

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
2023 年中期报告
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
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	14
5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
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	56
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	56
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59

8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
9 开放式基金份额变动.....	60
10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	63
11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安沪深 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	国联安沪深 300ETF
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	177,094,165.00 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

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	1、股票投资策略 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。 2、债券投资策略 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。 3、资产支持证券投资策略 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。 4、可转换债券和可交换债券投资策略 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。 5、金融衍生品投资策略 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。 6、融资及转融通证券出借业务投资策略

	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。
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 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 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 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、上交所网站
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-40,718,513.19
本期利润	60,392,154.43
加权平均基金份额本期利润	0.1917
本期加权平均净值利润率	4.18%
本期基金份额净值增长率	0.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	98,501,466.73
期末可供分配基金份额利润	0.5562
期末基金资产净值	784,172,687.70
期末基金份额净值	4.4280
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	14.37%

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

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

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

3.2 基金净值表现

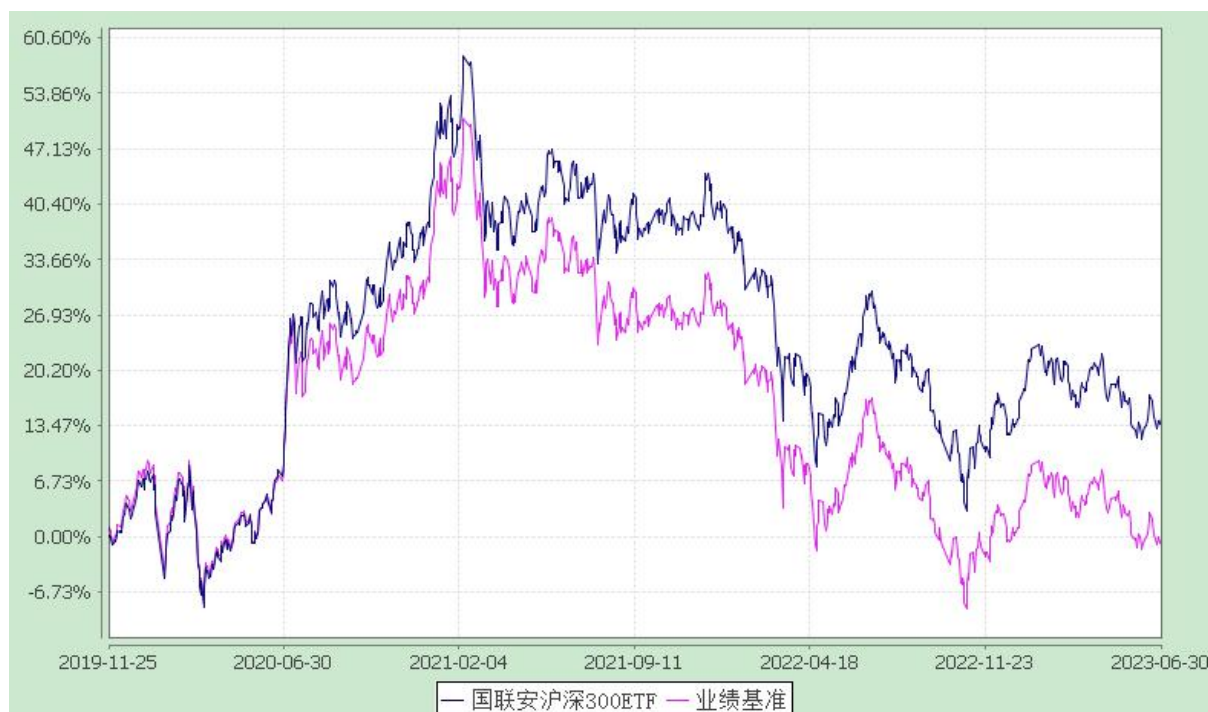
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	2.20%	0.85%	1.16%	0.87%	1.04%	-0.02%
过去三个月	-3.89%	0.82%	-5.15%	0.83%	1.26%	-0.01%
过去六个月	0.56%	0.83%	-0.75%	0.84%	1.31%	-0.01%
过去一年	-11.63%	0.97%	-14.33%	0.99%	2.70%	-0.02%
过去三年	5.12%	1.17%	-7.72%	1.20%	12.84%	-0.03%
自基金合同生效起至今	14.37%	1.21%	-0.20%	1.23%	14.57%	-0.02%

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 2023 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	2019-11-25	-	21 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、债券投资助理、基金经理助理、基金经理、量化投资部总监助理等职。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 指数证券投资基金的基金经理；2016 年 8 月至 2023 年 1 月兼任国联安中小企业综合指数证券投资基金（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

	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、国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。				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；2022 年 5 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联接基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
章榭元	本基金基金经理、兼任国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放	2020-05-06	-	15 年（自 2008 年起）	章榭元先生，硕士研究生。曾任建信基金管理有限公司任研究员，富国基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，融通基金管理有限公司专户投资经理、基金经理、指数与量化投资部总经理。2019 年 5 月加入国联安基金管理有限公司，担任量化投资部总经理。2020 年 5 月起担任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2020 年 8 月起兼任国联安

	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、国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理、国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证消			沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 5 月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 11 月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月起兼任国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	---	--	--	--

	费 50 交易型 开放式指数证 券投资基金基 金经理、量化 投资部总经 理。				
沈晔	本基金基金经 理助理。	2021-04-2 7	-	5 年（自 2018 年起）	-

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

年初，A 股市场出现了一波上扬，但根据此后的宏观数据来看，人民币兑美元汇率跌破 7，国内制造业 PMI 跌至 48.8%，再度不及预期，在之前的低基数基础上进一步小幅下滑。经济复苏不及预期加上人民币贬值，A 股市场在宏观经济数据不理想的影响之下也出现了一波下调，包括外资在内的一些资金出现流出的迹象。

2023 年上半年，A 股市场整体震荡下行。依据基金合同的约定，本基金始终保持较合理的仓位，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 4.4280 元，本报告期份额净值增长率为 0.56%，同期业绩比较基准收益率为-0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

俄乌冲突仍在胶着之中，后续全球政治经济局势依旧存在较大的不确定性，短期内投资依然需要注重风险控制。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值委员会，对估值业务总体负责。估值委员会由公司营运总监/副总监（主席/副主席）、运营部、权益投资部、现金管理部、固定收益部、专户投资部、交易部、量化投资部、研究部、监察稽核部和风险管理部部门负责人组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值委员会成员 1/2 以上多数票通过，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，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，本基金的管理人——国联安基金管理有限公司在本基金的投资运作、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，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国联安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	14,812,554.61	28,329,645.90
结算备付金		1,500,100.19	39,489.60
存出保证金		150,916.48	191,593.35
交易性金融资产	6.4.7.2	768,366,424.21	2,091,856,599.51
其中：股票投资		768,366,424.21	2,091,856,599.51
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		296,932.61	219,607.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		785,126,928.10	2,120,636,935.75
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		193,445.30	547,893.16
应付托管费		32,240.89	91,315.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.49

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	728,554.21	666,416.89
负债合计		954,240.40	1,305,626.09
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	685,671,220.97	1,863,469,401.78
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	98,501,466.73	255,861,907.88
净资产合计		784,172,687.70	2,119,331,309.66
负债和净资产总计		785,126,928.10	2,120,636,935.75

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.4280 元，基金份额总额 177,094,165.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		63,259,909.82	-56,313,269.78
1.利息收入		36,973.63	30,030.15
其中：存款利息收入	6.4.7.9	36,973.63	26,452.04
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	3,578.11
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-38,390,019.61	5,947,716.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-47,730,723.60	327,822.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	274,242.07
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益		9,340,703.99	5,345,651.25
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	101,110,667.62	-63,036,455.09
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	502,288.18	745,438.87
减：二、营业总支出		2,867,755.39	1,183,247.78
1. 管理人报酬		2,181,693.99	856,571.28
2. 托管费		363,615.63	142,761.91
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	13.00
8. 其他费用	6.4.7.16	322,445.77	183,901.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,392,154.43	-57,496,517.56
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,392,154.43	-57,496,517.56
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		60,392,154.43	-57,496,517.56

6.3 净资产（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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,863,469,401.78	-	255,861,907.88	2,119,331,309.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,863,469,401.78	-	255,861,907.88	2,119,331,309.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,177,798,180.81	-	-157,360,441.15	-1,335,158,621.96
（一）、综合收益总额	-	-	60,392,154.43	60,392,154.43
（二）、本期基金份额交易产生的	-1,177,798,180.81	-	-217,752,595.58	-1,395,550,776.39

基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)				
其中: 1.基金申购 款	-	-	-	-
2.基金赎回 款	-1,177,798,180.81	-	-217,752,595.58	-1,395,550,77 6.39
(三)、本期向基 金份额持有人分 配利润产生的基 金净值变动(净值 减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合 收益结转留存收 益	-	-	-	-
四、本期期末净资 产(基金净值)	685,671,220.97	-	98,501,466.73	784,172,687.7 0
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资 产(基金净值)	494,017,670.35	-	199,282,756.51	693,300,426.8 6
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资 产(基金净值)	494,017,670.35	-	199,282,756.51	693,300,426.8 6
三、本期增减变动 额(减少以“-” 号填列)	24,392,270.13	-	-46,802,783.61	-22,410,513.4 8
(一)、综合收益 总额	-	-	-57,496,517.56	-57,496,517.5 6
(二)、本期基金 份额交易产生的 基金净值变动数 (净值减少以“-” 号填列)	24,392,270.13	-	10,693,733.95	35,086,004.08
其中: 1.基金申购 款	219,530,430.12	-	62,829,823.28	282,360,253.4 0
2.基金赎回 款	-195,138,159.99	-	-52,136,089.33	-247,274,249. 32
(三)、本期向基 金份额持有人分	-	-	-	-

配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）				
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	518,409,940.48	-	152,479,972.90	670,889,913.38

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”),系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]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》的核准,由基金管理人国联安基金管理有限公司向社会公开发行募集,基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效,首次设立募集规模为 500,986,890.00 份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。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,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金的投资范围主要为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、中期票据等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的

规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，

暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,812,554.61
等于：本金	14,811,327.05
加：应计利息	1,227.56
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	14,812,554.61

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		828,382,797.43	-	768,366,424.21	-60,016,373.22
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所		-		
	市场	-		-	-
	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		828,382,797.43	-	768,366,424.21	-60,016,373.22

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 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	316,246.44
其中：交易所市场	316,246.44
银行间市场	-
应付利息	-
应付指数使用费	218,169.42
预提审计费	134,630.98
预提信息披露费	59,507.37
合计	728,554.21

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	481,294,165.00	1,863,469,401.78
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-304,200,000.00	-1,177,798,180.81
本期末	177,094,165.00	685,671,220.97

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	949,722,905.74	-693,860,997.86	255,861,907.88
本期利润	-40,718,513.19	101,110,667.62	60,392,154.43
本期基金份额交易产生的变动数	-585,869,696.35	368,117,100.77	-217,752,595.58
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-585,869,696.35	368,117,100.77	-217,752,595.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	323,134,696.20	-224,633,229.47	98,501,466.73

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,790.34
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	8,968.60
其他	1,214.69
合计	36,973.63

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-47,425,913.86
股票投资收益——赎回差价收入	-304,809.74
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	-47,730,723.60

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	686,317,100.74
减：卖出股票成本总额	732,297,116.89
减：交易费用	1,445,897.71
买卖股票差价收入	-47,425,913.86

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,395,550,776.39
减：现金支付赎回款总额	620,218,250.39
减：赎回股票成本总额	775,637,335.74
减：交易费用	-
赎回差价收入	-304,809.74

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内本基金无债券买卖差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	9,340,703.99
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,340,703.99

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	101,110,667.62
——股票投资	101,110,667.62
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-

减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	101,110,667.62

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	502,288.18
合计	502,288.18

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	218,169.42
银行汇划费用	138.00
合计	322,445.77

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	基金托管人
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

安联集团	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
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

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,181,693.99	856,571.28
其中：支付销售机构的客户维护费	982.57	531.05

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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	363,615.63	142,761.91

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

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方进行转融通出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期内及上年度可比期间，本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	214,798.00	0.12%	20,881,898.00	4.34%
国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	171,239,300.00	96.69%	453,739,300.00	94.27%

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	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	14,812,554.61	26,790.34	20,076,486.93	22,786.42

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 2023 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 1,500,100.19 元。（2022 年 06 月 30 日：人民币 83,693.87 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

本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金托管人发行的股票工商银行（601398.SH）和基金管理人的最终控制人发行的股票太保集团（601601.SH）。

6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股锁定	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-

001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股锁定	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股锁定	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股锁定	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内 (含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月	新股锁定	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股锁定	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内 (含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新股锁定	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股锁定	44.18	25.10	241	10,647.38	6,049.10	-
301281	科源制药	2023-05-26	1-6 个月 (含)	新股锁定	-	25.10	96	0.00	2,409.60	-
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内 (含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股锁定	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新股锁定	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新股锁定	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股锁定	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-

301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股锁定	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股锁定	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6 个月	新股锁定	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新股锁定	131.11	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023-05-25	1-6 个月 (含)	新股锁定	-	53.24	131	0.00	6,974.44	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股锁定	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新股锁定	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股锁定	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股锁定	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股锁定	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股锁定	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新股锁定	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新股锁定	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股锁定	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	新股锁定	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股锁定	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股锁定	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股锁定	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新股锁定	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股锁定	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股锁定	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
30140	华人	2023-0	6 个月	新股	16.24	16.95	879	14,274	14,899	-

8	健康	2-22		锁定				.96	.05	
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	新股锁定	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股锁定	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新股锁定	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股锁定	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内 (含)	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内 (含)	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股未上市并锁定	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股锁定	6.58	7.58	3,642	23,964.36	27,606.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股锁定	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股锁定	19.86	18.06	6,282	124,760.52	113,452.92	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股锁定	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	硕中科技	2023-04-11	6 个月	新股锁定	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股锁定	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
68842	时创	2023-0	6 个月	新股	19.20	25.53	346	6,643.	8,833.	-

9	能源	6-20		锁定				20	38	
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股锁定	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股锁定	37.88	29.49	1,422	53,865.36	41,934.78	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新股锁定	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新股锁定	5.69	5.41	11,268	64,114.92	60,959.88	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股锁定	11.10	17.04	2,887	32,045.70	49,194.48	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股锁定	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股锁定	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新股锁定	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股锁定	245.56	122.11	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6 个月 (含)	新股锁定	-	122.11	72	0.00	8,791.92	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股锁定	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股锁定	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股锁定	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新股锁定	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股锁定	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股锁定	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股锁定	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新股锁定	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股锁定	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股锁定	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股锁定	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-

688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内 (含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股锁定	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新股锁定	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股锁定	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股锁定	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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

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

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

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 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 2023 年 6 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

本报告期末本基金没有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险控制的组织体系分为三个层次：第一层次为董事会及督察长；第二层次为总经理、风险控制委员会、风险管理部及监察稽核部；第三层次为公司各业务相关部门对各自部门的风险控制。

风险管理的工作目标是通过建立并运用有效的策略、流程、方法和工具，识别和度量公司经营中所承受的投资风险、运作风险、信用风险等各类风险，向公司决策和管理层提供及时充分的风险报告，确保公司能对相关风险采取有效的防范控制和妥善的管理。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金管理人建立了存入银行合格名单，通过对存款行的信用评估来控制银行存款信用风险。本基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券、同业存单

和资产支持证券合计占基金资产净值的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定

质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券等固定收益类资产等。本基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 个月以 内	1-3 个月	3 个月 -1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	14,812,554.61	-	-	-	-	-	14,812,554.61
结算备付金	1,500,100.19	-	-	-	-	-	1,500,100.19
存出保证金	150,916.48	-	-	-	-	-	150,916.48
交易性金融资产	-	-	-	-	-	768,366,424.21	768,366,424.21
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	296,932.61	296,932.61
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购	-	-	-	-	-	-	-

款							
资产总计	16,463,571.28	-	-	-	-	768,663,356.82	785,126,928.10
负债							
其他负债	-	-	-	-	-	728,554.21	728,554.21
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	193,445.30	193,445.30
应付托管费	-	-	-	-	-	32,240.89	32,240.89
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	954,240.40	954,240.40
利率敏感度缺口	16,463,571.28	-	-	-	-	767,709,116.42	784,172,687.70
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
银行存款	28,329,645.90	-	-	-	-	-	28,329,645.90
结算备付金	39,489.60	-	-	-	-	-	39,489.60
存出保证金	191,593.35	-	-	-	-	-	191,593.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,091,856,599.51	2,091,856,599.51
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	219,607.39	219,607.39
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	28,560,728.85	-	-	-	-	2,092,076,206.90	2,120,636,935.75
负债							
其他负债	-	-	-	-	-	666,416.89	666,416.89
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	547,893.16	547,893.16
应付托管费	-	-	-	-	-	91,315.55	91,315.55
应交税费	-	-	-	-	-	0.49	0.49
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	1,305,626.09	1,305,626.09
利率敏感度缺口	28,560,728.85	-	-	-	-	2,090,770,580.81	2,119,331,309.66

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的债券、同业存单和资产支持证券公允价值占基金资产净值的比例为 0.00% (2022 年 12 月 31 日：0.00%)，市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响，因而未进行敏感性分析(2022 年 12 月 31 日：同)。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	768,366,424.21	97.98	2,091,856,599.51	98.70

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	768,366,424.21	97.98	2,091,856,599.51	98.70

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影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 38,624,320.57	增加 103,697,555.28
	业绩比较基准下降 5%	减少 38,624,320.57	减少 103,697,555.28

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	766,073,345.55	2,090,209,179.67
第二层次	716,382.54	
第三层次	1,576,696.12	1,647,419.84
合计	768,366,424.21	2,091,856,599.51

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告**7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	768,366,424.21	97.87
	其中：股票	768,366,424.21	97.87
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	16,312,654.80	2.08

8	其他各项资产	447,849.09	0.06
9	合计	785,126,928.10	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 7.2 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，本基金未通过转融通证券出借业务出借证券；

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 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,581,275.15	1.09
B	采矿业	29,874,301.20	3.81
C	制造业	432,628,235.06	55.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,874,402.00	2.92
E	建筑业	18,183,206.95	2.32
F	批发和零售业	2,549,935.67	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	23,889,263.60	3.05
H	住宿和餐饮业	783,290.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,105,186.14	4.86
J	金融业	157,016,936.58	20.02
K	房地产业	11,490,554.36	1.47
L	租赁和商务服务业	7,158,780.29	0.91
M	科学研究和技术服务业	7,482,688.20	0.95
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	4,392,458.70	0.56
R	文化、体育和娱乐业	1,039,984.00	0.13
S	综合	-	-
	合计	766,050,497.90	97.69

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,985,494.24	0.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	81,093.33	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	119,783.56	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	37,242.13	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-

	合计	2,315,926.31	0.30
--	----	--------------	------

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	25,500	43,120,500.00	5.50
2	300750	宁德时代	106,380	24,338,680.20	3.10
3	601318	中国平安	439,500	20,392,800.00	2.60
4	600036	招商银行	502,200	16,452,072.00	2.10
5	000858	五粮液	78,700	12,872,959.00	1.64
6	000333	美的集团	199,244	11,739,456.48	1.50
7	600276	恒瑞医药	211,201	10,116,527.90	1.29
8	002594	比亚迪	36,800	9,504,336.00	1.21
9	601166	兴业银行	590,000	9,233,500.00	1.18
10	600900	长江电力	397,100	8,760,026.00	1.12
11	600030	中信证券	395,985	7,832,583.30	1.00
12	601899	紫金矿业	668,300	7,598,571.00	0.97
13	300059	东方财富	514,673	7,308,356.60	0.93
14	601012	隆基绿能	246,029	7,053,651.43	0.90
15	600887	伊利股份	249,000	7,051,680.00	0.90
16	601398	工商银行	1,422,000	6,854,040.00	0.87
17	600309	万华化学	76,400	6,710,976.00	0.86
18	000651	格力电器	182,782	6,673,370.82	0.85
19	002475	立讯精密	202,507	6,571,352.15	0.84
20	601328	交通银行	1,114,700	6,465,260.00	0.82
21	002415	海康威视	189,990	6,290,568.90	0.80
22	000568	泸州老窖	29,897	6,265,514.29	0.80
23	000725	京东方 A	1,521,100	6,221,299.00	0.79
24	000063	中兴通讯	129,300	5,888,322.00	0.75
25	300760	迈瑞医疗	19,634	5,886,273.20	0.75
26	601816	京沪高铁	996,200	5,240,012.00	0.67
27	603259	药明康德	83,220	5,185,438.20	0.66
28	002230	科大讯飞	75,123	5,105,359.08	0.65
29	300274	阳光电源	42,200	4,921,786.00	0.63

30	600028	中国石化	771,800	4,908,648.00	0.63
31	601668	中国建筑	850,700	4,883,018.00	0.62
32	300124	汇川技术	75,561	4,851,771.81	0.62
33	002714	牧原股份	110,960	4,676,964.00	0.60
34	601288	农业银行	1,295,200	4,572,056.00	0.58
35	002352	顺丰控股	99,200	4,472,928.00	0.57
36	000001	平安银行	393,700	4,421,251.00	0.56
37	601888	中国中免	39,593	4,376,214.29	0.56
38	002129	TCL 中环	131,165	4,354,678.00	0.56
39	000792	盐湖股份	220,400	4,225,068.00	0.54
40	601088	中国神华	133,800	4,114,350.00	0.52
41	002142	宁波银行	160,704	4,065,811.20	0.52
42	601138	工业富联	161,200	4,062,240.00	0.52
43	688981	中芯国际	79,400	4,011,288.00	0.51
44	600031	三一重工	241,000	4,007,830.00	0.51
45	300498	温氏股份	212,769	3,904,311.15	0.50
46	000002	万 科 A	276,138	3,871,454.76	0.49
47	600048	保利发展	291,400	3,796,942.00	0.48
48	600016	民生银行	1,007,100	3,776,625.00	0.48
49	600406	国电南瑞	162,965	3,764,491.50	0.48
50	600438	通威股份	109,600	3,760,376.00	0.48
51	600050	中国联通	774,200	3,716,160.00	0.47
52	600809	山西汾酒	19,780	3,660,684.60	0.47
53	600837	海通证券	391,700	3,611,474.00	0.46
54	601601	中国太保	138,900	3,608,622.00	0.46
55	600690	海尔智家	153,600	3,606,528.00	0.46
56	601728	中国电信	629,900	3,546,337.00	0.45
57	688111	金山办公	7,500	3,541,650.00	0.45
58	600919	江苏银行	479,350	3,523,222.50	0.45
59	600089	特变电工	157,800	3,517,362.00	0.45
60	300015	爱尔眼科	189,274	3,511,032.70	0.45
61	600436	片仔癀	12,243	3,505,905.48	0.45
62	600000	浦发银行	476,352	3,448,788.48	0.44
63	601857	中国石油	459,900	3,435,453.00	0.44
64	600941	中国移动	36,634	3,417,952.20	0.44
65	002371	北方华创	10,700	3,398,855.00	0.43
66	601988	中国银行	855,100	3,343,441.00	0.43
67	603501	韦尔股份	33,630	3,297,085.20	0.42
68	002304	洋河股份	24,500	3,218,075.00	0.41
69	601766	中国中车	493,500	3,207,750.00	0.41
70	603288	海天味业	67,656	3,169,683.60	0.40
71	601390	中国中铁	416,800	3,159,344.00	0.40
72	600905	三峡能源	580,700	3,118,359.00	0.40
73	300014	亿纬锂能	49,800	3,012,900.00	0.38

74	600150	中国船舶	90,700	2,984,937.00	0.38
75	000938	紫光股份	92,820	2,956,317.00	0.38
76	002466	天齐锂业	41,900	2,929,229.00	0.37
77	601688	华泰证券	208,900	2,876,553.00	0.37
78	603986	兆易创新	27,064	2,875,550.00	0.37
79	601225	陕西煤业	157,300	2,861,287.00	0.36
80	002460	赣锋锂业	45,820	2,793,187.20	0.36
81	002459	晶澳科技	66,912	2,790,230.40	0.36
82	002027	分众传媒	408,600	2,782,566.00	0.35
83	601169	北京银行	600,500	2,780,315.00	0.35
84	688012	中微公司	17,650	2,761,342.50	0.35
85	000338	潍柴动力	220,202	2,743,716.92	0.35
86	600570	恒生电子	61,645	2,730,257.05	0.35
87	601985	中国核电	382,800	2,698,740.00	0.34
88	600104	上汽集团	189,600	2,686,632.00	0.34
89	002050	三花智控	87,416	2,645,208.16	0.34
90	000625	长安汽车	201,534	2,605,834.62	0.33
91	002049	紫光国微	27,580	2,571,835.00	0.33
92	601211	国泰君安	182,900	2,558,771.00	0.33
93	600111	北方稀土	102,700	2,462,746.00	0.31
94	601919	中远海控	258,430	2,429,242.00	0.31
95	603019	中科曙光	47,520	2,418,768.00	0.31
96	000100	TCL 科技	609,530	2,401,548.20	0.31
97	603799	华友钴业	51,883	2,381,948.53	0.30
98	601628	中国人寿	67,600	2,363,296.00	0.30
99	002179	中航光电	51,652	2,342,418.20	0.30
100	600660	福耀玻璃	65,000	2,330,250.00	0.30
101	601229	上海银行	403,462	2,319,906.50	0.30
102	600585	海螺水泥	97,400	2,312,276.00	0.29
103	601818	光大银行	753,100	2,312,017.00	0.29
104	600009	上海机场	50,500	2,293,710.00	0.29
105	600893	航发动力	54,100	2,286,266.00	0.29
106	601989	中国重工	462,600	2,229,732.00	0.28
107	002271	东方雨虹	81,750	2,228,505.00	0.28
108	601658	邮储银行	450,400	2,202,456.00	0.28
109	002555	三七互娱	63,000	2,197,440.00	0.28
110	300122	智飞生物	48,750	2,154,750.00	0.27
111	002812	恩捷股份	21,700	2,090,795.00	0.27
112	600958	东方证券	212,096	2,057,331.20	0.26
113	600999	招商证券	150,540	2,042,827.80	0.26
114	600019	宝钢股份	361,300	2,030,506.00	0.26
115	000977	浪潮信息	41,800	2,027,300.00	0.26
116	600760	中航沈飞	44,744	2,013,480.00	0.26
117	300896	爱美客	4,400	1,957,780.00	0.25

118	002709	天赐材料	46,900	1,931,811.00	0.25
119	688036	传音控股	13,043	1,917,321.00	0.24
120	688599	天合光能	44,203	1,883,489.83	0.24
121	300316	晶盛机电	26,500	1,878,850.00	0.24
122	688008	澜起科技	32,400	1,860,408.00	0.24
123	600426	华鲁恒升	60,300	1,846,989.00	0.24
124	601186	中国铁建	186,700	1,838,995.00	0.23
125	601360	三六零	144,900	1,817,046.00	0.23
126	600584	长电科技	57,800	1,801,626.00	0.23
127	601006	大秦铁路	241,300	1,792,859.00	0.23
128	000661	长春高新	13,100	1,785,530.00	0.23
129	000776	广发证券	120,100	1,766,671.00	0.23
130	601600	中国铝业	321,700	1,766,133.00	0.23
131	002920	德赛西威	11,300	1,760,653.00	0.22
132	002410	广联达	54,044	1,755,889.56	0.22
133	600745	闻泰科技	35,300	1,726,170.00	0.22
134	300142	沃森生物	65,200	1,724,540.00	0.22
135	002241	歌尔股份	97,100	1,723,525.00	0.22
136	600547	山东黄金	73,340	1,722,023.20	0.22
137	601377	兴业证券	280,340	1,715,680.80	0.22
138	600588	用友网络	83,594	1,713,677.00	0.22
139	601939	建设银行	272,500	1,705,850.00	0.22
140	000166	申万宏源	365,700	1,689,534.00	0.22
141	601009	南京银行	209,800	1,678,400.00	0.21
142	600011	华能国际	178,500	1,652,910.00	0.21
143	600010	宝钢股份	921,100	1,648,769.00	0.21
144	001979	招商蛇口	125,620	1,636,828.60	0.21
145	000596	古井贡酒	6,600	1,632,708.00	0.21
146	300450	先导智能	44,500	1,609,565.00	0.21
147	601669	中国电建	279,500	1,604,330.00	0.20
148	600085	同仁堂	27,800	1,600,168.00	0.20
149	300408	三环集团	54,439	1,597,784.65	0.20
150	600196	复星医药	51,600	1,594,440.00	0.20
151	002311	海大集团	33,700	1,578,508.00	0.20
152	601800	中国交建	144,200	1,573,222.00	0.20
153	603659	璞泰来	40,930	1,564,344.60	0.20
154	000963	华东医药	35,491	1,539,244.67	0.20
155	000538	云南白药	29,180	1,531,366.40	0.20
156	600886	国投电力	121,000	1,530,650.00	0.20
157	603993	洛阳钼业	286,700	1,528,111.00	0.19
158	300033	同花顺	8,700	1,524,936.00	0.19
159	000768	中航西飞	56,400	1,508,700.00	0.19
160	600600	青岛啤酒	14,400	1,492,272.00	0.19
161	600845	宝信软件	29,225	1,484,922.25	0.19

162	300782	卓胜微	15,140	1,462,978.20	0.19
163	601689	拓普集团	17,900	1,444,530.00	0.18
164	002493	荣盛石化	123,200	1,434,048.00	0.18
165	000733	振华科技	14,800	1,418,580.00	0.18
166	600926	杭州银行	120,300	1,413,525.00	0.18
167	601100	恒立液压	21,732	1,398,019.56	0.18
168	600015	华夏银行	258,300	1,397,403.00	0.18
169	600795	国电电力	361,800	1,385,694.00	0.18
170	600176	中国巨石	97,404	1,379,240.64	0.18
171	002180	纳思达	40,200	1,376,850.00	0.18
172	300347	泰格医药	21,300	1,374,702.00	0.18
173	600732	爱旭股份	44,520	1,368,990.00	0.17
174	600674	川投能源	90,500	1,362,025.00	0.17
175	000157	中联重科	201,500	1,360,125.00	0.17
176	002236	大华股份	67,500	1,333,125.00	0.17
177	603369	今世缘	25,100	1,325,280.00	0.17
178	600115	中国东航	277,700	1,321,852.00	0.17
179	600029	南方航空	218,700	1,318,761.00	0.17
180	000425	徐工机械	191,800	1,298,486.00	0.17
181	601066	中信建投	52,700	1,275,340.00	0.16
182	000301	东方盛虹	107,300	1,268,286.00	0.16
183	601995	中金公司	35,600	1,264,512.00	0.16
184	601633	长城汽车	50,100	1,261,017.00	0.16
185	601788	光大证券	79,300	1,260,077.00	0.16
186	300496	中科创达	13,000	1,252,550.00	0.16
187	601336	新华保险	33,800	1,242,826.00	0.16
188	601868	中国能建	526,300	1,231,542.00	0.16
189	601117	中国化学	148,700	1,231,236.00	0.16
190	600346	恒力石化	85,700	1,228,081.00	0.16
191	601877	正泰电器	43,600	1,205,540.00	0.15
192	002074	国轩高科	43,300	1,195,946.00	0.15
193	002202	金风科技	111,989	1,189,323.18	0.15
194	600741	华域汽车	64,000	1,181,440.00	0.15
195	601111	中国国航	141,700	1,167,608.00	0.15
196	688126	沪硅产业	55,500	1,159,950.00	0.15
197	002001	新 和 成	75,224	1,158,449.60	0.15
198	601618	中国中冶	289,700	1,150,109.00	0.15
199	002821	凯莱英	9,740	1,147,956.40	0.15
200	300454	深信服	10,100	1,143,825.00	0.15
201	002841	视源股份	17,075	1,141,293.00	0.15
202	688223	晶科能源	81,100	1,140,266.00	0.15
203	600989	宝丰能源	89,300	1,126,073.00	0.14
204	603806	福斯特	30,216	1,123,733.04	0.14
205	688396	华润微	21,396	1,121,364.36	0.14

206	600188	兖矿能源	37,300	1,116,016.00	0.14
207	601838	成都银行	90,900	1,109,889.00	0.14
208	601901	方正证券	167,000	1,092,180.00	0.14
209	300661	圣邦股份	13,260	1,089,043.80	0.14
210	601615	明阳智能	64,500	1,088,760.00	0.14
211	000876	新 希 望	92,080	1,075,494.40	0.14
212	688303	大全能源	26,050	1,053,722.50	0.13
213	605117	德业股份	6,993	1,045,803.15	0.13
214	600460	士兰微	34,500	1,044,315.00	0.13
215	600039	四川路桥	106,120	1,041,037.20	0.13
216	300413	芒果超媒	30,400	1,039,984.00	0.13
217	000895	双汇发展	42,200	1,033,478.00	0.13
218	603392	万泰生物	15,409	1,028,858.93	0.13
219	002648	卫星化学	68,300	1,021,768.00	0.13
220	002736	国信证券	117,000	1,021,410.00	0.13
221	600233	圆通速递	69,800	1,016,288.00	0.13
222	601607	上海医药	45,100	1,010,691.00	0.13
223	603260	合盛硅业	14,400	1,008,288.00	0.13
224	000786	北新建材	41,100	1,007,361.00	0.13
225	300769	德方纳米	9,080	1,000,888.40	0.13
226	002007	华兰生物	44,430	995,676.30	0.13
227	003816	中国广核	319,200	992,712.00	0.13
228	300207	欣旺达	60,400	985,728.00	0.13
229	300999	金龙鱼	24,200	967,758.00	0.12
230	002601	龙佰集团	58,200	960,300.00	0.12
231	300751	迈为股份	5,620	951,915.60	0.12
232	300433	蓝思科技	80,700	949,032.00	0.12
233	601238	广汽集团	89,900	936,758.00	0.12
234	600383	金地集团	128,200	924,322.00	0.12
235	300759	康龙化成	24,100	922,548.00	0.12
236	601021	春秋航空	15,900	913,773.00	0.12
237	600332	白云山	28,500	908,580.00	0.12
238	600132	重庆啤酒	9,800	903,168.00	0.12
239	600763	通策医疗	9,100	881,426.00	0.11
240	300223	北京君正	9,800	865,438.00	0.11
241	600219	南山铝业	285,000	860,700.00	0.11
242	600875	东方电气	45,100	841,115.00	0.11
243	000983	山西焦煤	92,100	838,110.00	0.11
244	300763	锦浪科技	8,000	832,800.00	0.11
245	002756	永兴材料	13,100	820,191.00	0.10
246	600362	江西铜业	42,100	799,058.00	0.10
247	601865	福莱特	20,700	797,157.00	0.10
248	000723	美锦能源	105,300	793,962.00	0.10
249	601699	潞安环能	48,500	791,520.00	0.10

250	600754	锦江酒店	18,500	783,290.00	0.10
251	600918	中泰证券	113,100	781,521.00	0.10
252	601878	浙商证券	78,700	777,556.00	0.10
253	601872	招商轮船	131,900	763,701.00	0.10
254	601319	中国人保	129,600	756,864.00	0.10
255	603290	斯达半导	3,500	753,200.00	0.10
256	601998	中信银行	124,300	743,314.00	0.09
257	600061	国投资本	104,260	742,331.20	0.09
258	000617	中油资本	102,600	741,798.00	0.09
259	000069	华侨城 A	166,400	732,160.00	0.09
260	000408	藏格矿业	32,100	724,497.00	0.09
261	603486	科沃斯	9,300	723,261.00	0.09
262	300628	亿联网络	20,480	718,233.60	0.09
263	601799	星宇股份	5,800	716,880.00	0.09
264	600803	新奥股份	37,700	715,546.00	0.09
265	603833	欧派家居	7,460	714,668.00	0.09
266	688363	华熙生物	7,800	695,448.00	0.09
267	600884	杉杉股份	45,900	694,926.00	0.09
268	688005	容百科技	12,850	694,157.00	0.09
269	300601	康泰生物	27,160	689,592.40	0.09
270	600183	生益科技	47,500	674,500.00	0.09
271	603899	晨光股份	15,000	669,600.00	0.09
272	002938	鹏鼎控股	27,400	665,546.00	0.08
273	300919	中伟股份	10,800	650,700.00	0.08
274	000708	中信特钢	41,000	649,440.00	0.08
275	002916	深南电路	8,340	628,585.80	0.08
276	601898	中煤能源	74,300	627,092.00	0.08
277	603185	弘元绿能	8,300	618,765.00	0.08
278	601881	中国银河	52,300	607,203.00	0.08
279	600018	上港集团	113,400	595,350.00	0.08
280	688561	奇安信	11,150	577,681.50	0.07
281	000877	天山股份	70,300	572,242.00	0.07
282	002120	韵达股份	58,910	563,179.60	0.07
283	601216	君正集团	136,900	561,290.00	0.07
284	002064	华峰化学	80,500	552,230.00	0.07
285	002414	高德红外	69,305	538,499.85	0.07
286	601155	新城控股	36,700	528,847.00	0.07
287	600025	华能水电	73,000	520,490.00	0.07
288	600606	绿地控股	171,045	470,373.75	0.06
289	300957	贝泰妮	5,200	462,176.00	0.06
290	603195	公牛集团	4,689	450,425.34	0.06
291	688065	凯赛生物	7,157	445,594.82	0.06
292	688187	时代电气	10,622	444,636.92	0.06
293	601698	中国卫通	17,100	339,948.00	0.04

294	601808	中海油服	24,000	333,120.00	0.04
295	000800	一汽解放	37,700	315,549.00	0.04
296	605499	东鹏饮料	1,800	311,220.00	0.04
297	300979	华利集团	6,200	302,188.00	0.04
298	601236	红塔证券	38,220	284,739.00	0.04
299	001289	龙源电力	6,100	137,250.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	301486	致尚科技	4,820.00	277,921.20	0.04
2	301292	海科新源	5,824.00	116,421.76	0.01
3	688249	晶合集成	6,282.00	113,452.92	0.01
4	301488	豪恩汽电	2,618.00	104,144.04	0.01
5	301358	湖南裕能	2,023.00	86,766.47	0.01
6	301202	朗威股份	3,060.00	79,009.20	0.01
7	688603	天承科技	1,391.00	76,505.00	0.01
8	301261	恒工精密	1,973.00	72,803.70	0.01
9	688469	中芯集成	11,268.00	60,959.88	0.01
10	688361	中科飞测	831.00	53,740.77	0.01
11	688472	阿特斯	2,887.00	49,194.48	0.01
12	688531	日联科技	346.00	47,045.62	0.01
13	688443	智翔金泰	1,422.00	41,934.78	0.01
14	301325	曼恩斯特	364.00	39,293.80	0.01
15	688146	中船特气	1,011.00	38,549.43	0.00
16	688484	南芯科技	1,008.00	37,003.68	0.00
17	001286	陕西能源	3,767.00	35,447.47	0.00
18	301301	川宁生物	3,574.00	32,023.04	0.00
19	001287	中电港	1,386.00	29,133.72	0.00
20	688576	西山科技	240.00	28,898.40	0.00
21	688352	颀中科技	2,361.00	28,497.27	0.00
22	601061	中信金属	3,642.00	27,606.36	0.00
23	688507	索辰科技	222.00	27,108.42	0.00
24	688582	芯动联科	648.00	26,360.64	0.00
25	301293	三博脑科	333.00	23,782.86	0.00
26	301303	真兰仪表	1,058.00	23,614.56	0.00
27	301297	富乐德	1,015.00	22,847.65	0.00
28	688552	航天南湖	956.00	22,466.00	0.00
29	688570	天玛智控	884.00	22,391.72	0.00
30	301307	美利信	687.00	21,887.82	0.00
31	688543	国科军工	410.00	21,750.50	0.00
32	301322	绿通科技	392.00	20,870.08	0.00

33	688458	美芯晟	221.00	20,057.96	0.00
34	688581	安杰思	163.00	19,238.89	0.00
35	301317	鑫磊股份	694.00	18,161.98	0.00
36	301262	海看股份	692.00	17,646.00	0.00
37	688478	晶升股份	402.00	17,032.74	0.00
38	688562	航天软件	726.00	16,197.06	0.00
39	301439	泓淋电力	949.00	16,038.10	0.00
40	688623	双元科技	178.00	15,448.62	0.00
41	301332	德尔玛	1,122.00	15,405.06	0.00
42	301399	英特科技	293.00	15,110.01	0.00
43	301408	华人健康	879.00	14,899.05	0.00
44	301305	朗坤环境	753.00	14,826.57	0.00
45	301397	溯联股份	362.00	14,552.40	0.00
46	301419	阿莱德	330.00	14,470.50	0.00
47	688334	西高院	888.00	14,394.48	0.00
48	688593	新相微	959.00	13,991.81	0.00
49	301387	光大同创	307.00	13,925.52	0.00
50	301382	蜂助手	408.00	13,398.72	0.00
51	688433	华曙高科	418.00	13,167.00	0.00
52	688629	华丰科技	708.00	13,161.72	0.00
53	688620	安凯微	1,016.00	12,537.44	0.00
54	301360	荣旗科技	134.00	12,408.40	0.00
55	301345	涛涛车业	266.00	12,406.24	0.00
56	301315	威士顿	226.00	11,553.12	0.00
57	688523	航天环宇	472.00	11,257.20	0.00
58	603135	中重科技	628.00	11,234.92	0.00
59	301141	中科磁业	262.00	11,184.78	0.00
60	301429	森泰股份	499.00	10,488.98	0.00
61	601065	江盐集团	875.00	10,360.00	0.00
62	688631	莱斯信息	336.00	10,036.32	0.00
63	688479	友车科技	332.00	9,790.68	0.00
64	301232	飞沃科技	165.00	9,639.30	0.00
65	301376	致欧科技	420.00	9,454.20	0.00
66	301355	南王科技	563.00	9,430.25	0.00
67	301357	北方长龙	190.00	9,194.10	0.00
68	301386	未来电器	378.00	8,992.62	0.00
69	301323	新莱福	228.00	8,974.08	0.00
70	688429	时创能源	346.00	8,833.38	0.00
71	301373	凌玮科技	277.00	8,822.45	0.00
72	301170	锡南科技	250.00	8,732.50	0.00
73	301281	科源制药	337.00	8,458.70	0.00
74	688535	华海诚科	161.00	8,248.03	0.00
75	601133	柏诚股份	664.00	8,140.64	0.00
76	301157	华塑科技	150.00	7,939.50	0.00

77	301295	美硕科技	215.00	7,755.05	0.00
78	301203	国泰环保	225.00	7,740.00	0.00
79	301337	亚华电子	232.00	7,045.84	0.00
80	301428	世纪恒通	229.00	7,007.40	0.00
81	001380	华纬科技	170.00	5,232.60	0.00
82	603125	常青科技	160.00	3,924.80	0.00
83	001328	登康口腔	145.00	3,696.05	0.00
84	001282	三联锻造	105.00	3,468.15	0.00
85	001360	南矿集团	177.00	2,631.99	0.00
86	603137	恒尚节能	139.00	2,375.51	0.00
87	001324	长青科技	114.00	2,234.40	0.00
88	001367	海森药业	55.00	2,171.40	0.00
89	603172	万丰股份	122.00	1,967.86	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	000568	泸州老窖	3,366,516.00	0.16
2	603501	韦尔股份	1,717,337.95	0.08
3	601818	光大银行	1,545,313.00	0.07
4	600028	中国石化	1,493,957.00	0.07
5	600941	中国移动	1,307,992.00	0.06
6	688249	晶合集成	1,247,426.46	0.06
7	600732	爱旭股份	1,214,355.00	0.06
8	600905	三峡能源	1,208,341.00	0.06
9	601899	紫金矿业	1,205,243.00	0.06
10	300014	亿纬锂能	1,025,303.00	0.05
11	601607	上海医药	1,024,438.00	0.05
12	688223	晶科能源	958,152.09	0.05
13	000983	山西焦煤	926,387.00	0.04
14	600745	闻泰科技	912,612.00	0.04
15	600754	锦江酒店	883,908.00	0.04
16	002594	比亚迪	869,088.00	0.04
17	002179	中航光电	853,195.50	0.04
18	300122	智飞生物	843,677.00	0.04
19	601699	潞安环能	819,587.00	0.04
20	600875	东方电气	805,957.00	0.04

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	300750	宁德时代	43,491,127.20	2.05
2	000858	五 粮 液	26,577,815.00	1.25
3	600519	贵州茅台	19,626,279.40	0.93
4	000333	美的集团	18,676,458.62	0.88
5	002594	比亚迪	17,807,725.90	0.84
6	000568	泸州老窖	15,751,808.00	0.74
7	300059	东方财富	15,562,801.80	0.73
8	002415	海康威视	13,084,285.00	0.62
9	000651	格力电器	12,175,694.00	0.57
10	000725	京东方 A	11,159,251.00	0.53
11	002475	立讯精密	11,016,680.00	0.52
12	300760	迈瑞医疗	10,916,804.40	0.52
13	002714	牧原股份	9,655,693.00	0.46
14	000001	平安银行	9,433,504.00	0.45
15	000792	盐湖股份	9,374,249.00	0.44
16	002352	顺丰控股	9,350,586.00	0.44
17	300124	汇川技术	9,316,118.00	0.44
18	300274	阳光电源	8,517,598.15	0.40
19	300015	爱尔眼科	8,312,451.72	0.39
20	002142	宁波银行	8,130,007.00	0.38

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	83,333,609.71
卖出股票的收入（成交）总额	686,317,100.74

注：不考虑相关交易费用

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，贵州茅台酒股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到南宁市江南区人民法院的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海银保监局、中国银行间市场交易商协会、厦门证监局、银保监会、中国人民银行、湖北银保监局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海银保监局、福建证监局、重庆证监局、湖北银保监局、中国银行间市场交易商协会、厦门证监局、银保监会、中国人民银行大连市中心支行、邳州市公安局的处罚。

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

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

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	150,916.48
2	应收清算款	296,932.61
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	447,849.09

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 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.04	新股待上市
2	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股待上市
3	688249	晶合集成	113,452.92	0.01	新股锁定
4	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.01	新股待上市
4	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股待上市 并锁定
5	301358	湖南裕能	86,766.47	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 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
1,392	127,222.82	172,053,671.00	97.15%	5,040,494.00	2.85%

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	171,239,300.00	96.69%
2	华泰证券股份有限公司	577,673.00	0.33%
3	马凤全	427,693.00	0.24%
4	钟启鸣	297,000.00	0.17%
5	长江养老保险股份有限公司－中国太平洋人寿权益基金型投资产品（保额分红）委托专户	214,798.00	0.12%
6	夏晓静	196,900.00	0.11%
7	韩凌霞	92,200.00	0.05%
8	刘月田	87,100.00	0.05%
9	叶永军	84,900.00	0.05%
10	陈贤忠	73,500.00	0.04%

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	481,294,165.00
本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	304,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	177,094,165.00

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

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
光大证券股份	1	354,590,116.34	47.10%	326,684.61	47.00%	-

有限公司						
招商证券股份有限公司	1	157,661,273.41	20.94%	145,253.16	20.90%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	105,146,265.14	13.97%	97,924.03	14.09%	-
浙商证券股份有限公司	1	96,085,866.09	12.76%	88,524.44	12.74%	-
国信证券股份有限公司	1	38,275,460.61	5.08%	35,646.09	5.13%	-
兴业证券股份有限公司	1	1,161,428.72	0.15%	1,081.64	0.16%	-
平安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中信证券股份有限公司	2	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

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

A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币。

B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。

C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。

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

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

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

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

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

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

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

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

报告期内租用证券公司交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		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
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份	-	-	-	-	-	-

有限公司						
国信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
平安证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中信证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融 股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券 有限公司	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-01-20
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
3	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-03-31
4	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	规定报刊	2023-03-31
5	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 1 季度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-04-22
6	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-22
7	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（2023 年第 1 号）	规定网站、上海证券交易所	2023-05-18

8	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	2023-05-18
9	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加伯嘉基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-05-26

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
联接基金	1	2023年01月01日至2023年6月30日	453,739,300.00	90,000,000.00	372,500,000.00	171,239,300.00	96.69%
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。							

注：申购份额包含本报告期内发生的买入份额；赎回份额包含本报告期内发生的卖出份额。

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.epicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日