

国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金  
2024 年中期报告  
2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 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
1.2	目录	3
2	基金简介	4
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
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	14
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的真实、准确和完整发表意见	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	16
6.3	净资产变动表	17
6.4	报表附注	19
7	投资组合报告	38
7.1	期末基金资产组合情况	38
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	47
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49
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	49
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	49
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	49
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	49
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12	投资组合报告附注	50
8	基金份额持有人信息	51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	51
9 开放式基金份额变动 .....	52
10 重大事件揭示 .....	52
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 其他重大事件 .....	54
11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
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 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	56
12 备查文件目录 .....	56
12.1 备查文件目录 .....	56
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国联安中证 1000 指数增强	
基金主代码	016962	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 12 月 5 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	262,861,385.06 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安中证 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	016962	016963
报告期末下属分级基金的份额总额	111,955,585.44 份	150,905,799.62 份

## 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金以中证 1000 指数为标的指数，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。正常情况下，本基金力争控制净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	方圆
	联系电话	021-38992888	95559
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路 18号
邮政编码		200121	200336
法定代表人		于业明	任德奇

## 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	国联安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
---------------	--------------------------------------

	国联安中证 1000 指数 增强 A	国联安中证 1000 指数增 强 C
本期已实现收益	-9,940,952.18	-13,862,576.69
本期利润	-14,007,579.33	-19,478,147.55
加权平均基金份额本期利润	-0.1240	-0.1257
本期加权平均净值利润率	-14.52%	-14.78%
本期基金份额净值增长率	-13.20%	-13.30%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>	
	国联安中证 1000 指数增 强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
期末可供分配利润	-21,139,655.26	-28,891,377.31
期末可供分配基金份额利润	-0.1888	-0.1915
期末基金资产净值	90,815,930.18	122,014,422.31
期末基金份额净值	0.8112	0.8085
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2024 年 6 月 30 日)</b>	
	国联安中证 1000 指数 增强 A	国联安中证 1000 指数增 强 C
基金份额累计净值增长率	-18.88%	-19.15%

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

国联安中证 1000 指数增强 A

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①—③	②—④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差 ②	准收益率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	-6.55%	1.31%	-8.15%	1.36%	1.60%	-0.05%
过去三个月	-6.14%	1.38%	-9.51%	1.42%	3.37%	-0.04%
过去六个月	-13.20%	1.88%	-15.97%	1.87%	2.77%	0.01%
过去一年	-19.20%	1.46%	-24.61%	1.47%	5.41%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	-18.88%	1.24%	-25.42%	1.28%	6.54%	-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。

### 国联安中证 1000 指数增强 C

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	-6.59%	1.31%	-8.15%	1.36%	1.56%	-0.05%
过去三个月	-6.20%	1.38%	-9.51%	1.42%	3.31%	-0.04%
过去六个月	-13.30%	1.88%	-15.97%	1.87%	2.67%	0.01%
过去一年	-19.36%	1.46%	-24.61%	1.47%	5.25%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生 效起至今	-19.15%	1.24%	-25.42%	1.28%	6.27%	-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

国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022 年 12 月 5 日至 2024 年 6 月 30 日)

国联安中证 1000 指数增强 A





- 注：1、本基金业绩比较基准为中证 1000 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%；
- 2、本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 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。

国联安中证 1000 指数增强 C



- 注：1、本基金业绩比较基准为中证 1000 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%；
- 2、本基金基金合同于 2022 年 12 月 5 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		
章榭元	基金经理、量化投资部总经理	2022-12-05	-	16 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联接基金和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；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；2024 年 1 月起兼任国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。
章野	基金经理 助理	2023-09-28	-	7 年（自 2017 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》、《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金合同》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

2024 年上半年，市场经历了显著的震荡行情。在这一时期，主要市场指数的表现呈现出不同的特点。沪深 300 指数实现了小幅上涨，显示出一定的抗跌性和稳定性，而中证 1000 指数则表现疲弱，反映了市场中小市值公司面临的压力和挑战。

在宏观经济方面，整体呈现稳步复苏态势，但复苏进程中的不确定性因素依然较多。国内经济增长速度虽然有所回升，但受全球经济环境、国内产业结构调整以及政策变化等多重因素影响，复苏步伐相对缓慢。在投资者信心方面，由于市场震荡行情的持续以及宏观经济复苏的不确定性，投资者普遍保持谨慎态度。尽管有部分投资者对经济复苏的前景持乐观预期，但整体而言，市场信心仍然不足。投资者在等待经济数据的进一步回暖以确认复苏的可持续性，同时也密切关注国内外政策变化和市场动态。

报告期内，本基金坚持采用定量的投资方式，通过基本面模型选择合适的资产配置比例和个股配置比例。此外，通过量化的方式精挑细选优质上市公司，以期获得超越市场的超额收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，国联安中证 1000 指数增强 A 的份额净值为 0.8112 元，国联安中证 1000 指数增强 C 的份额净值为 0.8085 元。本报告期内，国联安中证 1000 指数增强 A 的份额净值增长率为-13.20%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%；国联安中证 1000 指数增强 C 的份额净值增长率为-13.30%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年下半年，中国经济预计维持温和复苏态势，下半年增长或优于上半年。出口在全球制造业回暖的带动下，全年有望实现超预期增长，成为经济增长重要驱动力。消费随政策提振和高基数效应减弱，增速有望逐步回升。投资方面，制造业受益于出口提振，基建投资在专项债提速支持下加速，地产市场虽在调整中但政策空间犹存。财政与货币政策将继续协同发力，财政政策仍然有充裕空间，货币政策灵活创新，引导实体经济融资成本下降。市场风险偏好或随经济复苏及政策利好逐步提升，权益市场以结构性行情为主，债券市场面临短期调整但长期仍具配置价值。

#### 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。估值委员会由公司负责营运相关领导（主席）、运营部、权益投资部、现金管理部、固定收益部、专户投资部、交易部、量化投资部、研究部、监察稽核部和风险管理部部门负责人组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业

能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值委员会成员 1/2 以上多数票通过，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

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

无。

### 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 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，国联安基金管理有限公司在国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

第14页共56页

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	2,721,332.48	3,025,536.07
结算备付金		510,642.91	466,817.90
存出保证金		10,485,770.08	12,790,845.91
交易性金融资产	6.4.7.2	199,463,742.19	241,188,181.19
其中：股票投资		199,463,742.19	241,188,181.19
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		5,469.39	58,708.14
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		213,186,957.05	257,530,089.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		52,806.96	195,319.02
应付管理人报酬		180,457.27	219,884.07
应付托管费		18,045.74	21,988.41
应付销售服务费		20,718.48	25,833.66
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	84,576.11	170,000.00
负债合计		356,604.56	633,025.16
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.7	262,861,385.06	275,235,486.33
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-50,031,032.57	-18,338,422.28
净资产合计		212,830,352.49	256,897,064.05
负债和净资产总计		213,186,957.05	257,530,089.21

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值 0.8112 元，A 类基金份额总额 111,955,585.44 份，C 类基金份额净值 0.8085 元，C 类基金份额总额 150,905,799.62 份，总份额合计 262,861,385.06 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-32,023,522.70	8,001,501.80
1.利息收入		40,773.78	275,015.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	40,773.78	147,483.93
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		-	127,531.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-22,383,521.59	5,443,489.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,614,861.96	3,808,929.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	32,592.69	-668.08
股利收益	6.4.7.13	2,198,747.68	1,635,227.99
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	-9,682,198.01	2,281,377.04
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	1,423.12	1,620.05
<b>减：二、营业总支出</b>		1,462,204.18	1,333,432.53
1. 管理人报酬		1,133,285.94	1,051,881.60



其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		113,328.62	105,188.13
3. 销售服务费		130,929.27	88,633.91
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		124.99	-
8. 其他费用	6.4.7.16	84,535.36	87,728.89
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-33,485,726.88</b>	<b>6,668,069.27</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-33,485,726.88</b>	<b>6,668,069.27</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-33,485,726.88</b>	<b>6,668,069.27</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	275,235,486.33	-	-18,338,422.28	256,897,064.05
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	275,235,486.33	-	-18,338,422.28	256,897,064.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-12,374,101.27	-	-31,692,610.29	-44,066,711.56
（一）、综合收益总额	-	-	-33,485,726.88	33,485,726.88
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-12,374,101.27	-	1,793,116.59	10,580,984.68

其中：1.基金申购款	2,856,460.18	-	-449,826.16	2,406,634.02
2.基金赎回款	-15,230,561.45	-	2,242,942.75	- 12,987,618.70
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	262,861,385.06	-	-50,031,032.57	212,830,352.49
项目	上年度可比期间 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	304,476,911.97	-	-2,353,788.55	302,123,123.42
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	304,476,911.97	-	-2,353,788.55	302,123,123.42
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-11,529,300.41	-	3,278,320.12	-8,250,980.29
(一)、综合收益总额	-	-	6,668,069.27	6,668,069.27
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-11,529,300.41	-	-3,389,749.15	- 14,919,049.56
其中：1.基金申购款	172,583,907.73	-	-765,850.26	171,818,057.47
2.基金赎回款	-184,113,208.14	-	-2,623,898.89	- 186,737,107.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产	-	-	-	-

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	292,947,611.56	-	924,531.57	293,872,143.13

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：魏东，主管会计工作负责人：叶培智，会计机构负责人：仲晓峰

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2022]2355 号《关于准予国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》注册，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《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，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 304,440,797.10 元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第 1013 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 12 月 5 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 304,476,911.97 基金份额，其中认购资金利息折合 36,114.87 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，基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用，但不从本类别的基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股。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(包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会准予上市的股票)、债券(国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。

本基金的投资组合比例为：本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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，持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

#### 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安中证 1000 指数增强型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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 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

本报告期内本基金无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

#### 6.4.6 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	2,721,332.48
等于：本金	2,721,094.03
加：应计利息	238.45
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	2,721,332.48

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	213,617,323.11	-	199,463,742.19	-14,153,580.92
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	213,617,323.11	-	199,463,742.19	-14,153,580.92

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 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

本报告期末本基金无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	40.75
预提审计费	24,863.02
预提信息披露费	59,672.34
合计	84,576.11

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 国联安中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	114,523,571.89	114,523,571.89
本期申购	875,013.84	875,013.84
本期赎回（以“-”号填列）	-3,443,000.29	-3,443,000.29
本期末	111,955,585.44	111,955,585.44

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

##### 国联安中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	160,711,914.44	160,711,914.44
本期申购	1,981,446.34	1,981,446.34

本期赎回（以“-”号填列）	-11,787,561.16	-11,787,561.16
本期末	150,905,799.62	150,905,799.62

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 国联安中证1000指数增强A

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	-1,294,067.21	-6,195,854.37	-7,489,921.58
本期期初	-1,294,067.21	-6,195,854.37	-7,489,921.58
本期利润	-9,940,952.18	-4,066,627.15	-14,007,579.33
本期基金份额交易产生的变动数	181,201.87	176,643.78	357,845.65
其中：基金申购款	-70,423.30	-85,937.88	-156,361.18
基金赎回款	251,625.17	262,581.66	514,206.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,053,817.52	-10,085,837.74	-21,139,655.26

##### 国联安中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,162,694.65	-8,685,806.05	-10,848,500.70
本期期初	-2,162,694.65	-8,685,806.05	-10,848,500.70
本期利润	-13,862,576.69	-5,615,570.86	-19,478,147.55
本期基金份额交易产生的变动数	705,062.26	730,208.68	1,435,270.94
其中：基金申购款	-163,149.99	-130,314.99	-293,464.98
基金赎回款	868,212.25	860,523.67	1,728,735.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,320,209.08	-13,571,168.23	-28,891,377.31

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元



项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	7,842.72
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	10,190.77
其他	22,740.29
合计	40,773.78

注：此处其他列示的是券商保证金利息收入。

#### 6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	889,867,644.39
减：卖出股票成本总额	912,612,516.96
减：交易费用	1,869,989.39
买卖股票差价收入	-24,614,861.96

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	32,592.69

#### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,198,747.68
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	2,198,747.68

## 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-9,682,198.01
——股票投资	-9,682,198.01
——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	-9,682,198.01

## 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,423.12
合计	1,423.12

## 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-

合计	84,535.36
----	-----------

#### 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
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
国联安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	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，本基金均未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无应支付关联方佣金。

##### 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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,133,285.94	1,051,881.60
其中：应支付销售机构的客户维护费	132,431.60	254,865.26
应支付基金管理人的净管理费	1,000,854.34	797,016.34

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 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：

每日应计提的基金管理费 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	113,328.62	105,188.13

注：支付基金托管人交通银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安中证 1000 指 数增强 A	国联安中证 1000 指数增 强 C	合计
国联安基金管理有限 公司	-	89,695.02	89,695.02
交通银行	-	353.22	353.22
合计	-	90,048.24	90,048.24
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安中证1000指 数增强A	国联安中证1000指数增 强C	合计
国联安基金管理有限	-	0.99	0.99

公司			
交通银行	-	436.44	436.44
合计	-	437.43	437.43

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国联安基金管理有限公司，再由国联安基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 C 类基金份额的基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间，基金管理人均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末，除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
交通银行	2,721,332.48	7,842.72	24,597,692.95	102,646.63

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024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
688692	达梦数据	2024-06-04	6 个月	新股锁定	86.96	174.93	67	5,826.32	11,720.31	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股锁定	11.88	18.98	448	5,322.24	8,503.04	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内(含)	新股待上市	18.65	18.65	820	15,293.00	15,293.00	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6 个月	新股待上市并锁定	18.65	18.65	92	1,715.80	1,715.80	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	新股锁定	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
603350	安乃达	2024-06-26	1 个月内(含)	新股待上市	20.56	20.56	869	17,866.64	17,866.64	-
603350	安乃达	2024-06-26	6 个月	新股待上市并锁定	20.56	20.56	97	1,994.32	1,994.32	-
603381	永臻股份	2024-06-19	6 个月	新股锁定	23.35	25.13	84	1,961.40	2,110.92	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股锁定	44.95	65.93	129	5,798.55	8,504.97	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	新股锁定	16.16	32.27	337	5,445.92	10,874.99	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	新股锁定	19.86	42.51	219	4,349.34	9,309.69	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股锁定	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股锁定	17.43	34.56	163	2,841.09	5,633.28	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股锁定	17.39	20.60	134	2,330.26	2,760.40	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股锁定	21.73	25.26	260	5,649.80	6,567.60	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股锁定	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	新股锁定	19.18	22.66	101	1,937.18	2,288.66	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6 个月	新股锁定	55.82	91.24	97	5,414.54	8,850.28	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6 个月(含)	新股锁定	-	91.24	38	-	3,467.12	-

688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股锁定	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股锁定	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6 个月	新股锁定	26.00	37.49	97	2,522.00	3,636.53	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股锁定	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股锁定	22.66	15.89	315	7,137.90	5,005.35	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股锁定	21.28	29.49	94	2,000.32	2,772.06	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股锁定	15.69	18.79	349	5,475.81	6,557.71	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股锁定	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股锁定	38.18	38.90	54	2,061.72	2,100.60	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1 个月内(含)	新股锁定	-	15.25	40	-	610.00	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股锁定	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
603312	西典新能	2024-01-04	6 个月	新股锁定	29.02	25.36	85	2,466.70	2,155.60	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新股锁定	16.98	13.48	142	2,411.16	1,914.16	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6 个月	新股锁定	72.46	68.06	33	2,391.18	2,245.98	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股锁定	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-

注：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新股中需要限售的部分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

本报告期末本基金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 2024 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，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 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，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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



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

于 2024 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%（2023 年 12 月 31 日：0.00%）。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

#### 6.4.13.4 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 2024 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							
货币资金	2,721,332.48	-	-	-	-	-	2,721,332.48
结算备付金	510,642.91	-	-	-	-	-	510,642.91
存出保证金	10,485,770.08	-	-	-	-	-	10,485,770.08
交易性金融 资产	-	-	-	-	-	199,463,742.19	199,463,742.19
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	5,469.39	5,469.39
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	13,717,745.47	-	-	-	-	199,469,211.58	213,186,957.05
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	52,806.96	52,806.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	180,457.27	180,457.27
应付托管费	-	-	-	-	-	18,045.74	18,045.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	20,718.48	20,718.48
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	84,576.11	84,576.11
负债总计	-	-	-	-	-	356,604.56	356,604.56
利率敏感度缺口	13,717,745.47	-	-	-	-	199,112,607.02	212,830,352.49
<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>1 个月以内</b>	<b>1-3 个月</b>	<b>3 个月 -1 年</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年 以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
资产							
货币资金	3,025,536.07	-	-	-	-	-	3,025,536.07
结算备付金	466,817.90	-	-	-	-	-	466,817.90
存出保证金	12,790,845.91	-	-	-	-	-	12,790,845.91
交易性金融资产	-	-	-	-	-	241,188,181.19	241,188,181.19
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	58,708.14	58,708.14
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,283,199.88	-	-	-	-	241,246,889.33	257,530,089.21
负债							

卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	195,319.02	195,319.02
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	219,884.07	219,884.07
应付托管费	-	-	-	-	-	21,988.41	21,988.41
应付销售服务费	-	-	-	-	-	25,833.66	25,833.66
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	633,025.16	633,025.16
利率敏感度缺口	16,283,199.88	-	-	-	-	240,613,864.17	256,897,064.05

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 2024 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% (2023 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(2023 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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例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，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	199,463,742.19	93.72	241,188,181.19	93.89
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	199,463,742.19	93.72	241,188,181.19	93.89

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 10,580,640.85	增加 11,229,712.72
	业绩比较基准下降 5%	减少 10,580,640.85	减少 11,229,712.72

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下：

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	199,261,014.54	240,673,432.53
第二层次	36,869.76	-
第三层次	165,857.89	514,748.66
合计	199,463,742.19	241,188,181.19

##### 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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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(2023 年 12 月 31 日：无)。

##### 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	199,463,742.19	93.56
	其中：股票	199,463,742.19	93.56
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	3,231,975.39	1.52
8	其他各项资产	10,491,239.47	4.92
9	合计	213,186,957.05	100.00

注：1、本报告期末本基金未持有全国中小企业股份转让系统挂牌股票。

2、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 7.2.1.1 指数投资期末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	1,139,223.00	0.54
B	采矿业	7,528,012.00	3.54
C	制造业	103,246,089.15	48.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,182,177.22	2.43
E	建筑业	2,105,643.00	0.99
F	批发和零售业	5,770,639.00	2.71
G	交通运输、仓储和邮政业	6,367,310.80	2.99
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,999,734.72	7.99

J	金融业	6,554,134.00	3.08
K	房地产业	3,416,600.00	1.61
L	租赁和商务服务业	2,287,845.00	1.07
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,063,810.00	0.50
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	1,460,194.00	0.69
S	综合	-	-
	合计	163,121,411.89	76.64

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

#### 7.2.1.2 积极投资期末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	3,199,920.00	1.50
C	制造业	28,970,241.56	13.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,039,589.60	0.49
E	建筑业	122,478.00	0.06
F	批发和零售业	332,838.00	0.16
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	26,898.30	0.01
J	金融业	75,075.00	0.04
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,419.12	0.00



M	科学研究和技术服务业	951,678.72	0.45
N	水利、环境和公共设施管理业	635,922.00	0.30
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	985,270.00	0.46
S	综合	-	-
	合计	36,342,330.30	17.08

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 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	601918	新集能源	161,300	1,572,675.00	0.74
2	002270	华明装备	69,100	1,536,784.00	0.72
3	002139	拓邦股份	143,900	1,528,218.00	0.72
4	600761	安徽合力	68,740	1,487,533.60	0.70
5	688018	乐鑫科技	14,995	1,479,706.60	0.70
6	301308	江波龙	15,300	1,449,522.00	0.68
7	600285	羚锐制药	59,400	1,438,074.00	0.68
8	601126	四方股份	73,500	1,412,670.00	0.66
9	300679	电连技术	35,000	1,408,050.00	0.66
10	002245	蔚蓝锂芯	178,900	1,386,475.00	0.65
11	605111	新洁能	44,820	1,371,043.80	0.64
12	601375	中原证券	392,600	1,338,766.00	0.63
13	000860	顺鑫农业	79,400	1,329,156.00	0.62
14	300638	广和通	76,800	1,313,280.00	0.62
15	600420	国药现代	121,900	1,301,892.00	0.61
16	002773	康弘药业	60,100	1,301,165.00	0.61
17	300857	协创数据	22,700	1,293,900.00	0.61
18	002249	大洋电机	272,900	1,290,817.00	0.61

19	600320	振华重工	375,400	1,283,868.00	0.60
20	600602	云赛智联	116,000	1,280,640.00	0.60
21	000758	中色股份	251,700	1,278,636.00	0.60
22	600750	江中药业	55,300	1,277,983.00	0.60
23	601963	重庆银行	162,700	1,260,925.00	0.59
24	002617	露笑科技	262,200	1,258,560.00	0.59
25	600577	精达股份	316,100	1,254,917.00	0.59
26	688208	道通科技	51,664	1,247,168.96	0.59
27	300303	聚飞光电	256,600	1,247,076.00	0.59
28	300170	汉得信息	202,900	1,245,806.00	0.59
29	002036	联创电子	184,200	1,243,350.00	0.58
30	601311	骆驼股份	154,200	1,236,684.00	0.58
31	600037	歌华有线	206,600	1,235,468.00	0.58
32	002020	京新药业	117,700	1,232,319.00	0.58
33	002635	安洁科技	79,800	1,232,112.00	0.58
34	600459	贵研铂业	91,200	1,232,112.00	0.58
35	601369	陕鼓动力	153,400	1,230,268.00	0.58
36	002004	华邦健康	323,100	1,227,780.00	0.58
37	300674	宇信科技	110,800	1,227,664.00	0.58
38	603699	纽威股份	71,700	1,227,504.00	0.58
39	300130	新国都	72,900	1,213,056.00	0.57
40	002583	海能达	296,900	1,208,383.00	0.57
41	600125	铁龙物流	202,200	1,207,134.00	0.57
42	300482	万孚生物	49,300	1,202,920.00	0.57
43	000600	建投能源	190,700	1,201,410.00	0.56
44	300031	宝通科技	83,500	1,199,895.00	0.56
45	688123	聚辰股份	19,608	1,192,754.64	0.56
46	002023	海特高新	130,300	1,192,245.00	0.56
47	002354	天娱数科	398,300	1,190,917.00	0.56
48	300685	艾德生物	67,500	1,190,700.00	0.56
49	000065	北方国际	114,500	1,187,365.00	0.56
50	003006	百亚股份	50,000	1,185,000.00	0.56
51	002467	二六三	354,700	1,184,698.00	0.56
52	002215	诺普信	159,000	1,184,550.00	0.56
53	603368	柳药集团	67,600	1,183,000.00	0.56
54	300188	国投智能	106,300	1,180,993.00	0.55
55	002906	华阳集团	43,900	1,174,764.00	0.55
56	300783	三只松鼠	53,600	1,172,232.00	0.55
57	300409	道氏技术	136,400	1,167,584.00	0.55
58	000915	华特达因	38,700	1,167,192.00	0.55
59	688106	金宏气体	66,620	1,167,182.40	0.55
60	002928	华夏航空	183,900	1,165,926.00	0.55
61	688798	艾为电子	20,582	1,165,352.84	0.55
62	688016	心脉医疗	11,869	1,163,755.45	0.55

63	600787	中储股份	240,500	1,156,805.00	0.54
64	000795	英洛华	208,700	1,156,198.00	0.54
65	002550	千红制药	214,300	1,155,077.00	0.54
66	300841	康华生物	22,800	1,154,592.00	0.54
67	300226	上海钢联	68,000	1,151,920.00	0.54
68	300634	彩讯股份	68,400	1,151,172.00	0.54
69	600557	康缘药业	73,000	1,146,100.00	0.54
70	000550	江铃汽车	52,700	1,144,117.00	0.54
71	600874	创业环保	204,600	1,143,714.00	0.54
72	600366	宁波韵升	218,900	1,142,658.00	0.54
73	000735	罗牛山	263,100	1,139,223.00	0.54
74	002267	陕天然气	150,500	1,137,780.00	0.53
75	002204	大连重工	265,300	1,132,831.00	0.53
76	002697	红旗连锁	244,400	1,131,572.00	0.53
77	603299	苏盐井神	119,000	1,130,500.00	0.53
78	002434	万里扬	230,700	1,130,430.00	0.53
79	601969	海南矿业	178,300	1,130,422.00	0.53
80	300379	东方通	139,600	1,127,968.00	0.53
81	601609	金田股份	197,600	1,118,416.00	0.53
82	688586	江航装备	119,915	1,115,209.50	0.52
83	000517	荣安地产	415,500	1,113,540.00	0.52
84	603348	文灿股份	40,200	1,113,138.00	0.52
85	002053	云南能投	91,700	1,108,653.00	0.52
86	300323	华灿光电	254,600	1,107,510.00	0.52
87	300821	东岳硅材	161,800	1,106,712.00	0.52
88	002461	珠江啤酒	149,000	1,105,580.00	0.52
89	688232	新点软件	55,996	1,104,241.12	0.52
90	603995	甬金股份	62,500	1,095,000.00	0.51
91	603025	大豪科技	79,200	1,094,544.00	0.51
92	000828	东莞控股	121,300	1,092,913.00	0.51
93	603132	金徽股份	79,400	1,092,544.00	0.51
94	002782	可立克	98,500	1,091,380.00	0.51
95	688389	普门科技	66,762	1,085,550.12	0.51
96	603162	海通发展	116,560	1,084,008.00	0.51
97	603595	东尼电子	52,600	1,083,034.00	0.51
98	603055	台华新材	106,900	1,082,897.00	0.51
99	600618	氯碱化工	123,200	1,081,696.00	0.51
100	600007	中国国贸	49,200	1,080,432.00	0.51
101	001338	永顺泰	110,100	1,078,980.00	0.51
102	301327	华宝新能	18,800	1,077,240.00	0.51
103	000016	深康佳 A	503,500	1,072,455.00	0.50
104	002651	利君股份	195,100	1,071,099.00	0.50
105	003021	兆威机电	23,200	1,070,680.00	0.50
106	601886	江河集团	219,000	1,068,720.00	0.50

107	603693	江苏新能	91,800	1,066,716.00	0.50
108	600323	瀚蓝环境	50,900	1,063,810.00	0.50
109	002901	大博医疗	40,800	1,053,864.00	0.50
110	002534	西子洁能	104,900	1,050,049.00	0.49
111	600662	外服控股	261,700	1,049,417.00	0.49
112	300741	华宝股份	68,800	1,048,512.00	0.49
113	603489	八方股份	38,800	1,046,824.00	0.49
114	601068	中铝国际	246,300	1,036,923.00	0.49
115	301262	海看股份	45,900	1,035,045.00	0.49
116	688336	三生国健	50,757	1,032,904.95	0.49
117	002961	瑞达期货	94,300	1,032,585.00	0.49
118	300587	天铁股份	252,300	1,019,292.00	0.48
119	000030	富奥股份	206,200	1,012,442.00	0.48
120	601101	昊华能源	108,700	998,953.00	0.47
121	603103	横店影视	72,100	997,864.00	0.47
122	300755	华致酒行	72,600	991,716.00	0.47
123	002068	黑猫股份	138,600	984,060.00	0.46
124	600776	东方通信	99,800	981,034.00	0.46
125	002123	梦网科技	137,900	969,437.00	0.46
126	603093	南华期货	111,500	965,590.00	0.45
127	002646	天佑德酒	89,500	915,585.00	0.43
128	603936	博敏电子	102,300	859,320.00	0.40
129	000913	钱江摩托	54,200	854,192.00	0.40
130	000688	国城矿业	81,700	777,784.00	0.37
131	000567	海德股份	135,700	761,277.00	0.36
132	300953	震裕科技	13,600	737,120.00	0.35
133	300079	数码视讯	173,600	704,816.00	0.33
134	000029	深深房 A	65,600	697,328.00	0.33
135	002978	安宁股份	24,300	676,998.00	0.32
136	601890	亚星锚链	91,600	645,780.00	0.30
137	000690	宝新能源	123,900	631,890.00	0.30
138	603871	嘉友国际	31,780	562,188.20	0.26
139	600267	海正药业	79,700	559,494.00	0.26
140	600185	格力地产	123,600	525,300.00	0.25
141	002948	青岛银行	155,500	524,035.00	0.25
142	601528	瑞丰银行	108,000	509,760.00	0.24
143	601811	新华文轩	33,000	462,330.00	0.22
144	300119	瑞普生物	32,900	448,098.00	0.21
145	000528	柳工	39,000	436,410.00	0.21
146	600623	华谊集团	74,200	428,876.00	0.20
147	301316	慧博云通	26,300	386,084.00	0.18
148	002043	兔宝宝	35,400	367,098.00	0.17
149	605333	沪光股份	12,900	359,265.00	0.17
150	300527	中船应急	46,305	299,593.35	0.14

151	603733	仙鹤股份	12,900	226,782.00	0.11
152	600908	无锡银行	30,300	161,196.00	0.08
153	300233	金城医药	7,400	110,408.00	0.05
154	300772	运达股份	10,900	104,640.00	0.05
155	601333	广深铁路	30,100	97,524.00	0.05
156	000061	农产品	17,800	86,508.00	0.04
157	600335	国机汽车	11,400	65,778.00	0.03
158	000025	特力 A	2,900	38,976.00	0.02
159	600586	金晶科技	3,600	20,880.00	0.01
160	301526	国际复材	3,582	11,928.06	0.01
161	601096	宏盛华源	1,674	6,846.66	0.00
162	688266	泽璟制药	117	6,343.74	0.00
163	001309	德明利	50	4,320.00	0.00
164	300034	钢研高纳	80	1,271.20	0.00
165	601083	锦江航运	85	812.60	0.00
166	002911	佛燃能源	73	667.22	0.00
167	600869	远东股份	12	41.88	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	600183	生益科技	49,600.00	1,044,576.00	0.49
2	000883	湖北能源	172,800.00	1,038,528.00	0.49
3	600038	中直股份	25,100.00	1,031,861.00	0.48
4	000725	京东方 A	250,900.00	1,026,181.00	0.48
5	002835	同为股份	60,600.00	1,023,534.00	0.48
6	688008	澜起科技	17,885.00	1,022,306.60	0.48
7	002282	博深股份	159,500.00	1,019,205.00	0.48
8	600299	安迪苏	104,900.00	1,017,530.00	0.48
9	688510	航亚科技	55,101.00	1,014,409.41	0.48
10	605166	聚合顺	96,700.00	1,014,383.00	0.48
11	300529	健帆生物	37,000.00	1,006,770.00	0.47
12	000786	北新建材	33,900.00	1,005,474.00	0.47
13	000830	鲁西化工	86,000.00	996,740.00	0.47
14	603408	建霖家居	75,500.00	995,845.00	0.47
15	300048	合康新能	214,800.00	994,524.00	0.47
16	002152	广电运通	94,800.00	991,608.00	0.47
17	002741	光华科技	110,400.00	991,392.00	0.47
18	601633	长城汽车	39,100.00	989,230.00	0.46
19	002019	亿帆医药	79,800.00	986,328.00	0.46
20	002189	中光学	70,700.00	985,558.00	0.46
21	603096	新经典	58,300.00	985,270.00	0.46

22	002128	电投能源	46,500.00	981,150.00	0.46
23	600547	山东黄金	35,700.00	977,466.00	0.46
24	301309	万得凯	38,100.00	973,836.00	0.46
25	000423	东阿阿胶	15,400.00	964,040.00	0.45
26	300492	华图山鼎	10,100.00	951,420.00	0.45
27	605369	拱东医疗	23,200.00	925,680.00	0.43
28	000975	银泰黄金	55,600.00	905,724.00	0.43
29	002008	大族激光	42,500.00	884,000.00	0.42
30	300657	弘信电子	53,900.00	809,578.00	0.38
31	000930	中粮科技	151,000.00	759,530.00	0.36
32	002463	沪电股份	19,900.00	726,350.00	0.34
33	002078	太阳纸业	51,800.00	722,610.00	0.34
34	603568	伟明环保	30,900.00	635,922.00	0.30
35	002420	毅昌科技	137,900.00	628,824.00	0.30
36	300005	探路者	110,900.00	555,609.00	0.26
37	603277	银都股份	16,400.00	492,656.00	0.23
38	000703	恒逸石化	61,600.00	436,744.00	0.21
39	002001	新和成	18,000.00	345,600.00	0.16
40	603727	博迈科	25,500.00	335,580.00	0.16
41	600694	大商股份	19,800.00	332,838.00	0.16
42	000807	云铝股份	15,300.00	206,703.00	0.10
43	601800	中国交建	13,700.00	122,478.00	0.06
44	601336	新华保险	2,500.00	75,075.00	0.04
45	688313	仕佳光子	6,473.00	61,622.96	0.03
46	002563	森马服饰	10,500.00	61,005.00	0.03
47	002519	银河电子	7,100.00	34,861.00	0.02
48	603350	安乃达	966.00	19,860.96	0.01
49	603285	键邦股份	912.00	17,008.80	0.01
50	301538	骏鼎达	135.00	12,317.40	0.01
51	688692	达梦数据	67.00	11,720.31	0.01
52	301536	星辰科技	337.00	10,874.99	0.01
53	301566	达利凯普	576.00	9,774.72	0.00
54	688691	灿芯股份	219.00	9,309.69	0.00
55	301392	汇成真空	219.00	9,123.54	0.00
56	301580	爱迪特	129.00	8,504.97	0.00
57	301565	中仑新材	448.00	8,503.04	0.00
58	301591	肯特股份	219.00	8,098.62	0.00
59	688652	京仪装备	191.00	7,466.19	0.00
60	301539	宏鑫科技	361.00	7,155.02	0.00
61	688720	艾森股份	165.00	6,689.10	0.00
62	301587	中瑞股份	260.00	6,567.60	0.00
63	688709	成都华微	349.00	6,557.71	0.00
64	301578	辰奕智能	153.00	6,054.21	0.00
65	688695	中创股份	186.00	5,868.30	0.00

66	001389	广合科技	163.00	5,633.28	0.00
67	688530	欧莱新材	344.00	5,538.40	0.00
68	301588	美新科技	257.00	5,461.25	0.00
69	301502	华阳智能	138.00	5,220.54	0.00
70	688584	上海合晶	315.00	5,005.35	0.00
71	603341	龙旗科技	97.00	3,636.53	0.00
72	301459	丰茂股份	83.00	3,295.93	0.00
73	301517	陕西华达	61.00	3,294.00	0.00
74	301529	福赛科技	90.00	2,952.90	0.00
75	603082	北自科技	94.00	2,772.06	0.00
76	001359	平安电工	134.00	2,760.40	0.00
77	001387	雪祺电气	173.00	2,638.25	0.00
78	001306	夏厦精密	45.00	2,429.55	0.00
79	603373	安邦护卫	88.00	2,419.12	0.00
80	603344	星德胜	101.00	2,288.66	0.00
81	603325	博隆技术	33.00	2,245.98	0.00
82	603004	鼎龙科技	130.00	2,203.50	0.00
83	603312	西典新能	85.00	2,155.60	0.00
84	603381	永臻股份	84.00	2,110.92	0.00
85	603375	盛景微	54.00	2,100.60	0.00
86	001379	腾达科技	142.00	1,914.16	0.00
87	001358	兴欣新材	91.00	1,867.32	0.00
88	301489	思泉新材	23.00	1,623.34	0.00
89	301568	思泰克	46.00	1,463.72	0.00
90	603273	天元智能	78.00	1,431.30	0.00
91	001239	永达股份	89.00	1,235.32	0.00
92	001378	德冠新材	48.00	1,145.28	0.00
93	001210	金房能源	80.00	1,061.60	0.00
94	603193	润本股份	57.00	1,048.23	0.00
95	603107	上海汽配	64.00	1,016.96	0.00
96	301555	惠柏新材	24.00	679.92	0.00
97	300708	聚灿光电	60.00	540.00	0.00
98	301413	安培龙	13.00	537.55	0.00
99	603579	荣泰健康	30.00	463.80	0.00
100	301508	中机认检	7.00	258.72	0.00
101	603231	索宝蛋白	10.00	170.40	0.00
102	301516	中远通	4.00	74.52	0.00
103	002687	乔治白	6.00	25.20	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	003021	兆威机电	4,866,569.60	1.89
2	688798	艾为电子	4,004,210.15	1.56
3	300527	中船应急	3,974,395.90	1.55
4	300352	北信源	3,789,021.00	1.47
5	601633	长城汽车	3,700,553.00	1.44
6	300188	国投智能	3,692,168.00	1.44
7	002651	利君股份	3,421,071.00	1.33
8	600761	安徽合力	3,104,027.80	1.21
9	002807	江阴银行	2,999,659.00	1.17
10	600557	康缘药业	2,950,429.00	1.15
11	300685	艾德生物	2,928,680.00	1.14
12	000676	智度股份	2,916,407.00	1.14
13	601126	四方股份	2,911,102.00	1.13
14	603300	华铁应急	2,878,278.80	1.12
15	000860	顺鑫农业	2,869,044.00	1.12
16	300226	上海钢联	2,847,261.00	1.11
17	002646	天佑德酒	2,837,912.00	1.10
18	000550	江铃汽车	2,820,993.00	1.10
19	600459	贵研铂业	2,815,141.00	1.10
20	301015	百洋医药	2,813,960.00	1.10

## 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	000676	智度股份	4,465,848.00	1.74
2	601567	三星医疗	4,451,931.00	1.73
3	000035	中国天楹	3,939,851.00	1.53
4	300352	北信源	3,902,170.00	1.52
5	002837	英维克	3,781,300.00	1.47
6	003021	兆威机电	3,766,580.80	1.47
7	002895	川恒股份	3,667,609.00	1.43
8	300527	中船应急	3,601,026.00	1.40
9	601137	博威合金	3,537,340.00	1.38
10	603298	杭叉集团	3,476,951.00	1.35
11	600562	国睿科技	3,463,972.00	1.35
12	300618	寒锐钴业	3,292,248.28	1.28



13	601019	山东出版	3,283,547.00	1.28
14	688235	百济神州	3,271,310.31	1.27
15	000921	海信家电	3,245,469.00	1.26
16	688158	优刻得	3,142,414.24	1.22
17	688278	特宝生物	3,089,634.14	1.20
18	002807	江阴银行	3,074,286.00	1.20
19	000928	中钢国际	3,064,660.00	1.19
20	603300	华铁应急	3,021,861.00	1.18

#### 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

买入股票成本（成交）总额	880,570,275.97
卖出股票收入（成交）总额	889,867,644.39

注：不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的股指期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合

的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

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

7.12.2 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	10,485,770.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	5,469.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,491,239.47

### 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

本报告期末本基金前十名指数股票中不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金前五名积极投资中不存在流通受限情况。

### 8 基金份额持有人信息

#### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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
国联安中证 1000 指数增强 A	440	254,444.51	92,612,637.31	82.72%	19,342,948.13	17.28%
国联安中证 1000 指数增强 C	838	180,078.52	110,585,285.50	73.28%	40,320,514.12	26.72%
合计	1,278	205,681.83	203,197,922.81	77.30%	59,663,462.25	22.70%

#### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安中证 1000 指数增强 A	203,933.37	0.18%
	国联安中证 1000 指数增强 C	20,026.33	0.01%
	合计	223,959.70	0.09%

#### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
	国联安中证 1000 指数增强 A	10~50

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国联安中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安中证 1000 指数增强 A	10~50
	国联安中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国联安中证 1000 指数增强 A	国联安中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 12 月 5 日）基金份额总额	127,347,614.96	177,129,297.01
本报告期期初基金份额总额	114,523,571.89	160,711,914.44
本报告期基金总申购份额	875,013.84	1,981,446.34
减：本报告期基金总赎回份额	3,443,000.29	11,787,561.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	111,955,585.44	150,905,799.62

注：总申购份额包含本报告期内发生的转换入和红利再投资份额；总赎回份额包含本报告期内发生的转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、2024 年 6 月 28 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》，王琤女士不再担任公司总经理职务，由常务副总经理兼首席投资官魏东先生代行总经理职务。

2、本报告期内基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 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	
西南证券股份有限公司	2	1,769,391,903.94	100.00%	1,311,592.08	100.00%	-

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 金融服务能力和水平较强，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

A 基金管理人根据上述标准测试并考察后确定选用交易单元的证券经营机构。

B 基金管理人和被选中的证券经营机构签订证券经纪服务协议

2、报告期内使用证券经营机构交易单元的变更情况

本基金本报告期使用证券经营机构的交易单元无变更。

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
西南证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

**10.8 其他重大事件**

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加泰信财富为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2024-01-15
2	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024-01-22
3	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-01-22
4	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加万联证券为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2024-01-31
5	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加南京证券为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2024-01-31
6	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加微众银行为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2024-03-18
7	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加上海陆享基金销售有限公司为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2024-03-26
8	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金	规定网站	2024-03-29

	2023 年年度报告		
9	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-29
10	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024-04-22
11	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-22
12	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加江苏银行为代销机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2024-04-30
13	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加宁波银行为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2024-05-10
14	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书更新（2024 年第 1 号）	规定网站	2024-05-17
15	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2024-05-17
16	国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2024-05-17
17	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2024-05-31
18	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	规定网站、规定报刊	2024-06-28

## 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	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	106,177,836.63	0.00	0.00	106,177,836.63	40.39%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对</p>							

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

2024 年 6 月 28 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》，王琤女士不再担任公司总经理职务，由常务副总经理兼首席投资官魏东先生代行总经理职务。

## 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中证 1000 指数增强型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安中证 1000 指数增强型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  
二〇二四年八月三十日