国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年中期报告

2025 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：上海银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月二十九日

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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 28 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 2025 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 7
2.5 其他相关资料 7
3 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 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遵规守信情况声明 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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） 15
6.1 资产负债表 15
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 40
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 48
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 48
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 48
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 48
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 48
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 49
7.12 投资组合报告附注 49
8 基金份额持有人信息 50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 50

8.2 期末上市基金前十名持有人 50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 51
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 51
9 开放式基金份额变动 51
10 重大事件揭示 51
10.1 基金份额持有人大会决议 51
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 51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 52
10.4 基金投资策略的改变 52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 52
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 52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 52
10.8 其他重大事件 54
11 影响投资者决策的其他重要信息 54
12 备查文件目录 55
12.1 备查文件目录 55
12.2 存放地点 55
12.3 查阅方式 55

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联安 ESG300ETF
场内简称	ESG300ETF
基金主代码	159653
交易代码	159653
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 3 月 6 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	上海银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	55,972,068.00 份
基金合同存续期	不定期

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。
投资策略	本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2%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。 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。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股或增发；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 对于存托凭证投资，本基金将在深入研究的基础上，通过定性分析和定量分析相结合的方式，精选出具有比较优势的存托凭证。 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。为此，本基金将以市场利率趋势研判为主，基于对宏观经济环境的深入研究和基金未来现金流的分析，在保证流动性和风险可控的前提下，灵活运用目标久期策略、收益率曲线策略、相对价值策略、骑乘策略和利差套利策略等对高流动性、低风险的债券品种进行主动投资。 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 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。 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。 参与融资业务时，本基金将力争利用融资的杠杆作用，降低因申购造成基金仓位较低带来的跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。 参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。
业绩比较基准	国证 ESG300 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	上海银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李华	周直毅
	联系电话	021-38992888	021-68475608
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	custody@bosc.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95594
传真		021-50151582	021-68476901
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	上海市黄浦区中山南路688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）自由贸易试验区银城中路168号37层
邮政编码		200121	200120
法定代表人		于业明	顾建忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报、深交所
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（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	720,917.22
本期利润	92,393.99
加权平均基金份额本期利润	0.0016
本期加权平均净值利润率	0.16%
本期基金份额净值增长率	0.43%
3.1.2 期末数据和指标	**报告期末(2025 年 6 月 30 日)**
期末可供分配利润	-2,709,308.48
期末可供分配基金份额利润	-0.0484
期末基金资产净值	55,432,685.37
期末基金份额净值	0.9904
3.1.3 累计期末指标	**报告期末(2025 年 6 月 30 日)**
基金份额累计净值增长率	-0.96%

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	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

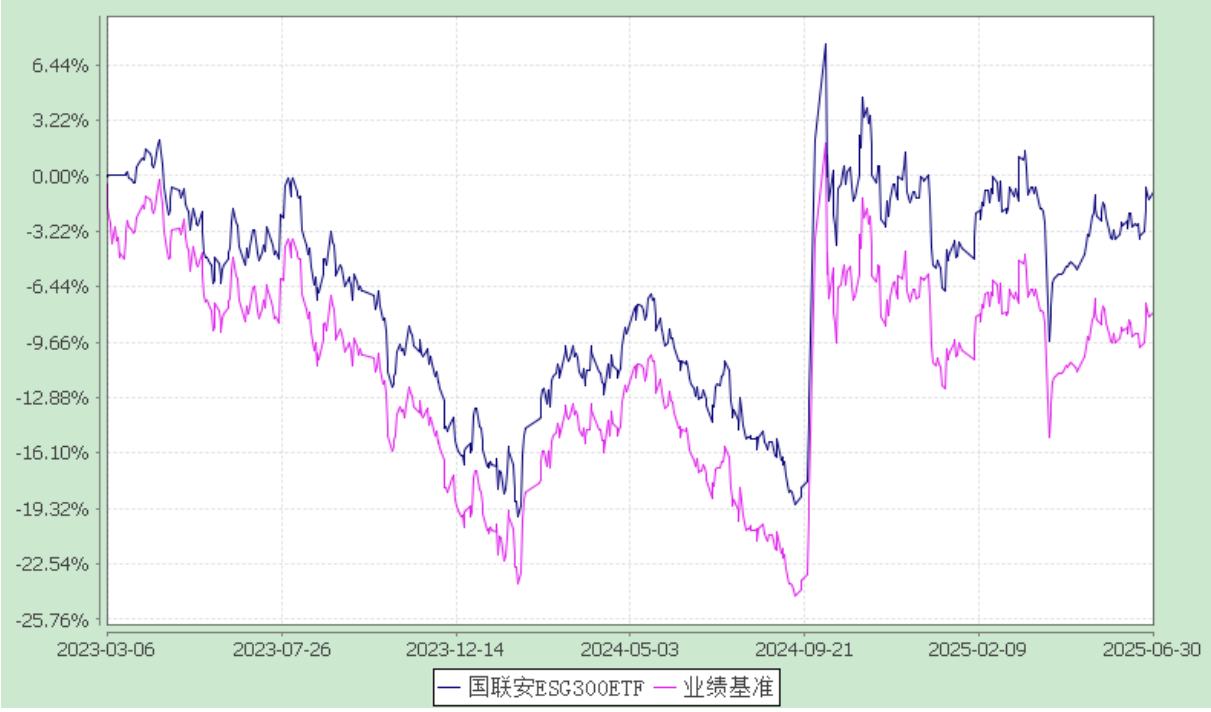
	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去一个月	2.81%	0.58%	2.04%	0.60%	0.77%	-0.02%
过去三个月	0.98%	1.10%	-0.10%	1.12%	1.08%	-0.02%
过去六个月	0.43%	1.01%	-0.78%	1.04%	1.21%	-0.03%
过去一年	13.66%	1.35%	11.19%	1.41%	2.47%	-0.06%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-0.96%	1.06%	-7.90%	1.12%	6.94%	-0.06%

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

国联安国证 ESG300 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

（2023 年 3 月 6 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：1、本基金业绩比较基准为国证 ESG300 指数收益率；

2、本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章椹元	基金经理、量化投资部总经理	2023-03-06	-	17 年（自 2008 年起）	章椹元先生，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 月至 2025 年 1 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；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；2024 年 12 月起兼任国联安上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 6 月起兼任国联安中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
黄欣	基金经理	2023-03-06	-	23 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 A100 指数证券投资基金(LOF)（2024 年 10 月由国联安中证 100 指数证券投资基金(LOF)更名而来）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；2024 年 12 月起兼任国联安上证科创板芯片设计主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注：1、基金经理的任职日期和离职日期以公司对外公告为准；

2、证券从业年限的统计标准为证券行业的工作经历年限。

4.1.3 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
章椹元	公募基金	15.00	41,099,487,393.15	2020-05-06
	私募资产管理计划	4.00	21,140,599,759.53	2024-09-02
	其他组合	0.00	0.00	-
	合计	19.00	62,240,087,152.68	

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本报告期内，本基金管理人严格执行公平交易制度的规定，公平对待不同投资组合，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和投资决策等方面均享有平等机会；在交易环节严格按照时间优先，价格优先的原则执行指令；如遇指令价位相同或指令价位不同但市场条件都满足时，及时执行交易系统中的公平交易模块；采用公平交易分析系统对不同投资组合的交易价差进行定期分析；对投资流程独立稽核等。

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易次数为 2 次，发生原因是为了满足产品合同中相关投资比例的限制要求。公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

4.4 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

2025 年上半年，Deepseek 横空出世，成为 2025 年开年后最火热的话题，中国在人工智能领域的赶超也极大鼓舞了市场对中国在科技领域发展的信心。消费方面，内需不足依旧是当前宏观经济需要提振的重要方面。国际局势方面，俄乌战争仍在继续，印巴冲突，伊朗与以色列之间的战争，导致原油等大宗商品价格出现较大的波动。

A 股方面，科技类的股票在 Deepseek 和机器人概念的支撑下，在春节后迎来一波行情，军工股在歼 10c 优异表现的刺激下走出一波行情，金融股在稳定币概念下也出现了一波上涨。

上半年股市涨跌表现不一，小盘股表现相对较好。沪深 300 指数微涨 0.03%，创业板综指上涨 8.78%，ESG300 指数下跌 0.78%。

依据基金合同的约定，ESG300ETF 基金始终保持合理的仓位，采用完全复制的方法跟踪 ESG300 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 0.9904 元，本报告期份额净值增长率为 0.43%，同期业绩比较基准收益率为-0.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，美国针对他国的关税措施依旧存在反复的可能性，俄乌战争，中东局势也存在诸多的变数，全球宏观经济存在较大的不确定性。未来中美关系、中欧关系的发展有待观察，但中国与西方国家在高科技领域的竞争不可避免。中国在人工智能、半导体、尖端军工等领域都有所突破，相信未来高科技领域会不断出现惊喜，值得长期关注，在中央的相应政策之下，国内消费、房地产行业预计会逐步复苏，相应的板块也或将存在投资机会。

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、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，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同以及托管协议的有关约定，诚实、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人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，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,545,753.94	2,512,284.10
结算备付金		30,890.91	12,262.28
存出保证金		4,995.40	2,539.23
交易性金融资产	6.4.7.2	53,938,563.15	55,778,706.22
其中：股票投资		53,938,563.15	55,778,706.22
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		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		55,520,203.40	58,305,791.83
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2025 年 6 月 30 日**	**上年度末 2024 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		22,378.25	24,828.67
应付托管费		2,685.39	2,979.44
应付销售服务费		-	-
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	62,454.39	121,561.38
负债合计		87,518.03	149,369.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	55,972,068.00	58,972,068.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-539,382.63	-815,645.66
净资产合计		55,432,685.37	58,156,422.34
负债和净资产总计		55,520,203.40	58,305,791.83

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9904 元，基金份额总额 55,972,068.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		**307,371.29**	**-984,757.47**
1.利息收入		5,744.27	8,282.01
其中：存款利息收入	6.4.7.9	5,744.27	8,282.01
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		903,716.09	568,504.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	79,644.79	-98,978.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,712.97	-
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	6.4.7.13	822,358.33	667,483.16
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	-628,523.23	-1,420,645.04
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	26,434.16	-140,898.73
减：二、营业总支出		**214,977.30**	**121,787.33**
1．管理人报酬		138,772.27	90,929.94
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		16,652.66	10,911.61
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		-	-
8．其他费用	6.4.7.16	59,552.37	19,945.78
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**92,393.99**	**-1,106,544.80**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**92,393.99**	**-1,106,544.80**
五、其他综合收益的税后净额		**-**	**-**
六、综合收益总额		**92,393.99**	**-1,106,544.80**

6.3 净资产变动表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目		本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	58,972,068.00	-	-815,645.66	58,156,422.34
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	58,972,068.00	-	-815,645.66	58,156,422.34
三、本期增减变动额（减少以“－”号填列）	-3,000,000.00	-	276,263.03	-2,723,736.97
（一）、综合收益总额	-	-	92,393.99	92,393.99
（二）、本期基金	-3,000,000.00	-	183,869.04	-2,816,130.96

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	-	-120,984.06	2,879,015.94
2.基金赎回款	-6,000,000.00	-	304,853.10	-5,695,146.90
（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	55,972,068.00	-	-539,382.63	55,432,685.37
项目		**上年度可比期间 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	10,972,068.00	-	-1,483,810.57	9,488,257.43
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	10,972,068.00	-	-1,483,810.57	9,488,257.43
三、本期增减变动额（减少以“−”号填列）	51,000,000.00	-	-6,485,692.28	44,514,307.72
（一）、综合收益总额	-	-	-1,106,544.80	-1,106,544.80
（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）	51,000,000.00	-	-5,379,147.48	45,620,852.52
其中：1.基金申购款	51,000,000.00	-	-5,379,147.48	45,620,852.52
2.基金赎回款	-	-	-	-
（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	61,972,068.00	-	-7,969,502.85	54,002,565.15

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：唐华，主管会计工作负责人：蔡蓓蕾，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

国联安国证 ESG300 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[2022]1537 号《关于准予国联安国证 ESG300 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 2023 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模 232,972,068.00 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及注册登记机构为国联安基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国债、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）。

本基金可根据法律法规的规定参与融资业务以及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。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述比例。

本基金的标的指数为国证 ESG300 指数。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。

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、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

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日至 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

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‰；根据财政部、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》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

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。

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征增值税试点的通知》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[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[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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	1,545,753.94
等于：本金	1,545,471.92
加：应计利息	282.02
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	1,545,753.94

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		50,138,056.25	-	53,938,563.15	3,800,506.90
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		50,138,056.25	-	53,938,563.15	3,800,506.90

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 2025 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	2,947.02
其中：交易所市场	2,947.02
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	39,671.58
合计	62,454.39

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	58,972,068.00	58,972,068.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,000,000.00	-6,000,000.00
本期末	55,972,068.00	55,972,068.00

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	-3,597,666.81	2,782,021.15	-815,645.66
本期期初	-3,597,666.81	2,782,021.15	-815,645.66
本期利润	720,917.22	-628,523.23	92,393.99
本期基金份额交易产生的变动数	167,441.11	16,427.93	183,869.04
其中：基金申购款	-175,095.18	54,111.12	-120,984.06
基金赎回款	342,536.29	-37,683.19	304,853.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,709,308.48	2,169,925.85	-539,382.63

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	5,718.28

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	20.30
其他	5.69
合计	5,744.27

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	45,341.94
股票投资收益——赎回差价收入	34,302.85
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	79,644.79

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	8,373,179.39
减：卖出股票成本总额	8,319,637.37
减：交易费用	8,200.08
买卖股票差价收入	45,341.94

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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	5,695,146.90
减：现金支付赎回款总额	3,715,548.90
减：赎回股票成本总额	1,945,295.15
减：交易费用	-
赎回差价收入	34,302.85

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本报告期内本基金无证券出借差价收入。

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

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	1.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,711.91
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,712.97

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	13,213.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	11,499.95
减：应计利息总额	1.11
减：交易费用	0.53
买卖债券差价收入	1,711.91

6.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	822,358.33
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	822,358.33

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	-628,523.23
——股票投资	-628,523.23
——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	-628,523.23

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	26,434.16
合计	26,434.16

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
银行汇划费用	33.00
其他费用	12.00
合计	59,552.37

注：此处列示的“其他费用”是指银行对账单费用。

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
上海银行股份有限公司（“上海银行”）	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

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 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	138,772.27	90,929.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	10.58	739.83
应支付基金管理人的净管理费	138,761.69	90,190.11

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 0.50%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 ×0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,652.66	10,911.61

注：支付基金托管人上海银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.06%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：

每日应计提的基金托管费＝前一日基金资产净值 ×0.06% / 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发生转融通出借业务。

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，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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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	50,668,900.00	90.53%	50,668,900.00	85.92%

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 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
上海银行	1,545,753.94	5,718.28	3,548,293.91	7,127.07

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行保管，按银行同业利率计息。本基金通过“上海银行股份有限公司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 2025 年 6 月 30 日的余额为人民币 30,890.91 元（2024 年 6 月 30 日无相关余额）。

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（2025 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

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 2025 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 2025 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%（2024 年 12 月 31 日：0.00%）。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。本基金赎回基金份额采用组合证券形式，流动性风险相对较低。

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时间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%。

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 2025 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	1,545,753.94	-	-	-	-	-	1,545,753.94
结算备付金	30,890.91	-	-	-	-	-	30,890.91
存出保证金	4,995.40	-	-	-	-	-	4,995.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	53,938,563.15	53,938,563.15
买入返售	-	-	-	-	-	-	-

金融资产							
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	1,581,640.25	-	-	-	-	53,938,563.15	55,520,203.40
负债							
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	-	-	-	-	-	22,378.25	22,378.25
应付托管费	-	-	-	-	-	2,685.39	2,685.39
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	62,454.39	62,454.39
负债总计	-	-	-	-	-	87,518.03	87,518.03
利率敏感度缺口	1,581,640.25	-	-	-	-	53,851,045.12	55,432,685.37
上年度末 2024 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							
货币资金	2,512,284.10	-	-	-	-	-	2,512,284.10
结算备付金	12,262.28	-	-	-	-	-	12,262.28
存出保证金	2,539.23	-	-	-	-	-	2,539.23
交易性金	-	-	-	-	-	55,778,70	55,778,706.22

融资产						6.22	
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	2,527,085.61	-	-	-	-	55,778,706.22	58,305,791.83
负债							
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	-	-	-	-	-	24,828.67	24,828.67
应付托管费	-	-	-	-	-	2,979.44	2,979.44
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	121,561.38	121,561.38
负债总计	-	-	-	-	-	149,369.49	149,369.49
利率敏感度缺口	2,527,085.61	-	-	-	-	55,629,336.73	58,156,422.34

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 2025 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% (2024 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(2024 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	53,938,563.15	97.30	55,778,706.22	95.91

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	53,938,563.15	97.30	55,778,706.22	95.91

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 2,697,657.82	增加 2,764,481.64
	业绩比较基准下降 5%	减少 2,697,657.82	减少 2,764,481.64

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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	53,938,563.15	55,750,546.22
第二层次	-	28,160.00
第三层次	-	-
合计	53,938,563.15	55,778,706.22

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 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(2024 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	53,938,563.15	97.15
	其中：股票	53,938,563.15	97.15
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	1,576,644.85	2.84
8	其他各项资产	4,995.40	0.01
9	合计	55,520,203.40	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 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	390,693.00	0.70
B	采矿业	2,812,680.40	5.07
C	制造业	31,369,491.75	56.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,377,512.00	4.29
E	建筑业	721,730.00	1.30
F	批发和零售业	146,626.00	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,208,498.00	2.18
H	住宿和餐饮业	35,904.00	0.06
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,433,700.40	2.59
J	金融业	11,473,946.00	20.70
K	房地产业	569,337.00	1.03
L	租赁和商务服务业	243,645.00	0.44
M	科学研究和技术服务业	831,444.00	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	90,762.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	232,593.60	0.42
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	53,938,563.15	97.30

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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	2,100	2,959,992.00	5.34
2	300750	宁德时代	9,500	2,396,090.00	4.32
3	601318	中国平安	37,700	2,091,596.00	3.77
4	600036	招商银行	45,100	2,072,345.00	3.74
5	600900	长江电力	44,900	1,353,286.00	2.44
6	601166	兴业银行	56,700	1,323,378.00	2.39
7	000333	美的集团	18,300	1,321,260.00	2.38
8	601899	紫金矿业	55,800	1,088,100.00	1.96
9	300059	东方财富	46,400	1,073,232.00	1.94
10	002594	比亚迪	3,200	1,062,112.00	1.92
11	000858	五粮液	6,700	796,630.00	1.44
12	600276	恒瑞医药	15,000	778,500.00	1.40
13	601288	农业银行	117,200	689,136.00	1.24
14	688981	中芯国际	7,150	630,415.50	1.14
15	600887	伊利股份	22,100	616,148.00	1.11
16	002475	立讯精密	17,300	600,137.00	1.08
17	603259	药明康德	8,100	563,355.00	1.02
18	000725	京东方 A	122,800	489,972.00	0.88
19	300124	汇川技术	7,300	471,361.00	0.85
20	300308	中际旭创	3,200	466,752.00	0.84
21	300760	迈瑞医疗	2,000	449,500.00	0.81
22	601601	中国太保	11,400	427,614.00	0.77
23	601088	中国神华	10,300	417,562.00	0.75
24	002352	顺丰控股	8,200	399,832.00	0.72
25	600031	三一重工	22,100	396,695.00	0.72
26	603501	豪威集团	3,100	395,715.00	0.71
27	002714	牧原股份	9,300	390,693.00	0.70
28	002415	海康威视	14,000	388,220.00	0.70
29	601668	中国建筑	67,200	387,744.00	0.70
30	000063	中兴通讯	11,800	383,382.00	0.69
31	000001	平安银行	31,400	378,998.00	0.68
32	300274	阳光电源	5,460	370,024.20	0.67
33	601857	中国石油	42,300	361,665.00	0.65

34	601688	华泰证券	19,700	350,857.00	0.63
35	600309	万华化学	6,400	347,264.00	0.63
36	600690	海尔智家	13,900	344,442.00	0.62
37	603019	中科曙光	4,700	330,880.00	0.60
38	601012	隆基绿能	21,400	321,428.00	0.58
39	600660	福耀玻璃	5,500	313,555.00	0.57
40	688008	澜起科技	3,800	311,600.00	0.56
41	600028	中国石化	54,400	306,816.00	0.55
42	601919	中远海控	19,900	299,296.00	0.54
43	600406	国电南瑞	13,140	294,467.40	0.53
44	000338	潍柴动力	18,900	290,682.00	0.52
45	601985	中国核电	29,500	274,940.00	0.50
46	601138	工业富联	12,800	273,664.00	0.49
47	601988	中国银行	47,000	264,140.00	0.48
48	601766	中国中车	37,500	264,000.00	0.48
49	601818	光大银行	61,700	256,055.00	0.46
50	601939	建设银行	25,500	240,720.00	0.43
51	000425	徐工机械	30,800	239,316.00	0.43
52	601628	中国人寿	5,800	238,902.00	0.43
53	688271	联影医疗	1,800	229,932.00	0.41
54	605499	东鹏饮料	720	226,116.00	0.41
55	688111	金山办公	800	224,040.00	0.40
56	603993	洛阳钼业	26,600	223,972.00	0.40
57	601009	南京银行	19,200	223,104.00	0.40
58	600905	三峡能源	52,000	221,520.00	0.40
59	600048	保利发展	27,300	221,130.00	0.40
60	600436	片仔癀	1,100	220,011.00	0.40
61	600104	上汽集团	13,700	219,885.00	0.40
62	603288	海天味业	5,620	218,674.20	0.39
63	601658	邮储银行	39,800	217,706.00	0.39
64	300014	亿纬锂能	4,700	215,307.00	0.39
65	601888	中国中免	3,500	213,395.00	0.38
66	002463	沪电股份	5,000	212,900.00	0.38
67	002241	歌尔股份	9,100	212,212.00	0.38
68	601600	中国铝业	29,700	209,088.00	0.38
69	002050	三花智控	7,800	205,764.00	0.37
70	601825	沪农商行	21,200	205,640.00	0.37
71	600019	宝钢股份	30,700	202,313.00	0.36
72	300015	爱尔眼科	16,120	201,177.60	0.36
73	600760	中航沈飞	3,400	199,308.00	0.36
74	600547	山东黄金	6,100	194,773.00	0.35
75	601390	中国中铁	34,700	194,667.00	0.35
76	000977	浪潮信息	3,800	193,344.00	0.35
77	600089	特变电工	15,923	189,961.39	0.34

78	601916	浙商银行	55,100	186,789.00	0.34
79	603799	华友钴业	5,000	185,100.00	0.33
80	600958	东方证券	18,400	178,112.00	0.32
81	002384	东山精密	4,700	177,519.00	0.32
82	600585	海螺水泥	8,000	171,760.00	0.31
83	002179	中航光电	4,160	167,897.60	0.30
84	300433	蓝思科技	7,200	160,560.00	0.29
85	000002	万科 A	24,900	159,858.00	0.29
86	600438	通威股份	9,500	159,125.00	0.29
87	601336	新华保险	2,700	157,950.00	0.28
88	000538	云南白药	2,800	156,212.00	0.28
89	002422	科伦药业	4,300	154,456.00	0.28
90	000166	申万宏源	30,300	152,106.00	0.27
91	601377	兴业证券	23,500	145,465.00	0.26
92	002304	洋河股份	2,200	142,010.00	0.26
93	002460	赣锋锂业	4,100	138,457.00	0.25
94	688036	传音控股	1,700	135,490.00	0.24
95	600989	宝丰能源	8,300	133,962.00	0.24
96	600183	生益科技	4,400	132,660.00	0.24
97	600886	国投电力	8,900	131,186.00	0.24
98	601058	赛轮轮胎	9,600	125,952.00	0.23
99	600066	宇通客车	5,000	124,300.00	0.22
100	600426	华鲁恒升	5,700	123,519.00	0.22
101	000807	云铝股份	7,700	123,046.00	0.22
102	002466	天齐锂业	3,800	121,752.00	0.22
103	301236	软通动力	2,200	120,208.00	0.22
104	600011	华能国际	16,800	119,952.00	0.22
105	600196	复星医药	4,700	117,923.00	0.21
106	002340	格林美	17,900	113,665.00	0.21
107	601111	中国国航	14,400	113,616.00	0.20
108	002236	大华股份	7,100	112,748.00	0.20
109	601360	三六零	11,000	112,200.00	0.20
110	001979	招商蛇口	12,700	111,379.00	0.20
111	000661	长春高新	1,100	109,098.00	0.20
112	600745	闻泰科技	3,200	107,296.00	0.19
113	601868	中国能建	46,700	104,141.00	0.19
114	600487	亨通光电	6,800	104,040.00	0.19
115	688777	中控技术	2,300	103,293.00	0.19
116	002920	德赛西威	1,000	102,130.00	0.18
117	002797	第一创业	14,400	101,952.00	0.18
118	300450	先导智能	4,100	101,885.00	0.18
119	300347	泰格医药	1,900	101,308.00	0.18
120	600346	恒力石化	7,100	101,246.00	0.18
121	603369	今世缘	2,600	101,218.00	0.18

122	300207	欣旺达	5,000	100,300.00	0.18
123	601319	中国人保	11,500	100,165.00	0.18
124	002916	深南电路	910	98,107.10	0.18
125	000895	双汇发展	4,000	97,640.00	0.18
126	002202	金风科技	9,500	97,375.00	0.18
127	601066	中信建投	4,000	96,200.00	0.17
128	003816	中国广核	25,900	94,276.00	0.17
129	300866	安克创新	800	90,880.00	0.16
130	600885	宏发股份	4,060	90,578.60	0.16
131	601633	长城汽车	4,200	90,216.00	0.16
132	002600	领益智造	10,500	90,195.00	0.16
133	600741	华域汽车	5,100	90,015.00	0.16
134	002281	光迅科技	1,800	88,776.00	0.16
135	600219	南山铝业	23,100	88,473.00	0.16
136	601877	正泰电器	3,900	88,413.00	0.16
137	000786	北新建材	3,300	87,384.00	0.16
138	300759	康龙化成	3,550	87,117.00	0.16
139	002129	TCL 中环	10,900	83,712.00	0.15
140	000423	东阿阿胶	1,600	83,680.00	0.15
141	600600	青岛啤酒	1,200	83,352.00	0.15
142	300122	智飞生物	4,250	83,257.50	0.15
143	002180	纳思达	3,600	82,584.00	0.15
144	300896	爱美客	460	80,412.60	0.15
145	688396	华润微	1,700	80,172.00	0.14
146	600109	国金证券	9,100	79,807.00	0.14
147	002709	天赐材料	4,400	79,728.00	0.14
148	600873	梅花生物	7,400	79,106.00	0.14
149	002223	鱼跃医疗	2,200	78,320.00	0.14
150	002078	太阳纸业	5,800	78,068.00	0.14
151	002938	鹏鼎控股	2,400	76,872.00	0.14
152	601615	明阳智能	6,600	75,834.00	0.14
153	000876	新希望	7,900	74,102.00	0.13
154	002271	东方雨虹	6,900	74,037.00	0.13
155	600580	卧龙电驱	3,720	73,544.40	0.13
156	000021	深科技	3,900	73,086.00	0.13
157	000999	华润三九	2,336	73,070.08	0.13
158	600188	兖矿能源	5,920	72,046.40	0.13
159	002624	完美世界	4,700	71,299.00	0.13
160	603659	璞泰来	3,790	71,176.20	0.13
161	000617	中油资本	9,700	70,810.00	0.13
162	002821	凯莱英	800	70,600.00	0.13
163	603236	移远通信	800	68,640.00	0.12
164	600332	白云山	2,600	68,536.00	0.12
165	002410	广联达	5,100	68,391.00	0.12

166	300832	新产业	1,200	68,064.00	0.12
167	601607	上海医药	3,800	67,944.00	0.12
168	300136	信维通信	3,000	67,200.00	0.12
169	600875	东方电气	4,000	66,960.00	0.12
170	600549	厦门钨业	3,200	66,944.00	0.12
171	002459	晶澳科技	6,700	66,866.00	0.12
172	603605	珀莱雅	800	66,232.00	0.12
173	300142	沃森生物	6,000	66,000.00	0.12
174	601898	中煤能源	5,900	64,546.00	0.12
175	002152	广电运通	4,800	64,512.00	0.12
176	603345	安井食品	800	64,336.00	0.12
177	688223	晶科能源	12,300	63,837.00	0.12
178	600845	宝信软件	2,700	63,774.00	0.12
179	300773	拉卡拉	1,900	63,555.00	0.11
180	300316	晶盛机电	2,300	62,445.00	0.11
181	300999	金龙鱼	2,100	62,013.00	0.11
182	601872	招商轮船	9,800	61,348.00	0.11
183	300012	华测检测	5,200	60,788.00	0.11
184	600803	新奥股份	3,200	60,480.00	0.11
185	603444	吉比特	200	60,390.00	0.11
186	600060	海信视像	2,600	59,852.00	0.11
187	688599	天合光能	4,114	59,776.42	0.11
188	300628	亿联网络	1,700	59,092.00	0.11
189	600765	中航重机	3,500	59,080.00	0.11
190	600369	西南证券	13,400	58,290.00	0.11
191	600699	均胜电子	3,300	57,552.00	0.10
192	300373	扬杰科技	1,100	57,090.00	0.10
193	000729	燕京啤酒	4,400	56,892.00	0.10
194	600177	雅戈尔	7,600	55,480.00	0.10
195	600909	华安证券	9,500	55,385.00	0.10
196	600732	爱旭股份	4,200	55,020.00	0.10
197	600498	烽火通信	2,600	54,678.00	0.10
198	603228	景旺电子	1,300	54,392.00	0.10
199	002683	广东宏大	1,600	54,304.00	0.10
200	688385	复旦微电	1,100	54,197.00	0.10
201	000960	锡业股份	3,500	53,550.00	0.10
202	000039	中集集团	6,800	53,448.00	0.10
203	300748	金力永磁	2,240	53,401.60	0.10
204	000887	中鼎股份	3,000	52,770.00	0.10
205	000400	许继电气	2,400	52,248.00	0.09
206	600486	扬农化工	890	51,620.00	0.09
207	002080	中材科技	2,600	50,700.00	0.09
208	300413	芒果超媒	2,300	50,186.00	0.09
209	300296	利亚德	8,200	50,020.00	0.09

210	600026	中远海能	4,800	49,584.00	0.09
211	002487	大金重工	1,500	49,350.00	0.09
212	300682	朗新集团	2,100	49,350.00	0.09
213	688187	时代电气	1,140	48,621.00	0.09
214	002841	视源股份	1,400	48,440.00	0.09
215	600312	平高电气	3,100	47,709.00	0.09
216	000513	丽珠集团	1,300	46,852.00	0.08
217	688568	中科星图	1,300	46,813.00	0.08
218	688183	生益电子	900	46,080.00	0.08
219	600008	首创环保	15,100	45,602.00	0.08
220	600535	天士力	2,900	45,385.00	0.08
221	002056	横店东磁	3,100	43,865.00	0.08
222	600998	九州通	8,500	43,690.00	0.08
223	601018	宁波港	11,800	43,188.00	0.08
224	002506	协鑫集成	15,900	42,453.00	0.08
225	688005	容百科技	1,888	42,140.16	0.08
226	603678	火炬电子	1,100	41,833.00	0.08
227	300751	迈为股份	600	41,736.00	0.08
228	600383	金地集团	10,800	40,932.00	0.07
229	603486	科沃斯	700	40,761.00	0.07
230	002249	大洋电机	6,100	40,138.00	0.07
231	300390	天华新能	2,100	40,047.00	0.07
232	600380	健康元	3,600	39,708.00	0.07
233	688009	中国通号	7,700	39,578.00	0.07
234	600132	重庆啤酒	700	38,570.00	0.07
235	000921	海信家电	1,500	38,550.00	0.07
236	002747	埃斯顿	1,900	38,456.00	0.07
237	603568	伟明环保	2,000	38,160.00	0.07
238	601966	玲珑轮胎	2,600	38,142.00	0.07
239	000830	鲁西化工	3,700	38,110.00	0.07
240	603338	浙江鼎力	800	37,920.00	0.07
241	300677	英科医疗	1,600	37,888.00	0.07
242	603899	晨光股份	1,300	37,687.00	0.07
243	002936	郑州银行	18,200	37,492.00	0.07
244	300212	易华录	1,700	36,992.00	0.07
245	600282	南钢股份	8,800	36,960.00	0.07
246	600867	通化东宝	4,500	36,900.00	0.07
247	688301	奕瑞科技	420	36,796.20	0.07
248	601880	辽港股份	24,400	36,600.00	0.07
249	000708	中信特钢	3,100	36,456.00	0.07
250	688331	荣昌生物	600	36,300.00	0.07
251	300573	兴齐眼药	700	36,253.00	0.07
252	600325	华发股份	7,400	36,038.00	0.07
253	600754	锦江酒店	1,600	35,904.00	0.06

254	600004	白云机场	3,900	35,490.00	0.06
255	600685	中船防务	1,300	35,347.00	0.06
256	601866	中远海发	14,300	35,321.00	0.06
257	600970	中材国际	4,100	35,178.00	0.06
258	600271	航天信息	3,800	35,112.00	0.06
259	600511	国药股份	1,200	34,992.00	0.06
260	002773	康弘药业	1,200	34,764.00	0.06
261	000598	兴蓉环境	4,800	34,608.00	0.06
262	688050	爱博医疗	500	34,425.00	0.06
263	600131	国网信通	1,900	33,630.00	0.06
264	002831	裕同科技	1,400	32,788.00	0.06
265	002508	老板电器	1,700	32,317.00	0.06
266	300979	华利集团	600	31,542.00	0.06
267	603882	金域医学	1,100	31,416.00	0.06
268	603456	九洲药业	2,000	30,420.00	0.05
269	600755	厦门国贸	5,000	30,250.00	0.05
270	688676	金盘科技	900	30,105.00	0.05
271	600779	水井坊	700	29,848.00	0.05
272	601808	中海油服	2,100	28,896.00	0.05
273	300888	稳健医疗	700	28,770.00	0.05
274	688778	厦钨新能	500	27,960.00	0.05
275	601231	环旭电子	1,900	27,797.00	0.05
276	002266	浙富控股	9,000	27,720.00	0.05
277	600377	宁沪高速	1,800	27,612.00	0.05
278	002032	苏泊尔	500	26,195.00	0.05
279	600315	上海家化	1,200	25,284.00	0.05
280	600236	桂冠电力	4,000	25,080.00	0.05
281	000035	中国天楹	5,800	24,882.00	0.04
282	600801	华新水泥	2,100	24,864.00	0.04
283	002531	天顺风能	3,400	24,276.00	0.04
284	600500	中化国际	6,300	24,129.00	0.04
285	601568	北元集团	5,800	24,070.00	0.04
286	000582	北部湾港	2,900	23,925.00	0.04
287	002557	洽洽食品	1,100	23,782.00	0.04
288	600717	天津港	4,800	21,888.00	0.04
289	600597	光明乳业	2,600	21,866.00	0.04
290	601298	青岛港	2,500	21,725.00	0.04
291	601598	中国外运	4,300	21,199.00	0.04
292	688475	萤石网络	600	18,912.00	0.03
293	688248	南网科技	600	18,876.00	0.03
294	688100	威胜信息	500	18,525.00	0.03
295	001872	招商港口	900	17,874.00	0.03
296	000959	首钢股份	5,000	17,000.00	0.03
297	601869	长飞光纤	400	16,288.00	0.03

298	603733	仙鹤股份	600	12,444.00	0.02
299	600956	新天绿能	1,100	8,492.00	0.02
300	001289	龙源电力	500	8,090.00	0.01

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

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	601211	国泰海通	375,134.92	0.65
2	601318	中国平安	332,525.00	0.57
3	688008	澜起科技	305,891.76	0.53
4	600519	贵州茅台	295,910.00	0.51
5	601766	中国中车	269,616.00	0.46
6	600036	招商银行	228,208.00	0.39
7	601600	中国铝业	203,175.00	0.35
8	300750	宁德时代	198,907.00	0.34
9	002384	东山精密	155,194.00	0.27
10	600900	长江电力	154,099.00	0.26
11	300433	蓝思科技	151,488.00	0.26
12	002594	比亚迪	132,377.00	0.23
13	000333	美的集团	131,997.00	0.23
14	601899	紫金矿业	117,184.00	0.20
15	688111	金山办公	109,734.00	0.19
16	601166	兴业银行	105,006.00	0.18
17	601868	中国能建	104,608.00	0.18
18	600885	宏发股份	93,525.00	0.16
19	600276	恒瑞医药	91,292.00	0.16
20	000858	五粮液	89,137.00	0.15

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	601328	交通银行	720,949.00	1.24
2	601211	国泰海通	670,714.78	1.15
3	002371	北方华创	406,040.00	0.70

4	600837	海通证券	340,327.92	0.59
5	600519	贵州茅台	315,886.00	0.54
6	000568	泸州老窖	290,547.00	0.50
7	600809	山西汾酒	280,184.00	0.48
8	601225	陕西煤业	272,403.00	0.47
9	601006	大秦铁路	251,750.00	0.43
10	600036	招商银行	205,080.00	0.35
11	601318	中国平安	195,421.00	0.34
12	600893	航发动力	192,690.00	0.33
13	601988	中国银行	191,446.00	0.33
14	601166	兴业银行	167,476.00	0.29
15	002311	海大集团	167,440.00	0.29
16	601186	中国铁建	147,633.00	0.25
17	600900	长江电力	141,984.00	0.24
18	600674	川投能源	109,292.00	0.19
19	600176	中国巨石	107,035.00	0.18
20	601899	紫金矿业	96,077.00	0.17

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	8,521,874.68
卖出股票的收入（成交）总额	8,373,179.39

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，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、国家金融监督管理总局山东监管局、云南金融监管局、珠海市香洲区市场监督管理局、深圳市市场监督管理局、国家金融监督管理总局山西监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海南证监局、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福建监管局的处罚。

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	4,995.40
2	应收清算款	-
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	4,995.40

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票，不存在前五名积极投资流通受限情况。

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

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
205	273,034.48	51,770,202.00	92.49%	4,201,866.00	7.51%

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	中国太平洋人寿保险股份有限公司－分红-个人分红	50,668,900.00	90.53%
2	方正证券股份有限公司	1,096,044.00	1.96%
3	王青	600,016.00	1.07%
4	易新建	500,014.00	0.89%

5	袁伊	498,014.00	0.89%
6	韩宏兴	420,012.00	0.75%
7	张巧红	197,015.00	0.35%
8	陆健翔	177,500.00	0.32%
9	葛伟	156,011.00	0.28%
10	黄素娴	150,011.00	0.27%

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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：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（2023 年 3 月 6 日）基金份额总额	232,972,068.00
本报告期期初基金份额总额	58,972,068.00
本报告期基金总申购份额	3,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	55,972,068.00

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

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，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
方正证券股份有限公司	2	11,189,252.23	69.01%	2,151.50	68.61%	-
山西证券股份有限公司	1	5,025,146.00	30.99%	984.41	31.39%	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：一、选择证券经营机构参与证券交易的标准

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券经营机构参与证券交易。具体标准如下：

（一） 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于3亿元人民币；

（二） 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（三）经营行为稳健、规范；

（四）合规风控能力强，内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具有完善的合规风控机制，能满足基金运作高度保密要求；

（五）不存在对拟提供交易、研究服务已经造成或者可能造成不良影响的诉讼、仲裁或其他重大事项；

（六）交易服务能力较强，具备产品运作所需的高效、安全的通讯和硬件条件，交易设施满足产品证券交易的需要；

（七）研究能力较强，能及时、全面地向基金管理人提供高质量的宏观、行业、市场、个股的分析研究报告及全面丰富的信息服务；能根据基金管理人所管理产品的特定要求，提供专门定制的研究服务；

（八）能协助基金管理人拓展资产管理业务和能力，促进基金管理人业务发展等。

二、选择证券经营机构参与证券交易的程序

基金管理人根据上述标准对拟合作证券经营机构开展尽职调查、建立证券经营机构白名单。基金管理人与白名单内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，基金管理人定期对合作证券经营机构开展服务评价，根据各证券经营机构的研究能力和质量、投资研究服务水平、上市公司交流机会和投资研讨会质量等进行评比排名，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。

基金管理人定期评估、维护证券经营机构白名单。如评估发现合作证券经营机构不再符合上述标准的，基金管理人将其从证券经营机构白名单中删除。若证券经营机构所提供的服务不符合要求的，基金管理人可提前中止租用其交易单元。

三、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

无。

四、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

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
方正证券股份有限公司	13,213.50	100.00%	-	-	-	-
山西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-

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	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2025-01-22
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-01-22
3	国联安基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况	规定网站	2025-03-31
4	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年年度报告	规定网站、深圳证券交易所	2025-03-31
5	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025-03-31
6	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站、深圳证券交易所	2025-04-22
7	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-04-22
8	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券为基金申购赎回代办券商的公告	规定网站、规定报刊、深圳证券交易所、上海证券交易所	2025-05-15
9	国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2025 年第 1 号）	规定网站、深圳证券交易所	2025-05-16
10	国联安国证 ESG300 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、深圳证券交易所	2025-05-16
11	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金增加国泰海通证券为基金申购赎回代办券商的公告	规定网站、规定报刊、深圳证券交易所	2025-05-26
12	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东方证券为基金申购赎回代办券商的公告	规定网站、规定报刊、深圳证券交易所	2025-05-26

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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况

类别	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	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	50,668,900.00	0.00	0.00	50,668,900.00	90.53%
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。							

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国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

4、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

5、 基金管理人业务资格批件和营业执照

6、 基金托管人业务资格批件和营业执照

7、 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

12.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二五年八月二十九日