

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 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：二〇二四年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 国联安沪深 300ETF 联接 |
| 基金主代码 | 008390 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 12 月 25 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 5,722,838,270.16 份 |
| 投资目标 | 通过投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。 |
| 投资策略 | 本基金为目标 ETF 的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标 ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金力争将日均跟踪偏离度 |

| | | |
|-----------------|---|---------------------------|
| | <p>的绝对值控制在 0.35% 以内，年化跟踪误差控制在 4% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> | |
| 业绩比较基准 | <p>本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95% + 银行活期存款利率（税后）×5%。</p> | |
| 风险收益特征 | <p>本基金属于目标 ETF 的联接基金，目标 ETF 为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所代表的市场组合的风险收益特征相似。</p> | |
| 基金管理人 | <p>国联安基金管理有限公司</p> | |
| 基金托管人 | <p>中国工商银行股份有限公司</p> | |
| 下属分级基金的基金简称 | <p>国联安沪深 300ETF 联接 A</p> | <p>国联安沪深 300ETF 联接 C</p> |
| 下属分级基金的交易代码 | <p>008390</p> | <p>008391</p> |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | <p>4,466,201,900.57 份</p> | <p>1,256,636,369.59 份</p> |

2.1.1 目标基金基本情况

| | |
|--------------|---------------------------------|
| 基金名称 | <p>国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金</p> |
| 基金主代码 | <p>515660</p> |
| 基金运作方式 | <p>交易型开放式</p> |
| 基金合同生效日 | <p>2019 年 11 月 25 日</p> |
| 基金份额上市的证券交易所 | <p>上海证券交易所</p> |
| 上市日期 | <p>2019 年 12 月 24 日</p> |
| 基金管理人名称 | <p>国联安基金管理有限公司</p> |
| 基金托管人名称 | <p>中国工商银行股份有限公司</p> |

2.1.2 目标基金产品说明

| | |
|---------------|--|
| <p>投资目标</p> | <p>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。</p> |
| <p>投资策略</p> | <p>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。</p> |
| <p>业绩比较基准</p> | <p>沪深 300 指数收益率</p> |
| <p>风险收益特征</p> | <p>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。</p> |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| | |
|---------------|---|
| <p>主要财务指标</p> | <p>报告期 (2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日)</p> |
|---------------|---|

| | 国联安沪深 300ETF 联接 A | 国联安沪深 300ETF 联接 C |
|----------------|----------------------|----------------------|
| 1.本期已实现收益 | 4,042,530.40 | 512,163.23 |
| 2.本期利润 | 673,206,039.65 | 179,458,668.58 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1508 | 0.1257 |
| 4.期末基金资产净值 | 4,702,581,659.95 | 1,312,177,538.04 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.0529 | 1.0442 |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

2、上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、国联安沪深 300ETF 联接 A:

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|--------|--------|
| 过去三个月 | 16.70% | 1.49% | 15.25% | 1.51% | 1.45% | -0.02% |
| 过去六个月 | 15.42% | 1.18% | 12.92% | 1.19% | 2.50% | -0.01% |
| 过去一年 | 9.96% | 1.02% | 8.53% | 1.05% | 1.43% | -0.03% |
| 过去三年 | -11.48% | 1.00% | -16.43% | 1.04% | 4.95% | -0.04% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同 生效起至今 | 15.83% | 1.10% | 1.08% | 1.14% | 14.75% | -0.04% |

2、国联安沪深 300ETF 联接 C:

| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①—③ | ②—④ |
|-------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 16.64% | 1.49% | 15.25% | 1.51% | 1.39% | -0.02% |
| 过去六个月 | 15.30% | 1.18% | 12.92% | 1.19% | 2.38% | -0.01% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去一年 | 9.75% | 1.02% | 8.53% | 1.05% | 1.22% | -0.03% |
| 过去三年 | -12.02% | 1.00% | -16.43% | 1.04% | 4.41% | -0.04% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 14.92% | 1.10% | 1.08% | 1.14% | 13.84% | -0.04% |

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

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金
 累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
 (2019 年 12 月 25 日至 2024 年 9 月 30 日)

1. 国联安沪深 300ETF 联接 A:



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 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 2019 年 12 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。

2. 国联安沪深 300ETF 联接 C:



注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 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 2019 年 12 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 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|------|-------------|------|-----------------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 黄欣 | 基金经理 | 2019-12-25 | - | 22 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 |

| | | | | |
|--|--|--|--|---|
| | | | | <p>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</p> |
|--|--|--|--|---|

| | | | | | |
|-----|-------------------------------|------------|---|--------------------|--|
| | | | | | 投资基金的基金经理。 |
| 章榭元 | 基金经 理、量 化投资 部总经 理 | 2020-08-13 | - | 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（兼投资经理）。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。 |

注：1、基金经理的任职日期和离职日期为公司对外公告之日；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

| 姓名 | 产品类型 | 产品数量（只） | 资产净值(元) | 任职时间 |
|-----|----------|---------|-------------------|------------|
| 章榭元 | 公募基金 | 14.00 | 47,604,551,186.93 | 2020-05-06 |
| | 私募资产管理计划 | 4.00 | 22,477,198,661.88 | 2024-09-02 |
| | 其他组合 | 0.00 | 0.00 | - |
| | 合计 | 18.00 | 70,081,749,848.81 | |

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联接基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人遵照相应法律法规和内部规章，制定并完善了《国联安基金管理有限公司公平交易制度》（以下简称“公平交易制度”），用以规范包括投资授权、研究分析、投资决策、交易执行以及投资管理过程中涉及的实施效果与业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统内的公平交易模块；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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，国际局势依旧动荡；国内方面，PMI 指数处于收缩区间，内需不足仍是核心矛盾，投资者对后市缺乏信心，股市自 7-8 月一路震荡下行。9 月，在美联储降息 50 个基点以及国内包括提振中国资产价格、优化房地产调控等一系列政策的支持下，A 股在 9 月底迎来一波大反弹。

整个三季度，股市整体呈上涨态势，小盘股表现相对较好。沪深 300 指数上涨约 16.07%，中证 100 指数上涨 16.66%，创业板综指上涨 26.08%。

依据基金合同的约定，沪深 300ETF 联接基金始终保持较高的仓位，将主要资产投资于沪深 300ETF 中以跟踪沪深 300 指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，国联安沪深 300ETF 联接 A 的份额净值为 1.0529 元，国联安沪深 300ETF 联接 C 的份额净值为 1.0442 元。本报告期内，国联安沪深 300ETF 联接 A 的份额净值增长率为 16.70%，同期业绩比较基准收益率为 15.25%；国联安沪深 300ETF 联接 C 的份额净值增长率为 16.64%，同期业绩比较基准收益率为 15.25%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | - | - |
| | 其中：股票 | - | - |
| 2 | 基金投资 | 5,702,333,666.70 | 94.76 |
| 3 | 固定收益投资 | 41,676,069.37 | 0.69 |

| | | | |
|---|-------------------|------------------|--------|
| | 其中：债券 | 41,676,069.37 | 0.69 |
| | 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 | 263,778,117.50 | 4.38 |
| 8 | 其他各项资产 | 9,951,940.14 | 0.17 |
| 9 | 合计 | 6,017,739,793.71 | 100.00 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 期末投资目标基金明细

| 序号 | 基金名称 | 基金类型 | 运作方式 | 管理人 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|--------------|------|--------|-------------|------------------|---------------|
| 1 | 国联安沪深 300ETF | 股票型 | 交易型开放式 | 国联安基金管理有限公司 | 5,702,333,666.70 | 94.81 |

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有股票。

5.3.2 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。

5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本报告期末本基金未持有股票。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------|---------|---------------|
|----|------|---------|---------------|

| | | | |
|----|-----------|---------------|------|
| 1 | 国家债券 | 41,676,069.37 | 0.69 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 41,676,069.37 | 0.69 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019749 | 24 国债 15 | 281,000 | 28,171,196.93 | 0.47 |
| 2 | 019740 | 24 国债 09 | 134,000 | 13,504,872.44 | 0.22 |

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

5.8 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。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有股指期货。

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

为有效控制指数的跟踪误差，本基金在注重风险管理的前提下，以套期保值为目的，将适度运用股指期货。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本报告期末本基金未持有国债期货。

5.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本基金目标 ETF 投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆证监局、国家外汇管理局深圳市分局、国家金融监督管理总局黑龙江监管局、国家金融监督管理总局四川监管局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局河南监管局、国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局山西监管局、国家金融监督管理总局泉州监管分局、天津市市场监督管理委员会、国家金融监督管理总局北京监管局、河北省市场监督管理局的处罚。

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，本基金目标 ETF 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。

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

5.12.2 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况。

5.12.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 105,699.55 |

| | | |
|---|---------|--------------|
| 2 | 应收证券清算款 | 5,649,256.68 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 3,131,282.91 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | 1,065,701.00 |
| 9 | 合计 | 9,951,940.14 |

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有股票，不存在前十名股票流通受限情况。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国联安沪深300ETF联接A | 国联安沪深300ETF联接C |
|----------------|------------------|------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 4,464,032,366.07 | 1,612,708,648.27 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 5,380,949.93 | 12,831,463.23 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 3,211,415.43 | 368,903,741.91 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 4,466,201,900.57 | 1,256,636,369.59 |

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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08月14日至2024年09月30日 | 1,160,177.74 | 0.00 | 0.00 | 1,160,117,788.74 | 20.27% |
| | 2 | 2024年07月01日至2024年09月30日 | 1,874,330,347.85 | 0.00 | 0.00 | 1,874,330,347.85 | 32.75% |
| 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，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(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。</p> | | | | | | | |

§9 备查文件目录

9.1 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联接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联接基金基金合同》
- 3、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》
- 4、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议》

- 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

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二四年十月二十五日