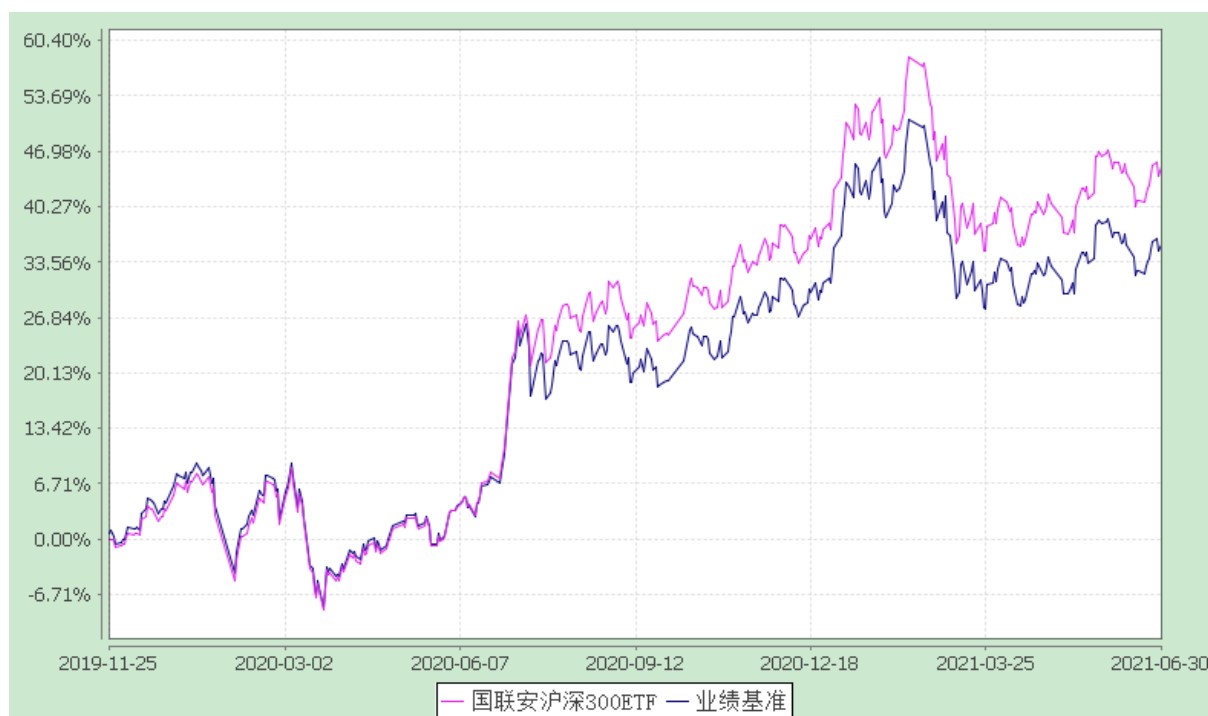
| 阶段         | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①—③   | ②—④    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月      | -1.18%   | 0.81%       | -2.02%     | 0.80%         | 0.84% | 0.01%  |
| 过去三个月      | 4.89%    | 0.97%       | 3.48%      | 0.98%         | 1.41% | -0.01% |
| 过去六个月      | 1.93%    | 1.30%       | 0.24%      | 1.31%         | 1.69% | -0.01% |
| 过去一年       | 33.27%   | 1.29%       | 25.46%     | 1.33%         | 7.81% | -0.04% |
| 过去三年       | -        | -           | -          | -             | -     | -      |
| 自基金合同生效起至今 | 45.00%   | 1.32%       | 35.69%     | 1.36%         | 9.31% | -0.04% |

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

低于所列数字。

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

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2019 年 11 月 25 日至 2021 年 6 月 30 日)



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率；  
 2、本基金基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效；  
 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束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））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 | 2019-11-25      | -    | 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 |

|     |  |            |   |                 |   |
|-----|--|------------|---|-----------------|---|
|     | 基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |            |   |                 | 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。  |
| 章堪元 | 本基金基金经理、兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金   | 2020-05-06 | - | 13 年（自 2008 年起） | 章堪元先生，硕士研究生。2008 年 7 月至 2011 年 5 月就职于建信基金管理有限公司任研究员；2011 年 5 月至 2015 年 5 月就职于富国基金管理有限公司任基金经理助理、基金经理；2015 年 5 月至 2019 年 5 月就职于融通基金管理有限公司，历任专户投资经理、基金经理、指数与量化投资部总经理。2019 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，任量化投资部总经理。2020 年 5 月起担任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2020 年 8 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金、国联安中证全指半导体产品与 |

|  |   |  |  |   |
|--|---|--|--|---|
|  | 金联接基金基金经理、国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金经理、量化投资部总经理。 |  |  | 设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，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。 |
|--|---|--|--|---|

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 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

交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5% 的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

### 4.4 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%，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，采用完全复制的方法跟踪沪深 300 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 5.6142 元，本报告期份额净值增长率为 1.93%，同期业绩比较基准收益率为 0.24%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.02%，年化跟踪误差为 0.31%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.20%，以及年化跟踪误差不超过 2.0% 的限制。

### 4.5 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，可关注业绩增长确定性较强的公司。

#### 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，本基金本报告期末未进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何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

本报告期内，国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的管理人——国联安基金管理有限公司在国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

#### 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

本托管人依法对国联安基金管理有限公司编制和披露的国联安沪深 300 交易型开放式指数证券

投资基金 2021 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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<br>2021 年 6 月 30 日         | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            | -                              | -                                |
| 银行存款            | 6.4.7.1    | 12,089,169.82                  | 24,886,835.76                    |
| 结算备付金           |            | 39,392.58                      | 241,380.02                       |
| 存出保证金           |            | 51,126.78                      | 128,237.06                       |
| 交易性金融资产         | 6.4.7.2    | 1,108,681,920.34               | 1,565,094,163.27                 |
| 其中：股票投资         |            | 1,108,543,508.81               | 1,564,997,164.12                 |
| 基金投资            |            | -                              | -                                |
| 债券投资            |            | 138,411.53                     | 96,999.15                        |
| 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         |            | 3,483,456.05                   | 910,875.01                       |
| 应收利息            | 6.4.7.5    | 4,606.10                       | 14,089.98                        |
| 应收股利            |            | 7,751.00                       | -                                |
| 应收申购款           |            | -                              | -                                |
| 递延所得税资产         |            | -                              | -                                |
| 其他资产            | 6.4.7.6    | -                              | -                                |
| <b>资产总计</b>     |            | <b>1,124,357,422.67</b>        | <b>1,591,275,581.10</b>          |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 年 6 月 30 日</b> | <b>上年度末<br/>2020 年 12 月 31 日</b> |
| <b>负债：</b>      |            | -                              | -                                |
| 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         |            | 717,620.00                     | -                                |
| 应付赎回款           |            | -                              | -                                |
| 应付管理人报酬         |            | 278,898.32                     | 390,588.31                       |
| 应付托管费           |            | 46,483.05                      | 65,098.06                        |
| 应付销售服务费         |            | -                              | -                                |
| 应付交易费用          | 6.4.7.7    | 255,945.31                     | 235,382.19                       |
| 应交税费            |            | 753.62                         | 369.98                           |

|                   |          |                         |                         |
|-------------------|----------|-------------------------|-------------------------|
| 应付利息              |          | -                       | -                       |
| 应付利润              |          | -                       | -                       |
| 递延所得税负债           |          | -                       | -                       |
| 其他负债              | 6.4.7.8  | 2,497,543.67            | 504,326.73              |
| <b>负债合计</b>       |          | <b>3,797,243.97</b>     | <b>1,195,765.27</b>     |
| <b>所有者权益：</b>     |          | -                       | -                       |
| 实收基金              | 6.4.7.9  | 772,786,470.46          | 1,117,762,860.56        |
| 未分配利润             | 6.4.7.10 | 347,773,708.24          | 472,316,955.27          |
| <b>所有者权益合计</b>    |          | <b>1,120,560,178.70</b> | <b>1,590,079,815.83</b> |
| <b>负债和所有者权益总计</b> |          | <b>1,124,357,422.67</b> | <b>1,591,275,581.10</b> |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 5.6142 元，基金份额总额 199,594,165.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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<br>2021 年 1 月 1 日至<br>2021 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2020 年 1 月 1 日至<br>2020 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| <b>一、收入</b>           |          | <b>29,675,831.12</b>                     | <b>72,198,936.95</b>                          |
| 1.利息收入                |          | 249,724.15                               | 79,461.06                                     |
| 其中：存款利息收入             | 6.4.7.11 | 40,838.04                                | 78,758.62                                     |
| 债券利息收入                |          | 893.18                                   | 702.44  |
| 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              |          | 207,992.93                               | -   |
| 其他利息收入                |          | -  | -   |
| 2.投资收益（损失以“-”填列）      |          | 134,339,554.76                           | 37,567,793.97                                 |
| 其中：股票投资收益             | 6.4.7.12 | 125,390,871.04                           | 16,921,762.81                                 |
| 基金投资收益                |          | -  | -   |
| 债券投资收益                | 6.4.7.13 | 441,438.56                               | 72,399.15                                     |
| 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 | 8,507,245.16                             | 20,573,632.01                                 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -105,216,548.10                          | 34,152,046.57                                 |
| 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 | 303,100.31                               | 399,635.35                                    |
| <b>减：二、费用</b>         |          | <b>3,348,372.85</b>                      | <b>4,534,077.06</b>                           |
| 1. 管理人报酬              |          | 2,015,967.31                             | 2,918,936.93                                  |



|                            |          |                      |                      |
|----------------------------|----------|----------------------|----------------------|
| 2. 托管费                     |          | 335,994.49           | 486,489.53           |
| 3. 销售服务费                   |          | -                    | -                    |
| 4. 交易费用                    | 6.4.7.18 | 694,717.96           | 771,733.94           |
| 5. 利息支出                    |          | -                    | -                    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | -                    | -                    |
| 6.税金及附加                    |          | 749.44               | 2.58                 |
| 7. 其他费用                    | 6.4.7.19 | 300,943.65           | 356,914.08           |
| <b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b> |          | <b>26,327,458.27</b> | <b>67,664,859.89</b> |
| 减：所得税费用                    |          | -                    | -                    |
| <b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>   |          | <b>26,327,458.27</b> | <b>67,664,859.89</b> |

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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<br>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）                        | 1,117,762,860.56                           | 472,316,955.27  | 1,590,079,815.83 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -  | 26,327,458.27   | 26,327,458.27    |
| 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）      | -344,976,390.10                            | -150,870,705.30 | -495,847,095.40  |
| 其中：1.基金申购款                             | 6,969,220.00                               | 3,108,039.65    | 10,077,259.65    |
| 2.基金赎回款                                | -351,945,610.10                            | -153,978,744.95 | -505,924,355.05  |
| 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）                        | 772,786,470.46                             | 347,773,708.24  | 1,120,560,178.70 |
| 项目                                     | 上年度可比期间<br>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）                        | 1,898,315,500.51                           | 101,345,042.08  | 1,999,660,542.59 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利                 | -  | 67,664,859.89   | 67,664,859.89    |

|  |                  |                |                  |
|--|------------------|----------------|------------------|
| 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)      | -101,053,690.00  | -10,855,824.89 | -111,909,514.89  |
| 其中: 1.基金申购款                            | 48,784,539.99    | -59,895.15     | 48,724,644.84    |
| 2.基金赎回款                                | -149,838,229.99  | -10,795,929.74 | -160,634,159.73  |
| 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)                        | 1,797,261,810.51 | 158,154,077.08 | 1,955,415,887.59 |

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

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]第 1121 号《关于准予国联安沪深 300 交易型开放式指数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《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，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 500,936,940.00 元(含募集股票市值)，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(2019)第 0681 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 11 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 500,986,890.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 49,950.00 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，基金托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定，基金合同生效后，本基金可以进行份额折算。基金管理人应事先确定基金份额折算日，并依照《信息披露办法》的有关规定进行公告，并提前通知基金托管人。基金份额折算的具体方法在份额折算公告中列示。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券

(包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以参与融资业务以及通过证券金融公司办理转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金;股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]290 号文审核同意,本基金 129,394,165 份基金份额于 2019 年 12 月 24 日在上交所挂牌交易。

本基金的基金管理人国联安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国联安沪深 300ETF 联接基金”)。国联安沪深 300ETF 联接基金为交易型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 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》、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间的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 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日止期间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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------|------------------------|
| 活期存款 | 12,089,169.82          |
| 定期存款 | -                      |
| 其他存款 | -                      |
| 合计   | 12,089,169.82          |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |                  |                |
|---------------|------------------------|------------------|----------------|
|               | 成本                     | 公允价值             | 公允价值变动         |
| 股票            | 878,914,190.80         | 1,108,543,508.81 | 229,629,318.01 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                      | -                | -              |
| 债券            | 交易所市场                  | 112,999.37       | 138,411.53     |
|               | 银行间市场                  | -                | -              |
|               | 合计                     | 112,999.37       | 138,411.53     |
| 资产支持证券        | -                      | -                | -              |
| 基金            | -                      | -                | -              |
| 其他            | -                      | -                | -              |
| 合计            | 879,027,190.17         | 1,108,681,920.34 | 229,654,730.17 |

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

### 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从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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|------------|------------------------|
| 应收活期存款利息   | 1,042.31               |
| 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  | 17.70                  |
| 应收债券利息     | 13.63                  |
| 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   | 3,509.46               |
| 其他         | 23.00                  |
| 合计         | 4,606.10               |

注：此处其他列示的是应收结算保证金利息。

## 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<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 255,945.31             |
| 银行间市场应付交易费用 | -                      |
| 合计          | 255,945.31             |

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | -                      |
| 应付赎回费       | -                      |
| 应付证券出借违约金   | -                      |
| 应付指数使用费     | 201,596.70             |
| 预提审计费       | 39,671.58              |
| 预提信息披露费     | 59,507.37              |
| ETF 申赎证券清算款 | 2,196,768.02           |

|    |              |
|----|--------------|
| 合计 | 2,497,543.67 |
|----|--------------|

### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>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          | 288,694,165.00                        | 1,117,762,860.56 |
| 本期申购          | 1,800,000.00                          | 6,969,220.00     |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -90,900,000.00                        | -351,945,610.10  |
| 本期末           | 199,594,165.00                        | 772,786,470.46   |

### 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           | 194,050,400.69 | 278,266,554.58  | 472,316,955.27  |
| 本期利润           | 131,544,006.37 | -105,216,548.10 | 26,327,458.27   |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -81,788,656.51 | -69,082,048.79  | -150,870,705.30 |
| 其中：基金申购款       | 1,391,900.30   | 1,716,139.35    | 3,108,039.65    |
| 基金赎回款          | -83,180,556.81 | -70,798,188.14  | -153,978,744.95 |
| 本期已分配利润        | -              | -               | -               |
| 本期末            | 243,805,750.55 | 103,967,957.69  | 347,773,708.24  |

### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
|           | 活期存款利息收入                              |
| 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 | 3,440.74                              |
| 其他        | 468.43                                |
| 合计        | 40,838.04                             |

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

|                  | 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------|---------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 74,921,304.32                   |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | 50,469,566.72                   |
| 股票投资收益——申购差价收入   | -                               |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | -                               |
| 合计               | 125,390,871.04                  |

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 288,200,041.25                        |
| 减：卖出股票成本总额 | 213,278,736.93                        |
| 买卖股票差价收入   | 74,921,304.32                         |

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额  | 505,924,355.05                        |
| 减：现金支付赎回款总额 | 212,106,457.05                        |
| 减：赎回股票成本总额  | 243,348,331.28                        |
| 赎回差价收入      | 50,469,566.72                         |

#### 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

单位：人民币元

| 项目                           | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 441,438.56                 |
| 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                           | 441,438.56                 |

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目                | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成 | 3,558,024.15               |



|                        |              |
|------------------------|--------------|
| 交总额                    |              |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,115,673.97 |
| 减：应收利息总额               | 911.62       |
| 买卖债券差价收入               | 441,438.56   |

#### 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收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益   | 8,507,245.16               |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 109,036.99                 |
| 基金投资产生的股利收益   | -                          |
| 合计            | 8,507,245.16               |

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称                       | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|----------------------------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产                  | -105,216,548.10            |
| ——股票投资                     | -105,241,960.26            |
| ——债券投资                     | 25,412.16                  |
| ——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<br>预估增值税 | -                          |

|    |                 |
|----|-----------------|
| 合计 | -105,216,548.10 |
|----|-----------------|

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | -                          |
| 替代损益    | 303,100.31                 |
| 合计      | 303,100.31                 |

**6.4.7.18 交易费用**

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 694,717.96                 |
| 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        | 694,717.96                 |

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用    | 39,671.58                  |
| 信息披露费   | 59,507.37                  |
| 证券出借违约金 | -                          |
| 指数使用费   | 201,596.70                 |
| 银行汇划费   | 168.00                     |
| 合计      | 300,943.65                 |

**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          |
|--|------------------|
| 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 ("国联安沪深 300ETF 联接基金") | 基金管理人管理的其他基金     |
| 安联集团   | 基金管理人的股东         |
| 国联安基金管理有限公司  | 基金管理人            |
| 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         |
| 中国太平洋保险 (集团) 股份有限公司 ("太保集团")                       | 基金管理人的最终控制人      |
| 中国太平洋人寿保险股份有限公司 ("太保人寿")                           | 基金管理人的最终控制人控制的机构 |
| 中国工商银行股份有限公司 ("中国工商银行")                            | 基金托管人            |

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

##### 6.4.10.1.4 债券回购交易

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

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有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<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6月<br>30日 |
|-----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 2,015,967.31                   | 2,918,936.93                        |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 1,993.61                       | -                                   |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.30% 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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.30% / 当年天数。

**6.4.10.2.2 基金托管费**

单位：人民币元

| 项目             | 本期<br>2021年1月1日至2021年6月<br>30日 | 上年度可比期间<br>2020年1月1日至2020年6<br>月30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 335,994.49                     | 486,489.53                          |

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 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，本基金均未发生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****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

**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**

份额单位：份

| 关联方名称                        | 本期末 2021 年 6 月 30 日 |                  | 上年度末 2020 年 12 月 31 日 |                  |
|------------------------------|---------------------|------------------|-----------------------|------------------|
|                              | 持有的基金份额             | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额               | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 太保人寿                         | 43,504,798.00       | 21.80%           | 100,760,180.00        | 34.90%           |
| 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 147,900,000.00      | 74.10%           | 183,100,000.00        | 63.42%           |

**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    |
| 中国工商银行股份有限公司 | 12,089,169.82        | 36,928.87 | 22,874,781.58        | 67,966.74 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“中国工商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 06 月 30 日的相关余额为人民币 39,392.58 元。（2020 年 6 月 30 日：人民币 68,143.71 元）

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无须作说明的其他关联交易事项。

**6.4.11 利润分配情况**

本报告期内本基金未进行利润分配。

**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**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |          |            |            |    |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 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 |
| 300919               | 中伟股份 | 2020-12-15 | 2021-07-02 | 新股锁定   | 24.60 | 163.00 | 610      | 15,006.00  | 99,430.00  | -  |
| 688687               | 凯因科技 | 2021-01-29 | 2021-08-09 | 新股锁定   | 18.98 | 27.98  | 5,354    | 101,618.92 | 149,804.92 | -  |
| 300614               | 百川畅银 | 2021-05-18 | 2021-01-25 | 新股锁定   | 9.19  | 40.38  | 329      | 3,023.51   | 13,285.02  | -  |
| 300927               | 江天化学 | 2020-12-29 | 2021-07-07 | 新股锁定   | 13.39 | 30.10  | 217      | 2,905.63   | 6,531.70   | -  |
| 300929               | 华骐环保 | 2021-01-12 | 2021-07-21 | 新股锁定   | 13.87 | 29.55  | 183      | 2,538.21   | 5,407.65   | -  |
| 300930               | 屹通新材 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 新股锁定   | 13.11 | 24.48  | 322      | 4,221.42   | 7,882.56   | -  |
| 300931               | 通用电梯 | 2021-01-13 | 2021-07-21 | 新股锁定   | 4.31  | 13.11  | 672      | 2,896.32   | 8,809.92   | -  |
| 300932               | 三友联众 | 2021-01-15 | 2021-07-22 | 新股锁定   | 24.69 | 31.71  | 492      | 12,147.48  | 15,601.32  | -  |
| 300940               | 南极光  | 2021-01-27 | 2021-08-03 | 新股锁定   | 12.76 | 43.38  | 307      | 3,917.32   | 13,317.66  | -  |
| 300941               | 创识科技 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股锁定   | 21.31 | 49.94  | 399      | 8,502.69   | 19,926.06  | -  |
| 300942               | 易瑞生物 | 2021-02-02 | 2021-08-09 | 新股锁定   | 5.31  | 28.52  | 443      | 2,352.33   | 12,634.36  | -  |
| 300943               | 春晖智控 | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股锁定   | 9.79  | 23.01  | 255      | 2,496.45   | 5,867.55   | -  |
| 300945               | 曼卡龙  | 2021-02-03 | 2021-08-10 | 新股锁定   | 4.56  | 18.88  | 474      | 2,161.44   | 8,949.12   | -  |
| 300950               | 德固特  | 2021-02-24 | 2021-09-03 | 新股锁定   | 8.41  | 39.13  | 219      | 1,841.79   | 8,569.47   | -  |
| 300952               | 恒辉安防 | 2021-03-03 | 2021-09-13 | 新股锁定   | 11.72 | 27.08  | 340      | 3,984.80   | 9,207.20   | -  |
| 300956               | 英力股份 | 2021-03-16 | 2021-09-27 | 新股锁定   | 12.85 | 25.80  | 371      | 4,767.35   | 9,571.80   | -  |
| 300957               | 贝泰妮  | 2021-03-18 | 2021-09-27 | 新股锁定   | 47.33 | 251.96 | 826      | 39,094.58  | 208,118.96 | -  |
| 300960               | 通业科技 | 2021-03-22 | 2021-09-29 | 新股锁定   | 12.08 | 23.06  | 234      | 2,826.72   | 5,396.04   | -  |
| 30096                | 深水   | 2021-0     | 2021-0     | 新股     | 8.48  | 22.07  | 394      | 3,341.     | 8,695.     | -  |

|       |          |                |                |          |       |       |       |               |                |   |
|-------|----------|----------------|----------------|----------|-------|-------|-------|---------------|----------------|---|
| 1     | 海纳       | 3-23           | 9-30           | 锁定       |       |       |       | 12            | 58             |   |
| 30096 | 中金<br>辐照 | 2021-0<br>3-29 | 2021-1<br>0-11 | 新股<br>锁定 | 3.40  | 16.37 | 576   | 1,958.<br>40  | 9,429.<br>12   | - |
| 30096 | 中洲<br>特材 | 2021-0<br>3-30 | 2021-1<br>0-11 | 新股<br>锁定 | 12.13 | 22.49 | 283   | 3,432.<br>79  | 6,364.<br>67   | - |
| 30096 | 共同<br>药业 | 2021-0<br>3-31 | 2021-1<br>0-11 | 新股<br>锁定 | 8.24  | 31.54 | 286   | 2,356.<br>64  | 9,020.<br>44   | - |
| 30096 | 晓鸣<br>股份 | 2021-0<br>4-02 | 2021-1<br>0-13 | 新股<br>锁定 | 4.54  | 11.54 | 507   | 2,301.<br>78  | 5,850.<br>78   | - |
| 30096 | 格林<br>精密 | 2021-0<br>4-06 | 2021-1<br>0-15 | 新股<br>锁定 | 6.87  | 12.07 | 1,162 | 7,982.<br>94  | 14,025.<br>.34 | - |
| 30097 | 博亚<br>精工 | 2021-0<br>4-07 | 2021-1<br>0-15 | 新股<br>锁定 | 18.24 | 28.29 | 245   | 4,468.<br>80  | 6,931.<br>05   | - |
| 30097 | 万辰<br>生物 | 2021-0<br>4-08 | 2021-1<br>0-19 | 新股<br>锁定 | 7.19  | 12.65 | 430   | 3,091.<br>70  | 5,439.<br>50   | - |
| 30097 | 商络<br>电子 | 2021-0<br>4-14 | 2021-1<br>0-21 | 新股<br>锁定 | 5.48  | 13.03 | 492   | 2,696.<br>16  | 6,410.<br>76   | - |
| 30097 | 东箭<br>科技 | 2021-0<br>4-15 | 2021-1<br>0-26 | 新股<br>锁定 | 8.42  | 13.60 | 593   | 4,993.<br>06  | 8,064.<br>80   | - |
| 30097 | 华利<br>集团 | 2021-0<br>4-15 | 2021-1<br>0-26 | 新股<br>锁定 | 33.22 | 87.50 | 925   | 30,728<br>.50 | 80,937<br>.50  | - |
| 30098 | 苏文<br>电能 | 2021-0<br>4-19 | 2021-1<br>0-27 | 新股<br>锁定 | 15.83 | 45.29 | 317   | 5,018.<br>11  | 14,356<br>.93  | - |
| 30098 | 致远<br>新能 | 2021-0<br>4-21 | 2021-1<br>0-29 | 新股<br>锁定 | 24.90 | 24.81 | 295   | 7,345.<br>50  | 7,318.<br>95   | - |
| 30098 | 志特<br>新材 | 2021-0<br>4-21 | 2021-1<br>1-01 | 新股<br>锁定 | 14.79 | 30.57 | 264   | 3,904.<br>56  | 8,070.<br>48   | - |
| 30099 | 创益<br>通  | 2021-0<br>5-12 | 2021-1<br>1-22 | 新股<br>锁定 | 13.06 | 26.51 | 254   | 3,317.<br>24  | 6,733.<br>54   | - |
| 30099 | 泰福<br>泵业 | 2021-0<br>5-17 | 2021-1<br>1-25 | 新股<br>锁定 | 9.36  | 20.32 | 200   | 1,872.<br>00  | 4,064.<br>00   | - |
| 30099 | 奇德<br>新材 | 2021-0<br>5-17 | 2021-1<br>1-26 | 新股<br>锁定 | 14.72 | 23.32 | 191   | 2,811.<br>52  | 4,454.<br>12   | - |
| 30099 | 宁波<br>方正 | 2021-0<br>5-25 | 2021-1<br>2-02 | 新股<br>锁定 | 6.02  | 21.32 | 201   | 1,210.<br>02  | 4,285.<br>32   | - |
| 30100 | 崧盛<br>股份 | 2021-0<br>5-27 | 2021-1<br>2-07 | 新股<br>锁定 | 18.71 | 57.62 | 201   | 3,760.<br>71  | 11,581<br>.62  | - |
| 30100 | 嘉益<br>股份 | 2021-0<br>6-18 | 2021-1<br>2-24 | 新股<br>锁定 | 7.81  | 21.94 | 312   | 2,436.<br>72  | 6,845.<br>28   | - |
| 30100 | 德迈<br>仕  | 2021-0<br>6-04 | 2021-1<br>2-16 | 新股<br>锁定 | 5.29  | 14.44 | 303   | 1,602.<br>87  | 4,375.<br>32   | - |
| 30100 | 可靠<br>股份 | 2021-0<br>6-08 | 2021-1<br>2-17 | 新股<br>锁定 | 12.54 | 27.89 | 801   | 10,044<br>.54 | 22,339<br>.89  | - |
| 30101 | 晶雪       | 2021-0         | 2021-1         | 新股       | 7.83  | 17.61 | 218   | 1,706.        | 3,838.         | - |

|        |      |            |            |          |       |       |       |           |           |   |
|--------|------|------------|------------|----------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| 0      | 节能   | 6-09       | 2-20       | 锁定       |       |       |       | 94        | 98        |   |
| 301011 | 华立科技 | 2021-06-09 | 2021-12-17 | 新股锁定     | 14.20 | 33.84 | 175   | 2,485.00  | 5,922.00  | - |
| 301012 | 扬电科技 | 2021-06-15 | 2021-12-22 | 新股锁定     | 8.05  | 24.26 | 170   | 1,368.50  | 4,124.20  | - |
| 301015 | 百洋医药 | 2021-06-22 | 2021-12-30 | 新股锁定     | 7.64  | 38.83 | 462   | 3,529.68  | 17,939.46 | - |
| 301016 | 雷尔伟  | 2021-06-23 | 2021-12-30 | 新股锁定     | 13.75 | 32.98 | 275   | 3,781.25  | 9,069.50  | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2022-01-05 | 新股待上市并锁定 | 8.86  | 8.86  | 555   | 4,917.30  | 4,917.30  | - |
| 301017 | 漱玉平民 | 2021-06-23 | 2021-07-05 | 新股待上市    | 8.86  | 8.86  | 4,995 | 44,255.70 | 44,255.70 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股待上市    | 10.64 | 10.64 | 3,789 | 40,314.96 | 40,314.96 | - |
| 301020 | 密封科技 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股待上市并锁定 | 10.64 | 10.64 | 421   | 4,479.44  | 4,479.44  | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股待上市    | 9.46  | 9.46  | 2,609 | 24,681.14 | 24,681.14 | - |
| 301021 | 英诺激光 | 2021-06-28 | 2022-01-06 | 新股待上市并锁定 | 9.46  | 9.46  | 290   | 2,743.40  | 2,743.40  | - |
| 605162 | 新中港  | 2021-06-29 | 2021-07-07 | 新股待上市    | 6.07  | 6.07  | 1,377 | 8,358.39  | 8,358.39  | - |
| 605287 | 德才股份 | 2021-06-28 | 2021-07-06 | 新股待上市    | 31.56 | 31.56 | 349   | 11,014.44 | 11,014.44 | - |
| 688087 | 英科再生 | 2021-06-30 | 2021-07-09 | 新股待上市    | 21.96 | 21.96 | 2,469 | 54,219.24 | 54,219.24 | - |
| 688109 | 品茗股份 | 2021-03-22 | 2021-09-30 | 新股锁定     | 50.05 | 72.10 | 1,301 | 65,115.05 | 93,802.10 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021-06-28 | 2021-07-07 | 新股待上市    | 6.42  | 6.42  | 2,693 | 17,289.06 | 17,289.06 | - |



|        |      |            |            |      |       |       |         |            |            |   |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|---------|------------|------------|---|
| 688323 | 瑞华泰  | 2021-04-21 | 2021-10-28 | 新股锁定 | 5.97  | 22.78 | 4,513   | 26,942.61  | 102,806.14 | - |
| 688329 | 艾隆科技 | 2021-03-16 | 2021-09-29 | 新股锁定 | 16.81 | 50.04 | 1,846   | 31,031.26  | 92,373.84  | - |
| 688538 | 和辉光电 | 2021-05-20 | 2021-11-29 | 新股锁定 | 2.65  | 3.38  | 247,602 | 656,145.30 | 836,894.76 | - |
| 688656 | 浩欧博  | 2021-01-06 | 2021-07-13 | 新股锁定 | 35.26 | 72.60 | 1,371   | 48,341.46  | 99,534.60  | - |
| 688663 | 新风光  | 2021-04-06 | 2021-10-13 | 新股锁定 | 14.48 | 19.21 | 3,279   | 47,479.92  | 62,989.59  | - |
| 688681 | 科汇股份 | 2021-06-04 | 2021-12-16 | 新股锁定 | 9.56  | 14.54 | 1,899   | 18,154.44  | 27,611.46  | - |

#### 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码   | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量(单位：张) | 期末成本总额    | 期末估值总额    | 备注 |
|--------|------|------------|------------|--------|--------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 113049 | 长汽转债 | 2021-06-11 | 2021-07-08 | 新债待上市  | 100.00 | 100.00 | 310      | 30,999.73 | 30,999.73 | -  |

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2、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。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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   | 193,900.00 | 1,928,590.31 | 1,083,901.00 | -  |

#### 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

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元, 因此没有作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 06 月 30 日止, 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。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位: 人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称  | 出借到期日           | 期末<br>估值<br>单价 | 数量(单位:<br>股) | 期末估值总<br>额   |
|----|--------|-------|-----------------|----------------|--------------|--------------|
| 1  | 300014 | 亿纬锂能  | 2021 年 7 月 14 日 | 103.93         | 12,000.00    | 1,247,160.00 |
| 2  | 002352 | 顺丰控股  | 2021 年 7 月 1 日  | 67.70          | 12,800.00    | 866,560.00   |
| 3  | 300015 | 爱尔眼科  | 2021 年 7 月 14 日 | 70.98          | 10,000.00    | 709,800.00   |
| 4  | 600438 | 通威股份  | 2021 年 7 月 14 日 | 43.27          | 16,000.00    | 692,320.00   |
| 5  | 601633 | 长城汽车  | 2021 年 7 月 14 日 | 43.59          | 15,000.00    | 653,850.00   |
| 6  | 002714 | 牧原股份  | 2021 年 7 月 14 日 | 60.82          | 10,000.00    | 608,200.00   |
| 7  | 000963 | 华东医药  | 2021 年 7 月 14 日 | 46.01          | 10,000.00    | 460,100.00   |
| 8  | 000725 | 京东方 A | 2021 年 7 月 1 日  | 6.24           | 66,800.00    | 416,832.00   |
| 9  | 600111 | 北方稀土  | 2021 年 7 月 1 日  | 20.70          | 15,300.00    | 316,710.00   |
| 10 | 000625 | 长安汽车  | 2021 年 7 月 14 日 | 26.28          | 12,000.00    | 315,360.00   |
| 11 | 000157 | 中联重科  | 2021 年 7 月 14 日 | 9.24           | 30,000.00    | 277,200.00   |
| 12 | 600346 | 恒力石化  | 2021 年 7 月 14 日 | 26.24          | 10,000.00    | 262,400.00   |
| 13 | 002493 | 荣盛石化  | 2021 年 7 月 1 日  | 17.27          | 14,400.00    | 248,688.00   |
| 14 | 300144 | 宋城演艺  | 2021 年 7 月 1 日  | 16.80          | 11,100.00    | 186,480.00   |
| 15 | 002044 | 美年健康  | 2021 年 7 月 1 日  | 9.11           | 19,400.00    | 176,734.00   |
| 16 | 000703 | 恒逸石化  | 2021 年 7 月 14 日 | 11.95          | 10,000.00    | 119,500.00   |
| 合计 | -      | -     | -               | -              | 274,800.00   | 7,557,894.00 |

#### 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。

本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小。

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 0.01%（2020 年 12 月 31 日：0.01%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品

种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 50%。

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 6 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 0.31%。

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<br>2021年6<br>月30日 | 1个月以<br>内     | 1-3<br>个月 | 3个月<br>-1年 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息              | 合计               |
|-----------------------|---------------|-----------|------------|------|------|------------------|------------------|
| 资产                    |               |           |            |      |      |                  |                  |
| 其他资产                  | -             | -         | -          | -    | -    | -                | -                |
| 银行存款                  | 12,089,169.82 | -         | -          | -    | -    | -                | 12,089,169.82    |
| 结算备付金                 | 39,392.58     | -         | -          | -    | -    | -                | 39,392.58        |
| 存出保证金                 | 51,126.78     | -         | -          | -    | -    | -                | 51,126.78        |
| 交易性金融资产               | -             | -         | 138,411.53 | -    | -    | 1,108,543,508.81 | 1,108,681,920.34 |
| 买入返售金融资产              | -             | -         | -          | -    | -    | -                | -                |
| 应收证券清算款               | -             | -         | -          | -    | -    | 3,483,456.05     | 3,483,456.05     |
| 应收利息                  | -             | -         | -          | -    | -    | 4,606.10         | 4,606.10         |
| 应收股利                  | -             | -         | -          | -    | -    | 7,751.00         | 7,751.00         |
| 应收申购款                 | -             | -         | -          | -    | -    | -                | -                |
| 资产总计                  | 12,179,689.18 | -         | 138,411.53 | -    | -    | 1,112,039,321.96 |                  |

|                                |               |        |            |       |       |                  |                  |
|--------------------------------|---------------|--------|------------|-------|-------|------------------|------------------|
|                                |               |        |            |       |       |                  | 1,124,357,422.67 |
| 负债                             |               |        |            |       |       |                  |                  |
| 其他负债                           | -             | -      | -          | -     | -     | 2,497,543.67     | 2,497,543.67     |
| 卖出回购金融资产款                      | -             | -      | -          | -     | -     | -                | -                |
| 应付证券清算款                        | -             | -      | -          | -     | -     | 717,620.00       | 717,620.00       |
| 应付赎回款                          | -             | -      | -          | -     | -     | -                | -                |
| 应付管理人报酬                        | -             | -      | -          | -     | -     | 278,898.32       | 278,898.32       |
| 应付托管费                          | -             | -      | -          | -     | -     | 46,483.05        | 46,483.05        |
| 应付交易费用                         | -             | -      | -          | -     | -     | 255,945.31       | 255,945.31       |
| 应交税费                           | -             | -      | -          | -     | -     | 753.62           | 753.62           |
| 应付利息                           | -             | -      | -          | -     | -     | -                | -                |
| 负债总计                           | -             | -      | -          | -     | -     | 3,797,243.97     | 3,797,243.97     |
| 利率敏感度缺口                        | 12,179,689.18 | -      | 138,411.53 | -     | -     | 1,108,242,077.99 | 1,120,560,178.70 |
| 上年度末<br>2020 年<br>12 月 31<br>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                             |               |        |            |       |       |                  |                  |
| 应收利息                           | -             | -      | -          | -     | -     | 14,089.98        | 14,089.98        |
| 银行存款                           | 24,886,835.76 | -      | -          | -     | -     | -                | 24,886,835.76    |
| 结算备付金                          | 241,380.02    | -      | -          | -     | -     | -                | 241,380.02       |
| 存出保证金                          | 128,237.06    | -      | -          | -     | -     | -                | 128,237.06       |
| 交易性金融资产                        | -             | -      | 96,999.15  | -     | -     | 1,564,997,164.12 | 1,565,094,163.27 |
| 应收证券清算款                        | -             | -      | -          | -     | -     | 910,875.01       | 910,875.01       |
| 资产总计                           | 25,256,4      | -      | 96,999.15  | -     | -     | 1,565,922,       | 1,591,275,581.   |

|         |               |   |           |   |   |                  |                  |
|---------|---------------|---|-----------|---|---|------------------|------------------|
|         | 52.84         |   |           |   |   | 129.11           | 10               |
| 负债      |               |   |           |   |   |                  |                  |
| 其他负债    | -             | - | -         | - | - | 504,326.73       | 504,326.73       |
| 应付管理人报酬 | -             | - | -         | - | - | 390,588.31       | 390,588.31       |
| 应付托管费   | -             | - | -         | - | - | 65,098.06        | 65,098.06        |
| 应付交易费用  | -             | - | -         | - | - | 235,382.19       | 235,382.19       |
| 应交税费    | -             | - | -         | - | - | 369.98           | 369.98           |
| 负债总计    | -             | - | -         | - | - | 1,195,765.27     | 1,195,765.27     |
| 利率敏感度缺口 | 25,256,452.84 | - | 96,999.15 | - | - | 1,564,726,363.84 | 1,590,079,815.83 |

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 0.00% (2020 年 12 月 31 日：0.01%)，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。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全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。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的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。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日 |               | 上年度末<br>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  | 1,108,543,508.81       | 98.93         | 1,564,997,164.12         | 98.42         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                      | -             | -                        | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 138,411.53             | 0.01          | 96,999.15                | 0.01          |
| 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            | 1,108,681,920.34       | 98.94         | 1,565,094,163.27         | 98.43         |

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。



## 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<br>影响金额（单位：人民币元） |                          |
|    |                      | 本期末<br>2021 年 6 月 30 日          | 上年度末<br>2020 年 12 月 31 日 |
|    | 业绩比较基准上升 5%          | 增加 55,326,728.73                | 增加 76,806,915.86         |
|    | 业绩比较基准下降 5%          | 减少 55,326,728.73                | 减少 76,806,915.86         |

## 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                  | 1,108,543,508.81 | 98.59        |
|    | 其中：股票                 | 1,108,543,508.81 | 98.59        |
| 2  | 基金投资                  | -                | -            |
| 3  | 固定收益投资                | 138,411.53       | 0.01         |
|    | 其中：债券                 | 138,411.53       | 0.01         |
|    | 资产支持证券                | -                | -            |
| 4  | 贵金属投资                 | -                | -            |
| 5  | 金融衍生品投资               | -                | -            |
| 6  | 买入返售金融资产              | -                | -            |
|    | 其中：买断式回购的买入返<br>售金融资产 | -                | -            |
| 7  | 银行存款和结算备付金合<br>计      | 12,128,562.40    | 1.08         |
| 8  | 其他各项资产                | 3,546,939.93     | 0.32         |
| 9  | 合计                    | 1,124,357,422.67 | 100.00       |

注：1、上表中的权益投资股票项含可退替代款估值增值，而 5.2 的合计项不含可退替代款估值增值；

2、报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 7,557,894.00 元，占基金资产净值的比例为 0.67%；

3、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；

4、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<br>(%) |
|----|------------------|------------------|------------------|
| A  | 农、林、牧、渔业         | 11,515,385.20    | 1.03             |
| B  | 采矿业              | 23,674,011.80    | 2.11             |
| C  | 制造业              | 610,100,011.58   | 54.45            |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 19,368,623.00    | 1.73             |
| E  | 建筑业              | 13,292,491.00    | 1.19             |
| F  | 批发和零售业           | 8,145,823.97     | 0.73             |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 32,977,512.90    | 2.94             |
| H  | 住宿和餐饮业           | -                | -                |
| I  | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 36,473,035.28    | 3.25             |
| J  | 金融业              | 259,626,483.67   | 23.17            |
| K  | 房地产业             | 22,621,207.73    | 2.02             |
| L  | 租赁和商务服务业         | 22,340,287.30    | 1.99             |
| M  | 科学研究和技术服务业       | 15,721,609.80    | 1.40             |
| N  | 水利、环境和公共设施管理业    | -                | -                |
| O  | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -                |
| P  | 教育               | 1,997,084.00     | 0.18             |
| Q  | 卫生和社会工作          | 23,529,563.64    | 2.10             |
| R  | 文化、体育和娱乐业        | 4,581,061.00     | 0.41             |
| S  | 综合               | -                | -                |
|    | 合计               | 1,105,964,191.87 | 98.70            |

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

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         | 11,290.28    | 0.00 |
| B | 采矿业              | -            | -    |
| C | 制造业              | 2,243,320.65 | 0.20 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 13,020.39    | 0.00 |
| E | 建筑业              | 25,371.37    | 0.00 |
| F | 批发和零售业           | 82,472.34    | 0.01 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | -            | -    |
| H | 住宿和餐饮业           | -            | -    |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 141,732.56   | 0.01 |
| J | 金融业              | 34,721.10    | 0.00 |
| 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    | 27,388.25    | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -            | -    |
| P | 教育               | -            | -    |
| Q | 卫生和社会工作          | -            | -    |
| R | 文化、体育和娱乐业        | -            | -    |
| S | 综合               | -            | -    |
|   | 合计               | 2,579,316.94 | 0.23 |

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 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净 |
|----|------|------|-------|------|--------|
|----|------|------|-------|------|--------|

|    |        |       |           |               | 值比例(%) |
|----|--------|-------|-----------|---------------|--------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台  | 32,500    | 66,842,750.00 | 5.97   |
| 2  | 601318 | 中国平安  | 563,500   | 36,221,780.00 | 3.23   |
| 3  | 600036 | 招商银行  | 635,800   | 34,454,002.00 | 3.07   |
| 4  | 000858 | 五粮液   | 99,500    | 29,640,055.00 | 2.65   |
| 5  | 601012 | 隆基股份  | 222,592   | 19,775,073.28 | 1.76   |
| 6  | 000333 | 美的集团  | 271,248   | 19,358,969.76 | 1.73   |
| 7  | 601888 | 中国中免  | 57,893    | 17,373,689.30 | 1.55   |
| 8  | 600276 | 恒瑞医药  | 248,081   | 16,862,065.57 | 1.50   |
| 9  | 002415 | 海康威视  | 240,000   | 15,480,000.00 | 1.38   |
| 10 | 601166 | 兴业银行  | 747,000   | 15,350,850.00 | 1.37   |
| 11 | 603259 | 药明康德  | 92,220    | 14,440,729.80 | 1.29   |
| 12 | 300059 | 东方财富  | 424,640   | 13,923,945.60 | 1.24   |
| 13 | 000651 | 格力电器  | 247,300   | 12,884,330.00 | 1.15   |
| 14 | 600900 | 长江电力  | 584,000   | 12,053,760.00 | 1.08   |
| 15 | 002594 | 比亚迪   | 46,600    | 11,696,600.00 | 1.04   |
| 16 | 002475 | 立讯精密  | 251,007   | 11,546,322.00 | 1.03   |
| 17 | 600887 | 伊利股份  | 312,600   | 11,513,058.00 | 1.03   |
| 18 | 000001 | 平安银行  | 498,300   | 11,271,546.00 | 1.01   |
| 19 | 600030 | 中信证券  | 437,600   | 10,913,744.00 | 0.97   |
| 20 | 000725 | 京东方 A | 1,739,200 | 10,852,608.00 | 0.97   |
| 21 | 300015 | 爱尔眼科  | 138,918   | 9,860,399.64  | 0.88   |
| 22 | 601398 | 工商银行  | 1,800,300 | 9,307,551.00  | 0.83   |
| 23 | 603288 | 海天味业  | 69,182    | 8,921,018.90  | 0.80   |
| 24 | 600031 | 三一重工  | 305,100   | 8,869,257.00  | 0.79   |
| 25 | 000568 | 泸州老窖  | 37,500    | 8,847,750.00  | 0.79   |
| 26 | 600309 | 万华化学  | 80,500    | 8,760,010.00  | 0.78   |
| 27 | 603501 | 韦尔股份  | 26,800    | 8,629,600.00  | 0.77   |
| 28 | 000002 | 万科 A  | 349,693   | 8,326,190.33  | 0.74   |
| 29 | 002714 | 牧原股份  | 135,220   | 8,224,080.40  | 0.73   |
| 30 | 600809 | 山西汾酒  | 17,800    | 7,974,400.00  | 0.71   |
| 31 | 300122 | 智飞生物  | 41,200    | 7,693,276.00  | 0.69   |
| 32 | 601919 | 中远海控  | 248,700   | 7,595,298.00  | 0.68   |
| 33 | 002352 | 顺丰控股  | 109,100   | 7,386,070.00  | 0.66   |
| 34 | 601899 | 紫金矿业  | 746,700   | 7,235,523.00  | 0.65   |
| 35 | 002142 | 宁波银行  | 185,021   | 7,210,268.37  | 0.64   |
| 36 | 600436 | 片仔癀   | 15,500    | 6,948,650.00  | 0.62   |
| 37 | 601328 | 交通银行  | 1,411,200 | 6,914,880.00  | 0.62   |
| 38 | 002304 | 洋河股份  | 31,100    | 6,443,920.00  | 0.58   |
| 39 | 002812 | 恩捷股份  | 27,500    | 6,437,750.00  | 0.57   |
| 40 | 002230 | 科大讯飞  | 91,423    | 6,178,366.34  | 0.55   |
| 41 | 300014 | 亿纬锂能  | 58,700    | 6,100,691.00  | 0.54   |
| 42 | 300274 | 阳光电源  | 52,700    | 6,063,662.00  | 0.54   |

|    |        |        |           |              |      |
|----|--------|--------|-----------|--------------|------|
| 43 | 600000 | 浦发银行   | 602,952   | 6,029,520.00 | 0.54 |
| 44 | 600438 | 通威股份   | 138,900   | 6,010,203.00 | 0.54 |
| 45 | 300124 | 汇川技术   | 79,361    | 5,893,347.86 | 0.53 |
| 46 | 600837 | 海通证券   | 495,800   | 5,701,700.00 | 0.51 |
| 47 | 000661 | 长春高新   | 14,700    | 5,688,900.00 | 0.51 |
| 48 | 000100 | TCL 科技 | 720,700   | 5,513,355.00 | 0.49 |
| 49 | 601816 | 京沪高铁   | 1,013,600 | 5,361,944.00 | 0.48 |
| 50 | 000063 | 中兴通讯   | 158,600   | 5,270,278.00 | 0.47 |
| 51 | 002241 | 歌尔股份   | 122,700   | 5,244,198.00 | 0.47 |
| 52 | 300347 | 泰格医药   | 27,000    | 5,219,100.00 | 0.47 |
| 53 | 603986 | 兆易创新   | 27,364    | 5,141,695.60 | 0.46 |
| 54 | 601601 | 中国太保   | 175,800   | 5,092,926.00 | 0.45 |
| 55 | 600585 | 海螺水泥   | 123,100   | 5,053,255.00 | 0.45 |
| 56 | 600690 | 海尔智家   | 194,400   | 5,036,904.00 | 0.45 |
| 57 | 002271 | 东方雨虹   | 90,750    | 5,020,290.00 | 0.45 |
| 58 | 601668 | 中国建筑   | 1,077,300 | 5,009,445.00 | 0.45 |
| 59 | 002460 | 赣锋锂业   | 41,286    | 4,999,321.74 | 0.45 |
| 60 | 002027 | 分众传媒   | 527,800   | 4,966,598.00 | 0.44 |
| 61 | 300142 | 沃森生物   | 80,300    | 4,954,510.00 | 0.44 |
| 62 | 600763 | 通策医疗   | 11,800    | 4,849,800.00 | 0.43 |
| 63 | 600016 | 民生银行   | 1,093,000 | 4,820,130.00 | 0.43 |
| 64 | 603799 | 华友钴业   | 40,756    | 4,654,335.20 | 0.42 |
| 65 | 601288 | 农业银行   | 1,475,700 | 4,471,371.00 | 0.40 |
| 66 | 600196 | 复星医药   | 61,900    | 4,464,847.00 | 0.40 |
| 67 | 600048 | 保利地产   | 368,900   | 4,441,556.00 | 0.40 |
| 68 | 600703 | 三安光电   | 138,200   | 4,429,310.00 | 0.40 |
| 69 | 000338 | 潍柴动力   | 244,002   | 4,360,315.74 | 0.39 |
| 70 | 600919 | 江苏银行   | 606,850   | 4,308,635.00 | 0.38 |
| 71 | 002129 | 中环股份   | 109,100   | 4,211,260.00 | 0.38 |
| 72 | 601229 | 上海银行   | 510,962   | 4,189,888.40 | 0.37 |
| 73 | 601688 | 华泰证券   | 264,600   | 4,180,680.00 | 0.37 |
| 74 | 600050 | 中国联通   | 960,100   | 4,147,632.00 | 0.37 |
| 75 | 600660 | 福耀玻璃   | 72,100    | 4,026,785.00 | 0.36 |
| 76 | 600570 | 恒生电子   | 42,864    | 3,997,068.00 | 0.36 |
| 77 | 601211 | 国泰君安   | 231,500   | 3,967,910.00 | 0.35 |
| 78 | 600104 | 上汽集团   | 180,100   | 3,956,797.00 | 0.35 |
| 79 | 601766 | 中国中车   | 624,700   | 3,798,176.00 | 0.34 |
| 80 | 688111 | 金山办公   | 9,600     | 3,790,080.00 | 0.34 |
| 81 | 601169 | 北京银行   | 760,200   | 3,702,174.00 | 0.33 |
| 82 | 600999 | 招商证券   | 190,540   | 3,624,070.80 | 0.32 |
| 83 | 002371 | 北方华创   | 12,900    | 3,578,202.00 | 0.32 |
| 84 | 600019 | 宝钢股份   | 457,500   | 3,495,300.00 | 0.31 |
| 85 | 002311 | 海大集团   | 42,600    | 3,476,160.00 | 0.31 |
| 86 | 600406 | 国电南瑞   | 149,220   | 3,467,872.80 | 0.31 |

|     |        |      |           |              |      |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 87  | 002049 | 紫光国微 | 21,800    | 3,361,342.00 | 0.30 |
| 88  | 601988 | 中国银行 | 1,082,500 | 3,334,100.00 | 0.30 |
| 89  | 002410 | 广联达  | 48,874    | 3,333,206.80 | 0.30 |
| 90  | 601088 | 中国神华 | 169,300   | 3,304,736.00 | 0.29 |
| 91  | 300498 | 温氏股份 | 229,040   | 3,291,304.80 | 0.29 |
| 92  | 601818 | 光大银行 | 849,600   | 3,211,488.00 | 0.29 |
| 93  | 300450 | 先导智能 | 52,600    | 3,163,364.00 | 0.28 |
| 94  | 300601 | 康泰生物 | 21,100    | 3,143,900.00 | 0.28 |
| 95  | 600745 | 闻泰科技 | 32,200    | 3,120,180.00 | 0.28 |
| 96  | 000625 | 长安汽车 | 116,700   | 3,066,876.00 | 0.27 |
| 97  | 000538 | 云南白药 | 26,300    | 3,043,436.00 | 0.27 |
| 98  | 600588 | 用友网络 | 90,394    | 3,006,504.44 | 0.27 |
| 99  | 600028 | 中国石化 | 687,100   | 2,995,756.00 | 0.27 |
| 100 | 601633 | 长城汽车 | 66,900    | 2,916,171.00 | 0.26 |
| 101 | 600893 | 航发动力 | 54,600    | 2,904,174.00 | 0.26 |
| 102 | 601628 | 中国人寿 | 85,500    | 2,897,595.00 | 0.26 |
| 103 | 002821 | 凯莱英  | 7,700     | 2,869,020.00 | 0.26 |
| 104 | 600346 | 恒力石化 | 108,500   | 2,847,040.00 | 0.25 |
| 105 | 601658 | 邮储银行 | 561,300   | 2,817,726.00 | 0.25 |
| 106 | 601390 | 中国中铁 | 523,000   | 2,740,520.00 | 0.24 |
| 107 | 600009 | 上海机场 | 56,900    | 2,738,597.00 | 0.24 |
| 108 | 300595 | 欧普康视 | 26,400    | 2,733,720.00 | 0.24 |
| 109 | 600111 | 北方稀土 | 130,800   | 2,707,560.00 | 0.24 |
| 110 | 601009 | 南京银行 | 256,900   | 2,702,588.00 | 0.24 |
| 111 | 002493 | 荣盛石化 | 156,100   | 2,695,847.00 | 0.24 |
| 112 | 601377 | 兴业证券 | 275,000   | 2,656,500.00 | 0.24 |
| 113 | 601857 | 中国石油 | 499,000   | 2,639,710.00 | 0.24 |
| 114 | 688036 | 传音控股 | 12,600    | 2,639,700.00 | 0.24 |
| 115 | 600132 | 重庆啤酒 | 12,700    | 2,513,965.00 | 0.22 |
| 116 | 300413 | 芒果超媒 | 36,500    | 2,503,900.00 | 0.22 |
| 117 | 601225 | 陕西煤业 | 205,600   | 2,436,360.00 | 0.22 |
| 118 | 600584 | 长电科技 | 64,000    | 2,411,520.00 | 0.22 |
| 119 | 002601 | 龙佰集团 | 69,100    | 2,389,478.00 | 0.21 |
| 120 | 300408 | 三环集团 | 55,839    | 2,368,690.38 | 0.21 |
| 121 | 600426 | 华鲁恒升 | 76,500    | 2,367,675.00 | 0.21 |
| 122 | 688012 | 中微公司 | 14,000    | 2,322,880.00 | 0.21 |
| 123 | 603882 | 金域医学 | 14,500    | 2,316,665.00 | 0.21 |
| 124 | 601100 | 恒立液压 | 26,932    | 2,313,997.44 | 0.21 |
| 125 | 000776 | 广发证券 | 152,000   | 2,301,280.00 | 0.21 |
| 126 | 601939 | 建设银行 | 344,900   | 2,293,585.00 | 0.20 |
| 127 | 000963 | 华东医药 | 49,797    | 2,291,159.97 | 0.20 |
| 128 | 002001 | 新和成  | 79,320    | 2,274,897.60 | 0.20 |
| 129 | 000895 | 双汇发展 | 71,300    | 2,267,340.00 | 0.20 |
| 130 | 300433 | 蓝思科技 | 76,400    | 2,246,924.00 | 0.20 |

|     |        |      |           |              |      |
|-----|--------|------|-----------|--------------|------|
| 131 | 600926 | 杭州银行 | 152,300   | 2,246,425.00 | 0.20 |
| 132 | 002179 | 中航光电 | 28,400    | 2,244,168.00 | 0.20 |
| 133 | 002050 | 三花智控 | 92,316    | 2,213,737.68 | 0.20 |
| 134 | 000166 | 申万宏源 | 463,100   | 2,167,308.00 | 0.19 |
| 135 | 600958 | 东方证券 | 214,500   | 2,142,855.00 | 0.19 |
| 136 | 600741 | 华域汽车 | 80,900    | 2,125,243.00 | 0.19 |
| 137 | 002841 | 视源股份 | 17,075    | 2,122,251.75 | 0.19 |
| 138 | 600600 | 青岛啤酒 | 18,200    | 2,104,830.00 | 0.19 |
| 139 | 300003 | 乐普医疗 | 64,900    | 2,084,588.00 | 0.19 |
| 140 | 002007 | 华兰生物 | 56,030    | 2,055,180.40 | 0.18 |
| 141 | 000786 | 北新建材 | 52,200    | 2,048,850.00 | 0.18 |
| 142 | 000157 | 中联重科 | 218,000   | 2,014,320.00 | 0.18 |
| 143 | 601006 | 大秦铁路 | 305,500   | 2,010,190.00 | 0.18 |
| 144 | 603806 | 福斯特  | 19,000    | 1,997,470.00 | 0.18 |
| 145 | 002607 | 中公教育 | 95,600    | 1,997,084.00 | 0.18 |
| 146 | 603993 | 洛阳钼业 | 383,600   | 1,979,376.00 | 0.18 |
| 147 | 601901 | 方正证券 | 211,300   | 1,977,768.00 | 0.18 |
| 148 | 601336 | 新华保险 | 42,800    | 1,964,948.00 | 0.18 |
| 149 | 600015 | 华夏银行 | 316,000   | 1,956,040.00 | 0.17 |
| 150 | 002236 | 大华股份 | 92,400    | 1,949,640.00 | 0.17 |
| 151 | 601155 | 新城控股 | 46,500    | 1,934,400.00 | 0.17 |
| 152 | 601989 | 中国重工 | 468,400   | 1,929,808.00 | 0.17 |
| 153 | 600143 | 金发科技 | 92,500    | 1,929,550.00 | 0.17 |
| 154 | 600176 | 中国巨石 | 123,204   | 1,910,894.04 | 0.17 |
| 155 | 601138 | 工业富联 | 153,800   | 1,908,658.00 | 0.17 |
| 156 | 000768 | 中航西飞 | 71,200    | 1,871,136.00 | 0.17 |
| 157 | 601600 | 中国铝业 | 351,900   | 1,865,070.00 | 0.17 |
| 158 | 600352 | 浙江龙盛 | 133,700   | 1,837,038.00 | 0.16 |
| 159 | 601877 | 正泰电器 | 55,000    | 1,835,900.00 | 0.16 |
| 160 | 600760 | 中航沈飞 | 30,360    | 1,830,708.00 | 0.16 |
| 161 | 300529 | 健帆生物 | 21,100    | 1,822,196.00 | 0.16 |
| 162 | 600010 | 包钢股份 | 1,170,600 | 1,814,430.00 | 0.16 |
| 163 | 601788 | 光大证券 | 100,200   | 1,792,578.00 | 0.16 |
| 164 | 600547 | 山东黄金 | 92,940    | 1,786,306.80 | 0.16 |
| 165 | 001979 | 招商蛇口 | 163,000   | 1,784,850.00 | 0.16 |
| 166 | 002008 | 大族激光 | 43,900    | 1,773,121.00 | 0.16 |
| 167 | 688169 | 石头科技 | 1,400     | 1,765,400.00 | 0.16 |
| 168 | 601186 | 中国铁建 | 236,300   | 1,755,709.00 | 0.16 |
| 169 | 603369 | 今世缘  | 32,400    | 1,754,784.00 | 0.16 |
| 170 | 002202 | 金风科技 | 141,689   | 1,722,938.24 | 0.15 |
| 171 | 601916 | 浙商银行 | 431,200   | 1,711,864.00 | 0.15 |
| 172 | 000876 | 新希望  | 115,780   | 1,698,492.60 | 0.15 |
| 173 | 002555 | 三七互娱 | 68,400    | 1,642,968.00 | 0.15 |
| 174 | 601799 | 星宇股份 | 7,200     | 1,625,184.00 | 0.15 |

|     |        |       |         |              |      |
|-----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 175 | 003816 | 中国广核  | 606,100 | 1,618,287.00 | 0.14 |
| 176 | 000938 | 紫光股份  | 73,620  | 1,610,805.60 | 0.14 |
| 177 | 603899 | 晨光文具  | 19,000  | 1,606,640.00 | 0.14 |
| 178 | 002736 | 国信证券  | 148,000 | 1,591,000.00 | 0.14 |
| 179 | 601066 | 中信建投  | 50,200  | 1,577,786.00 | 0.14 |
| 180 | 600109 | 国金证券  | 124,200 | 1,576,098.00 | 0.14 |
| 181 | 000069 | 华侨城 A | 210,500 | 1,566,120.00 | 0.14 |
| 182 | 603160 | 汇顶科技  | 12,000  | 1,555,560.00 | 0.14 |
| 183 | 600989 | 宝丰能源  | 113,600 | 1,554,048.00 | 0.14 |
| 184 | 000425 | 徐工机械  | 241,500 | 1,538,355.00 | 0.14 |
| 185 | 300136 | 信维通信  | 49,800  | 1,537,824.00 | 0.14 |
| 186 | 600150 | 中国船舶  | 92,400  | 1,525,524.00 | 0.14 |
| 187 | 601669 | 中国电建  | 392,900 | 1,520,523.00 | 0.14 |
| 188 | 603659 | 璞泰来   | 10,900  | 1,488,940.00 | 0.13 |
| 189 | 688008 | 澜起科技  | 23,700  | 1,478,406.00 | 0.13 |
| 190 | 000977 | 浪潮信息  | 52,400  | 1,474,012.00 | 0.13 |
| 191 | 600795 | 国电电力  | 605,500 | 1,471,365.00 | 0.13 |
| 192 | 002384 | 东山精密  | 70,400  | 1,467,136.00 | 0.13 |
| 193 | 000783 | 长江证券  | 198,900 | 1,455,948.00 | 0.13 |
| 194 | 601238 | 广汽集团  | 112,300 | 1,454,285.00 | 0.13 |
| 195 | 603019 | 中科曙光  | 52,320  | 1,444,555.20 | 0.13 |
| 196 | 000596 | 古井贡酒  | 6,000   | 1,437,000.00 | 0.13 |
| 197 | 600085 | 同仁堂   | 35,100  | 1,433,835.00 | 0.13 |
| 198 | 600079 | 人福医药  | 50,700  | 1,433,289.00 | 0.13 |
| 199 | 002624 | 完美世界  | 59,650  | 1,426,231.50 | 0.13 |
| 200 | 300677 | 英科医疗  | 11,400  | 1,422,720.00 | 0.13 |
| 201 | 601838 | 成都银行  | 111,400 | 1,408,096.00 | 0.13 |
| 202 | 600029 | 南方航空  | 229,300 | 1,380,386.00 | 0.12 |
| 203 | 600183 | 生益科技  | 58,700  | 1,374,167.00 | 0.12 |
| 204 | 600886 | 国投电力  | 142,900 | 1,373,269.00 | 0.12 |
| 205 | 601985 | 中国核电  | 269,100 | 1,361,646.00 | 0.12 |
| 206 | 000703 | 恒逸石化  | 113,570 | 1,357,161.50 | 0.12 |
| 207 | 601108 | 财通证券  | 129,000 | 1,353,210.00 | 0.12 |
| 208 | 300144 | 宋城演艺  | 80,500  | 1,352,400.00 | 0.12 |
| 209 | 601360 | 三六零   | 110,100 | 1,344,321.00 | 0.12 |
| 210 | 603833 | 欧派家居  | 9,460   | 1,342,941.60 | 0.12 |
| 211 | 603517 | 绝味食品  | 15,800  | 1,331,782.00 | 0.12 |
| 212 | 002414 | 高德红外  | 48,280  | 1,331,562.40 | 0.12 |
| 213 | 601555 | 东吴证券  | 159,580 | 1,330,897.20 | 0.12 |
| 214 | 002600 | 领益智造  | 144,800 | 1,330,712.00 | 0.12 |
| 215 | 000066 | 中国长城  | 90,300  | 1,318,380.00 | 0.12 |
| 216 | 002044 | 美年健康  | 140,900 | 1,283,599.00 | 0.11 |
| 217 | 300676 | 华大基因  | 10,800  | 1,280,880.00 | 0.11 |
| 218 | 601077 | 渝农商行  | 319,300 | 1,274,007.00 | 0.11 |



|     |        |      |         |              |      |
|-----|--------|------|---------|--------------|------|
| 219 | 002938 | 鹏鼎控股 | 35,500  | 1,273,740.00 | 0.11 |
| 220 | 600522 | 中天科技 | 125,900 | 1,259,000.00 | 0.11 |
| 221 | 688396 | 华润微  | 13,800  | 1,256,076.00 | 0.11 |
| 222 | 300033 | 同花顺  | 11,100  | 1,251,858.00 | 0.11 |
| 223 | 601607 | 上海医药 | 59,200  | 1,250,896.00 | 0.11 |
| 224 | 000728 | 国元证券 | 156,930 | 1,250,732.10 | 0.11 |
| 225 | 002602 | 世纪华通 | 191,280 | 1,228,017.60 | 0.11 |
| 226 | 600332 | 白云山  | 36,000  | 1,218,600.00 | 0.11 |
| 227 | 600872 | 中炬高新 | 28,800  | 1,210,176.00 | 0.11 |
| 228 | 600161 | 天坛生物 | 35,100  | 1,202,175.00 | 0.11 |
| 229 | 600362 | 江西铜业 | 53,500  | 1,197,330.00 | 0.11 |
| 230 | 601111 | 中国国航 | 153,500 | 1,194,230.00 | 0.11 |
| 231 | 600383 | 金地集团 | 116,100 | 1,188,864.00 | 0.11 |
| 232 | 300628 | 亿联网络 | 14,100  | 1,181,580.00 | 0.11 |
| 233 | 601800 | 中国交建 | 181,100 | 1,173,528.00 | 0.10 |
| 234 | 600845 | 宝信软件 | 22,980  | 1,169,682.00 | 0.10 |
| 235 | 600115 | 中国东航 | 230,000 | 1,168,400.00 | 0.10 |
| 236 | 002916 | 深南电路 | 10,240  | 1,137,971.20 | 0.10 |
| 237 | 002508 | 老板电器 | 24,400  | 1,134,600.00 | 0.10 |
| 238 | 000860 | 顺鑫农业 | 26,800  | 1,130,424.00 | 0.10 |
| 239 | 600061 | 国投资本 | 131,960 | 1,120,340.40 | 0.10 |
| 240 | 601727 | 上海电气 | 262,600 | 1,113,424.00 | 0.10 |
| 241 | 601618 | 中国中冶 | 366,700 | 1,092,766.00 | 0.10 |
| 242 | 002024 | 苏宁易购 | 193,900 | 1,083,901.00 | 0.10 |
| 243 | 000708 | 中信特钢 | 52,000  | 1,083,680.00 | 0.10 |
| 244 | 601162 | 天风证券 | 222,630 | 1,081,981.80 | 0.10 |
| 245 | 601021 | 春秋航空 | 18,800  | 1,069,720.00 | 0.10 |
| 246 | 600705 | 中航产融 | 274,700 | 1,063,089.00 | 0.09 |
| 247 | 688363 | 华熙生物 | 3,800   | 1,055,868.00 | 0.09 |
| 248 | 601878 | 浙商证券 | 79,500  | 1,039,860.00 | 0.09 |
| 249 | 603939 | 益丰药房 | 18,500  | 1,037,665.00 | 0.09 |
| 250 | 600606 | 绿地控股 | 187,300 | 1,020,785.00 | 0.09 |
| 251 | 601990 | 南京证券 | 94,800  | 997,296.00   | 0.09 |
| 252 | 002456 | 欧菲光  | 110,800 | 983,904.00   | 0.09 |
| 253 | 603195 | 公牛集团 | 4,801   | 969,802.00   | 0.09 |
| 254 | 002157 | 正邦科技 | 81,100  | 969,145.00   | 0.09 |
| 255 | 002463 | 沪电股份 | 61,900  | 957,593.00   | 0.09 |
| 256 | 600011 | 华能国际 | 226,100 | 954,142.00   | 0.09 |
| 257 | 000656 | 金科股份 | 164,400 | 951,876.00   | 0.08 |
| 258 | 600521 | 华海药业 | 45,100  | 941,688.00   | 0.08 |
| 259 | 601933 | 永辉超市 | 195,500 | 924,715.00   | 0.08 |
| 260 | 600655 | 豫园股份 | 79,700  | 923,723.00   | 0.08 |
| 261 | 603392 | 万泰生物 | 3,520   | 912,313.60   | 0.08 |
| 262 | 600118 | 中国卫星 | 30,500  | 892,430.00   | 0.08 |

|     |        |      |         |            |      |
|-----|--------|------|---------|------------|------|
| 263 | 601696 | 中银证券 | 43,000  | 885,370.00 | 0.08 |
| 264 | 601216 | 君正集团 | 173,300 | 882,097.00 | 0.08 |
| 265 | 600848 | 上海临港 | 49,200  | 880,680.00 | 0.08 |
| 266 | 600489 | 中金黄金 | 99,400  | 856,828.00 | 0.08 |
| 267 | 600018 | 上港集团 | 178,600 | 851,922.00 | 0.08 |
| 268 | 601995 | 中金公司 | 13,800  | 848,700.00 | 0.08 |
| 269 | 002558 | 巨人网络 | 62,600  | 832,580.00 | 0.07 |
| 270 | 002120 | 韵达股份 | 59,410  | 803,817.30 | 0.07 |
| 271 | 601998 | 中信银行 | 157,500 | 803,250.00 | 0.07 |
| 272 | 601872 | 招商轮船 | 166,080 | 767,289.60 | 0.07 |
| 273 | 688009 | 中国通号 | 133,500 | 759,615.00 | 0.07 |
| 274 | 002673 | 西部证券 | 91,900  | 758,175.00 | 0.07 |
| 275 | 601319 | 中国人保 | 127,600 | 756,668.00 | 0.07 |
| 276 | 688126 | 沪硅产业 | 25,900  | 755,762.00 | 0.07 |
| 277 | 603338 | 浙江鼎力 | 12,700  | 745,363.00 | 0.07 |
| 278 | 002739 | 万达电影 | 45,900  | 724,761.00 | 0.06 |
| 279 | 601881 | 中国银河 | 66,200  | 713,636.00 | 0.06 |
| 280 | 603658 | 安图生物 | 9,170   | 694,810.90 | 0.06 |
| 281 | 002032 | 苏泊尔  | 10,200  | 650,658.00 | 0.06 |
| 282 | 600233 | 圆通速递 | 64,900  | 649,649.00 | 0.06 |
| 283 | 603233 | 大参林  | 12,400  | 633,764.00 | 0.06 |
| 284 | 600482 | 中国动力 | 33,100  | 576,602.00 | 0.05 |
| 285 | 601231 | 环旭电子 | 33,900  | 569,859.00 | 0.05 |
| 286 | 002153 | 石基信息 | 23,080  | 542,610.80 | 0.05 |
| 287 | 600025 | 华能水电 | 92,600  | 536,154.00 | 0.05 |
| 288 | 002939 | 长城证券 | 47,900  | 533,127.00 | 0.05 |
| 289 | 600340 | 华夏幸福 | 100,360 | 525,886.40 | 0.05 |
| 290 | 000800 | 一汽解放 | 48,100  | 520,442.00 | 0.05 |
| 291 | 601236 | 红塔证券 | 37,200  | 504,432.00 | 0.05 |
| 292 | 601808 | 中海油服 | 30,600  | 439,416.00 | 0.04 |
| 293 | 002773 | 康弘药业 | 18,800  | 434,844.00 | 0.04 |
| 294 | 600918 | 中泰证券 | 39,300  | 425,226.00 | 0.04 |
| 295 | 601698 | 中国卫通 | 22,600  | 365,894.00 | 0.03 |
| 296 | 603087 | 甘李药业 | 3,200   | 341,056.00 | 0.03 |
| 297 | 600299 | 安迪苏  | 20,600  | 246,376.00 | 0.02 |
| 298 | 002945 | 华林证券 | 14,000  | 193,480.00 | 0.02 |
| 299 | 300558 | 贝达药业 | 245     | 26,518.80  | 0.00 |

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------|------|-------|------|--------------|
|----|------|------|-------|------|--------------|

|    |        |      |            |            |      |
|----|--------|------|------------|------------|------|
| 1  | 688538 | 和辉光电 | 247,602.00 | 836,894.76 | 0.07 |
| 2  | 300957 | 贝泰妮  | 826.00     | 208,118.96 | 0.02 |
| 3  | 688687 | 凯因科技 | 5,354.00   | 149,804.92 | 0.01 |
| 4  | 688323 | 瑞华泰  | 4,513.00   | 102,806.14 | 0.01 |
| 5  | 688656 | 浩欧博  | 1,371.00   | 99,534.60  | 0.01 |
| 6  | 300919 | 中伟股份 | 610.00     | 99,430.00  | 0.01 |
| 7  | 688109 | 品茗股份 | 1,301.00   | 93,802.10  | 0.01 |
| 8  | 688329 | 艾隆科技 | 1,846.00   | 92,373.84  | 0.01 |
| 9  | 300979 | 华利集团 | 925.00     | 80,937.50  | 0.01 |
| 10 | 688663 | 新风光  | 3,279.00   | 62,989.59  | 0.01 |
| 11 | 688087 | 英科再生 | 2,469.00   | 54,219.24  | 0.00 |
| 12 | 301017 | 漱玉平民 | 5,550.00   | 49,173.00  | 0.00 |
| 13 | 301020 | 密封科技 | 4,210.00   | 44,794.40  | 0.00 |
| 14 | 300894 | 火星人  | 628.00     | 42,704.00  | 0.00 |
| 15 | 601528 | 瑞丰银行 | 2,230.00   | 34,721.10  | 0.00 |
| 16 | 688681 | 科汇股份 | 1,899.00   | 27,611.46  | 0.00 |
| 17 | 301021 | 英诺激光 | 2,899.00   | 27,424.54  | 0.00 |
| 18 | 001207 | 联科科技 | 682.00     | 22,581.02  | 0.00 |
| 19 | 301009 | 可靠股份 | 801.00     | 22,339.89  | 0.00 |
| 20 | 300941 | 创识科技 | 399.00     | 19,926.06  | 0.00 |
| 21 | 301015 | 百洋医药 | 462.00     | 17,939.46  | 0.00 |
| 22 | 688226 | 威腾电气 | 2,693.00   | 17,289.06  | 0.00 |
| 23 | 300925 | 法本信息 | 600.00     | 15,774.00  | 0.00 |
| 24 | 300932 | 三友联众 | 492.00     | 15,601.32  | 0.00 |
| 25 | 300982 | 苏文电能 | 317.00     | 14,356.93  | 0.00 |
| 26 | 300968 | 格林精密 | 1,162.00   | 14,025.34  | 0.00 |
| 27 | 001208 | 华菱线缆 | 1,754.00   | 13,558.42  | 0.00 |
| 28 | 300940 | 南极光  | 307.00     | 13,317.66  | 0.00 |
| 29 | 300614 | 百川畅银 | 329.00     | 13,285.02  | 0.00 |
| 30 | 300942 | 易瑞生物 | 443.00     | 12,634.36  | 0.00 |
| 31 | 603171 | 税友股份 | 637.00     | 12,230.40  | 0.00 |
| 32 | 301002 | 崧盛股份 | 201.00     | 11,581.62  | 0.00 |
| 33 | 605287 | 德才股份 | 349.00     | 11,014.44  | 0.00 |
| 34 | 300956 | 英力股份 | 371.00     | 9,571.80   | 0.00 |
| 35 | 300962 | 中金辐照 | 576.00     | 9,429.12   | 0.00 |
| 36 | 300952 | 恒辉安防 | 340.00     | 9,207.20   | 0.00 |
| 37 | 301016 | 雷尔伟  | 275.00     | 9,069.50   | 0.00 |
| 38 | 300966 | 共同药业 | 286.00     | 9,020.44   | 0.00 |
| 39 | 300945 | 曼卡龙  | 474.00     | 8,949.12   | 0.00 |
| 40 | 300931 | 通用电梯 | 672.00     | 8,809.92   | 0.00 |
| 41 | 300961 | 深水海纳 | 394.00     | 8,695.58   | 0.00 |
| 42 | 300950 | 德固特  | 219.00     | 8,569.47   | 0.00 |
| 43 | 605162 | 新中港  | 1,377.00   | 8,358.39   | 0.00 |
| 44 | 300986 | 志特新材 | 264.00     | 8,070.48   | 0.00 |

|    |        |      |        |          |      |
|----|--------|------|--------|----------|------|
| 45 | 300978 | 东箭科技 | 593.00 | 8,064.80 | 0.00 |
| 46 | 300930 | 屹通新材 | 322.00 | 7,882.56 | 0.00 |
| 47 | 300985 | 致远新能 | 295.00 | 7,318.95 | 0.00 |
| 48 | 300971 | 博亚精工 | 245.00 | 6,931.05 | 0.00 |
| 49 | 301004 | 嘉益股份 | 312.00 | 6,845.28 | 0.00 |
| 50 | 300991 | 创益通  | 254.00 | 6,733.54 | 0.00 |
| 51 | 300927 | 江天化学 | 217.00 | 6,531.70 | 0.00 |
| 52 | 300975 | 商络电子 | 492.00 | 6,410.76 | 0.00 |
| 53 | 300963 | 中洲特材 | 283.00 | 6,364.67 | 0.00 |
| 54 | 301011 | 华立科技 | 175.00 | 5,922.00 | 0.00 |
| 55 | 300943 | 春晖智控 | 255.00 | 5,867.55 | 0.00 |
| 56 | 300967 | 晓鸣股份 | 507.00 | 5,850.78 | 0.00 |
| 57 | 300972 | 万辰生物 | 430.00 | 5,439.50 | 0.00 |
| 58 | 300929 | 华骐环保 | 183.00 | 5,407.65 | 0.00 |
| 59 | 300960 | 通业科技 | 234.00 | 5,396.04 | 0.00 |
| 60 | 605011 | 杭州热电 | 525.00 | 4,662.00 | 0.00 |
| 61 | 300995 | 奇德新材 | 191.00 | 4,454.12 | 0.00 |
| 62 | 301007 | 德迈仕  | 303.00 | 4,375.32 | 0.00 |
| 63 | 300998 | 宁波方正 | 201.00 | 4,285.32 | 0.00 |
| 64 | 301012 | 扬电科技 | 170.00 | 4,124.20 | 0.00 |
| 65 | 300992 | 泰福泵业 | 200.00 | 4,064.00 | 0.00 |
| 66 | 301010 | 晶雪节能 | 218.00 | 3,838.98 | 0.00 |

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 本期累计买入金额     | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|--------------|-----------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 5,263,449.00 | 0.33            |
| 2  | 300274 | 阳光电源 | 5,196,440.00 | 0.33            |
| 3  | 601816 | 京沪高铁 | 4,791,939.00 | 0.30            |
| 4  | 688111 | 金山办公 | 4,041,584.01 | 0.25            |
| 5  | 300450 | 先导智能 | 3,407,879.20 | 0.21            |
| 6  | 300595 | 欧普康视 | 2,808,876.00 | 0.18            |
| 7  | 600426 | 华鲁恒升 | 2,583,630.00 | 0.16            |
| 8  | 600132 | 重庆啤酒 | 2,169,931.00 | 0.14            |
| 9  | 002415 | 海康威视 | 2,108,372.48 | 0.13            |
| 10 | 600050 | 中国联通 | 2,095,188.00 | 0.13            |
| 11 | 603882 | 金域医学 | 2,093,121.00 | 0.13            |
| 12 | 688169 | 石头科技 | 2,053,399.96 | 0.13            |
| 13 | 601658 | 邮储银行 | 1,993,648.00 | 0.13            |

|    |        |       |              |      |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 14 | 601012 | 隆基股份  | 1,982,619.00 | 0.12 |
| 15 | 300122 | 智飞生物  | 1,953,326.50 | 0.12 |
| 16 | 600143 | 金发科技  | 1,880,163.00 | 0.12 |
| 17 | 600900 | 长江电力  | 1,848,303.00 | 0.12 |
| 18 | 603806 | 福斯特   | 1,800,847.00 | 0.11 |
| 19 | 000725 | 京东方 A | 1,738,976.00 | 0.11 |
| 20 | 002607 | 中公教育  | 1,564,203.00 | 0.10 |

#### 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  | 000858 | 五粮液    | 16,066,299.35 | 1.01            |
| 2  | 000333 | 美的集团   | 10,545,447.00 | 0.66            |
| 3  | 000651 | 格力电器   | 8,140,825.00  | 0.51            |
| 4  | 300059 | 东方财富   | 6,578,285.50  | 0.41            |
| 5  | 000001 | 平安银行   | 6,162,457.00  | 0.39            |
| 6  | 002415 | 海康威视   | 5,595,413.00  | 0.35            |
| 7  | 000002 | 万科 A   | 5,496,209.00  | 0.35            |
| 8  | 002714 | 牧原股份   | 5,483,796.80  | 0.34            |
| 9  | 002594 | 比亚迪    | 5,384,857.00  | 0.34            |
| 10 | 000568 | 泸州老窖   | 5,287,879.81  | 0.33            |
| 11 | 002475 | 立讯精密   | 4,700,787.00  | 0.30            |
| 12 | 000725 | 京东方 A  | 4,611,461.00  | 0.29            |
| 13 | 300122 | 智飞生物   | 3,628,588.00  | 0.23            |
| 14 | 000661 | 长春高新   | 3,536,713.00  | 0.22            |
| 15 | 000100 | TCL 科技 | 3,527,716.00  | 0.22            |
| 16 | 002304 | 洋河股份   | 3,301,637.00  | 0.21            |
| 17 | 002142 | 宁波银行   | 3,219,983.00  | 0.20            |
| 18 | 002352 | 顺丰控股   | 3,195,351.00  | 0.20            |
| 19 | 002027 | 分众传媒   | 3,006,013.00  | 0.19            |
| 20 | 300015 | 爱尔眼科   | 2,886,860.00  | 0.18            |

#### 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 | 99,536,627.16  |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 288,200,041.25 |

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      | -          | -            |
| 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） | 138,411.53 | 0.01         |
| 8  | 同业存单      | -          | -            |
| 9  | 其他        | -          | -            |
| 10 | 合计        | 138,411.53 | 0.01         |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 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  | 127036 | 三花转债 | 820   | 107,411.80 | 0.01         |
| 2  | 113049 | 长汽转债 | 310   | 30,999.73  | 0.00         |

## 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

为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。

本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本，追求对标的指数的紧密跟踪。

## 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贵州茅台、招商银行和兴业银行外，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。

兴业银行（601166）的发行主体兴业银行股份有限公司，因同业投资用途不合规、授信管理不尽职等违法违规事由，于 2020 年 8 月 31 日被中国银保监会福建监管局合计罚没 2232.36 万元。因在作为永城煤电控股集团有限公司主承销商期间存在涉嫌违反银行间债券市场自律管理规则的行为，于 2021 年 1 月 15 日被中国银行间市场交易商协会采取通报批评、责令整改的行政监管措施，并将有关违规情况报送中国人民银行、中国银保监会。福州分行因违规转接清算、银行卡收单外包等违法违规行为，于 2020 年 9 月 4 日被中国人民银行福州中心支行罚没 2469.953 万元。上海分行因同业资金违规用于股权投资、房地产项目等违法违规行为，于 2020 年 7 月 28 日被银保监会上海监管局

责令改正并处罚款 450 万元。

招商银行（600036）的发行主体是招商银行股份有限公司，其福州分行因所收税款延迟划缴国库等违法违规行为，于 2020 年 9 月 7 日被中国人民银行福州中心支行给予警告，没收违法所得 163.28 元，并处 303.5 万元罚款。因为同业投资提供第三方信用担保、为非保本理财产品出具保本承诺，部分未按规定计提风险加权资产等二十七项违法违规事由，于 2021 年 5 月 17 日被中国银行保险监督管理委员会罚款 7170 万元。

贵州茅台（600519）的发行主体贵州茅台酒股份有限公司，其董事长高卫东因在茅台酱香系列酒 2020 年度全国经销商联谊会上发布了酱香系列酒相关数据，违反了《上市公司信息披露管理办法》第六条第二款、第四十五条第二款的规定，于 2020 年 12 月 31 日被贵州证监局采取出具警示函的行政监管措施。

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   | 51,126.78    |
| 2  | 应收证券清算款 | 3,483,456.05 |
| 3  | 应收股利    | 7,751.00     |
| 4  | 应收利息    | 4,606.10     |
| 5  | 应收申购款   | -            |
| 6  | 其他应收款   | -            |
| 7  | 待摊费用    | -            |
| 8  | 其他      | -            |
| 9  | 合计      | 3,546,939.93 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明



**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 流通受限部分的<br>公允价值 | 占基金资产净<br>值比例(%) | 流通受限情<br>况说明 |
|----|--------|------|-----------------|------------------|--------------|
| 1  | 688538 | 和辉光电 | 836,894.76      | 0.07             | 新股锁定         |
| 2  | 300957 | 贝泰妮  | 208,118.96      | 0.02             | 新股锁定         |
| 3  | 688687 | 凯因科技 | 149,804.92      | 0.01             | 新股锁定         |
| 4  | 688323 | 瑞华泰  | 102,806.14      | 0.01             | 新股锁定         |
| 5  | 688656 | 浩欧博  | 99,534.60       | 0.01             | 新股锁定         |

**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<br>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<br>比例 | 持有份额         | 占总份额<br>比例 |
| 2,713    | 73,569.54     | 192,018,032.00 | 96.20%     | 7,576,133.00 | 3.80%      |

**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  | 中国工商银行股份有限公司—国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 147,900,000.00 | 74.10%   |
| 2  | 长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益                    | 43,504,798.00  | 21.80%   |

|    |                                |            |       |
|----|--------------------------------|------------|-------|
|    | 基金型投资产品（保额分红）委托专户              |            |       |
| 3  | 华泰证券股份有限公司                     | 428,875.00 | 0.21% |
| 4  | 缪美琴                            | 198,800.00 | 0.10% |
| 5  | 福州融航资产管理有限公司—融航聚塔 11 号私募证券投资基金 | 184,100.00 | 0.09% |
| 6  | 夏晓静                            | 182,500.00 | 0.09% |
| 7  | 王仁飞                            | 116,600.00 | 0.06% |
| 8  | 欧健                             | 113,200.00 | 0.06% |
| 9  | 唐琳                             | 112,300.00 | 0.06% |
| 10 | 刘卫                             | 100,000.00 | 0.05% |
| 10 | 朱其敏                            | 100,000.00 | 0.05% |

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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

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；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

单位：份

|                                 |                |
|---------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2019 年 11 月 25 日）基金份额总额 | 500,986,890.00 |
| 本报告期期初基金份额总额                    | 288,694,165.00 |
| 本报告期基金总申购份额                     | 1,800,000.00   |
| 减：本报告期基金总赎回份额                   | 90,900,000.00  |
| 本报告期基金拆分变动份额                    | -              |
| 本报告期期末基金份额总额                    | 199,594,165.00 |

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

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、中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司

资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 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 |    |
| 国元证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 招商证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国信证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中信证券股份有限公司   | 2      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 中泰证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 东方证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国泰君安证券股份有限公司 | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 光大证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 平安证券股份有限公司   | 1      | -              | -            | -          | -          | -  |
| 国金证券股份有限公司   | 1      | 177,573,403.38 | 46.81%       | 161,823.48 | 46.48%     | -  |
| 兴业证券股份有限公司   | 1      | 109,460,528.13 | 28.86%       | 101,940.59 | 29.28%     | -  |
| 中国国际金融       | 1      | 55,070,283.98  | 14.52%       | 50,185.48  | 14.41%     | -  |

|                |   |               |       |           |       |   |
|----------------|---|---------------|-------|-----------|-------|---|
| 股份有限公司         |   |               |       |           |       |   |
| 华泰证券股份<br>有限公司 | 3 | 37,231,994.70 | 9.82% | 34,198.37 | 9.82% | - |

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

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

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

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

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

A 提供的研究报告质量和数量；

B 研究报告被基金采纳的情况；

C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；

D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；

E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；

F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；

G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；

H 其他可评价的量化标准。

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

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内租用证券公司交易单元的无变更。

## 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 |
| 国元证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 招商证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国信证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中信证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中泰证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 东方证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国泰君安证券股份有限公司 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 光大证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 平安证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 国金证券股份有限公司   | 1,689,598.95 | 47.49%       | -    | -            | -    | -            |
| 兴业证券股份有限公司   | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 中国国际金融股份有限公司 | -            | -            | -    | -            | -    | -            |
| 华泰证券股份有限公司   | 1,868,425.20 | 52.51%       | -    | -            | -    | -            |

## 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 | 规定报刊、规定网站 | 2021-01-05 |

|    |   |                           |            |
|----|---|---------------------------|------------|
|    | 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                                       |                           |            |
| 2  | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告                         | 规定网站、上海证券交易所              | 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  | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加安信证券为代销机构的公告                               | 规定报刊、规定网站                 | 2021-02-02 |
| 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  | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告                             | 规定网站、上海证券交易所              | 2021-03-31 |
| 7  | 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 |
| 8  | 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 |
| 9  | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同                                    | 规定网站、上海证券交易所              | 2021-03-31 |
| 10 | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新                              | 规定网站、上海证券交易所              | 2021-04-06 |
| 11 | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）                               | 规定网站、上海证券交易所              | 2021-04-06 |
| 12 | 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认/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 |
| 13 | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告                         | 规定网站、上海证券交易所              | 2021-04-22 |
| 14 | 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 |
| 15 | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2021 年第 2 号)                    | 规定网站、上海证券交易所              | 2021-05-20 |
| 16 | 国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新                              | 规定网站、上海证券交易所              | 2021-05-20 |

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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 | 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 | 100,760,180.00 | 0.00 | 57,255,382.00 | 43,504,798.00  | 21.80% |
| 联接基金 | 1 | 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日 | 183,100,000.00 | 0.00 | 35,200,000.00 | 147,900,000.00 | 74.10% |

#### 产品特有风险

(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。

(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。

(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。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

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

国联安基金管理有限公司

二〇二一年八月三十一日