

# 国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金

## 2021 年第 4 季度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国银河证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年一月二十四日

## §1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 1 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## §2 基金产品概况

基金简称	国联安创科技 ETF
场内简称	创科技 ETF 基金
基金主代码	159777
交易代码	159777
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 27 日
报告期末基金份额总额	18,280,565.00 份
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。
投资策略	本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.25% 以内，年化跟踪误差控制在 3% 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。本基金主要

	<p>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>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	创业板科技指数收益率
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。
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期
	(2021 年 10 月 1 日-2021 年 12 月 31 日)
1.本期已实现收益	2,402,933.27
2.本期利润	2,446,973.42
3.加权平均基金份额本期利润	0.0417
4.期末基金资产净值	18,624,786.20
5.期末基金份额净值	1.0188

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收

益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益,包含停牌股票按公允价值调整的影响;

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 本报告期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

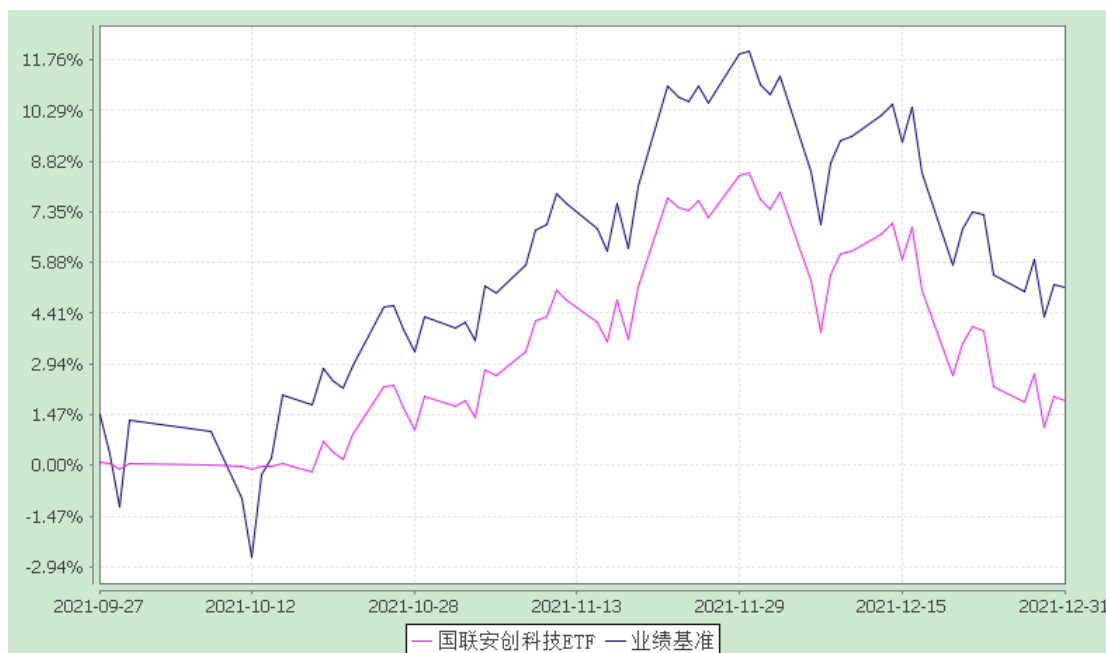
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.84%	0.93%	3.81%	1.12%	-1.97%	-0.19%
过去六个月	-	-	-	-	-	-
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	1.88%	0.90%	5.16%	1.17%	-3.28%	-0.27%

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

国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021 年 9 月 27 日至 2021 年 12 月 31 日)



- 注：1、本基金业绩比较基准为创业板科技指数收益率；
- 2、本基金基金合同于2021年9月27日生效。截至报告期末，本基金成立不满一年；
- 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的6个月。截至本报告期末，本基金尚在建仓期；
- 4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章榭元	本基金基金经理、兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放	2021-09-27	-	13年（自2008年起）	章榭元先生，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、

	<p>式指数 证券投资 基金 基金经 理、国 联安中 证全指 半导体 产品与 设备交 易型开 放式指 数证券 投资基 金联接 基金基 金经 理、国 联安沪 深 300 交易型 开放式 指数证 券投资 基金基 金经 理、国 联安沪 深 300 交易型 开放式 指数证 券投资 基金联 接基金 基金经 理、国 联安中 证全指 证券公 司交易 型开放 式指数 证券投</p>				<p>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，2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2021 年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

	<p>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 金基 金经 理、国 联安上 证科创 板 50 成份交 易型开 放式指 数证券 投资基 金基金 经理、 国联安 新精选 灵活配 置混合 型证券 投资基 金基金 经理、 量化投 资部总 经理。</p>				
黄欣	<p>本基金 基金经 理、兼 任国联 安中证 100 指 数证券 投资基 金</p>	2021-09-27	-	19 年（自 2002 年起）	<p>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</p>

	<p>(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</p>			<p>年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理, 2010 年 11 月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2010 年 12 月起兼任国联安上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2013 年 6 月至 2017 年 3 月兼任国联安中证股债动态策略指数证券投资基金的基金经理, 2016 年 8 月起兼任国联安中证医药 100 指数证券投资基金和国联安中小企业综合指数证券投资基金(LOF) (原国联安双力中小板综指证券投资基金 (LOF)) 的基金经理, 2018 年 3 月至 2019 年 7 月兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理, 2019 年 5 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 6 月起兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2019 年 11 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2019 年 12 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理, 2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理, 2021 年 5 月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,</p>
--	--	--	--	---



	<p>(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经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联</p>				<p>2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

	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。				
--	---	--	--	--	--

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》、《国联安创业板科技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 公平交易专项说明

#### 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超过该证券当日成交量 5% 的交易次数为 2 次，发生原因是为了满足产品合同中相关投资比例的限制要求。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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年 4 季度，新冠疫情的发展超出了人们的预期，世界范围内的经济复苏仍存在着巨大的压力。虽然国内有效的防疫政策保证了全面的复产复工，但境外病毒的不断变种、传染力增强，对国内的一些产业发展还是带来了一定的冲击，再加上一些行业出现债务违约的情形，整体的经济情况疲软。

虽然经济大环境不佳，在缺乏足够的投资渠道的情况下，资金进入股市的需求还是比较旺盛的。对于股市来说，依旧存在不少结构性的机会。非接触经济、碳中和、碳达峰、元宇宙等投资主题不断涌现，科技和经济的发展也在不断的超出人们的想象。

4 季度大小盘股表现略有分化，小盘股表现相对较好。分行业来看，科技类的股票涨幅较大。整个 4 季度沪深 300 指数上涨约 1.52%，中证 500 指数上涨 3.60%，创科技指数上涨 3.81%。

本基金于 10 月份建仓并上市交易，依据基金合同的约定，上市后本基金保持较高的仓位，采用完全复制的方法跟踪创科技指数，将跟踪误差控制在合理范围。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.0188 元，本报告期份额净值增长率为 1.84%，同期业绩比较基准收益率为 3.81%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.07%，年化跟踪误差为 1.38%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.25%，以及年化跟踪误差不得超过 3.0% 的限制。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

2021 年 10 月 26 日至 2021 年 12 月 31 日，本基金资产净值低于 5000 万元。

基金管理人拟通过持续营销活动做大基金资产规模。

### §5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	17,915,825.00	94.68
	其中：股票	17,915,825.00	94.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	823,503.86	4.35

8	其他各项资产	183,969.17	0.97
9	合计	18,923,298.03	100.00

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	14,814,079.00	79.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,578,628.00	13.85
J	金融业	303,618.00	1.63
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	219,500.00	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	17,915,825.00	96.19

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

### 5.2.3 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。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

### 5.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	2,700	1,587,600.00	8.52
2	300760	迈瑞医疗	4,100	1,561,280.00	8.38
3	300014	亿纬锂能	11,900	1,406,342.00	7.55
4	300274	阳光电源	9,400	1,370,520.00	7.36
5	300124	汇川技术	16,600	1,138,760.00	6.11
6	300122	智飞生物	7,600	946,960.00	5.08
7	300142	沃森生物	16,500	927,300.00	4.98
8	300782	卓胜微	2,200	718,960.00	3.86
9	300408	三环集团	11,600	517,360.00	2.78
10	300454	深信服	2,500	477,500.00	2.56

### 5.3.2 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前五名股票投资明细

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

## 5.5 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债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

## **5.7 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。

## **5.8 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权证投资明细**

本报告期末本基金未持有权证。

## **5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

### **5.9.1 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。

### **5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策**

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。

## **5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

### **5.10.1 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。

### **5.10.2 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。

### **5.10.3 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。

## **5.11 投资组合报告附注**

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

5.11.2 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。

### **5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	183,779.54
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	189.63
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	183,969.17

#### 5.11.4 报告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。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 5.11.5.1 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。

##### 5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票，不存在积极投资前五名股票流通受限情况。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

本报告期期初基金份额总额	249,280,565.00
报告期期间基金总申购份额	13,000,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	244,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	18,280,565.00



## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安创业板科技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

### 8.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

### 8.3 查阅方式

网址：[www.cpicfunds.com](http://www.cpicfunds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇二二年一月二十四日