国联安创业板科技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：中国银河证券股份有限公司

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。

基金托管人中国银河证券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 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 8
4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 11
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 13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 13
5 托管人报告 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 40
7.1 期末基金资产组合情况 40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 40
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 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 46
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 46
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 46
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 46
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 46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 46
7.12 投资组合报告附注 46
8 基金份额持有人信息 48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 48

8.2 期末上市基金前十名持有人 48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 48
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 48
9 开放式基金份额变动 49
10 重大事件揭示 49
10.1 基金份额持有人大会决议 49
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 49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 49
10.4 基金投资策略的改变 49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 49
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 49
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 50
10.8 其他重大事件 51
11 备查文件目录 52
11.1 备查文件目录 52
11.2 存放地点 52
11.3 查阅方式 52

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联安创科技 ETF
场内简称	创科技 ETF
基金主代码	159777
交易代码	159777
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 9 月 27 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	127,280,565.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021 年 10 月 18 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.25%以内，年化跟踪误差控制在 3%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金主要采取完全复制法，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。 本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。
业绩比较基准	创业板科技指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	中国银河证券股份有限公司
信息披露	姓名	李华	罗新民
	联系电话	021-38992888	010-80927820

负责人	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	yhzq_tggz@chinastock.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95551；400-888-8888
传真		021-50151582	010-80928078
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	北京市丰台区西营街8号院1号楼7至18层101
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路1318号9楼	北京市丰台区西营街8号院1号楼青海金融大厦
邮政编码		200121	100073
法定代表人		于业明	王晟

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	**报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）**
本期已实现收益	-4,761,587.43
本期利润	2,502,712.93
加权平均基金份额本期利润	0.0163
本期加权平均净值利润率	2.39%
本期基金份额净值增长率	1.19%
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	-60,146,342.14
期末可供分配基金份额利润	-0.4725
期末基金资产净值	89,760,154.26
期末基金份额净值	0.7052
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	-29.48%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

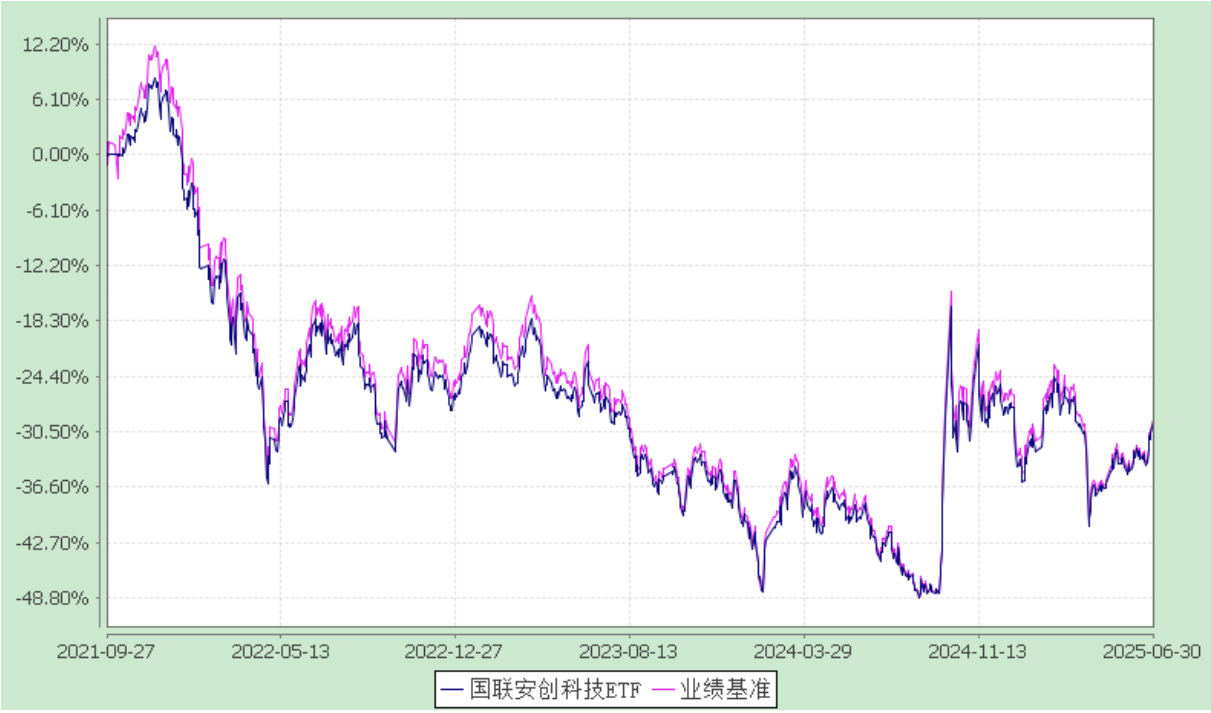
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	8.34%	1.11%	8.45%	1.15%	-0.11%	-0.04%
过去三个月	1.80%	2.04%	0.97%	2.10%	0.83%	-0.06%
过去六个月	1.19%	1.84%	-0.25%	1.89%	1.44%	-0.05%
过去一年	21.88%	2.56%	21.15%	2.63%	0.73%	-0.07%
过去三年	-13.05%	1.84%	-14.63%	1.92%	1.58%	-0.08%
自基金合同生效起至今	-29.48%	1.80%	-29.13%	1.89%	-0.35%	-0.09%

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

国联安创业板科技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

（2021 年 9 月 27 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：1、本基金业绩比较基准为创业板科技指数收益率；

2、本基金基金合同于 2021 年 9 月 27 日生效；

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	2021-09-27	-	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	2021-09-27	-	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》、《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规、法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 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%，创科技指数下跌 0.25%。

依据基金合同的约定，创科技 ETF 基金始终保持合理的仓位，采用完全复制的方法跟踪创科技指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.4.2 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 0.7052 元，本报告期份额净值增长率为 1.19%，同期业绩比较基准收益率为-0.25%。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽

的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金托管人根据《证券投资基金法》等有关法律法规的规定、基金合同和托管协议的约定，对本基金的基金资产净值计算以及利润分配等方面进行了复核审查，对本基金投资范围、投资比例限制、关联方交易、投资风格进行了监督。

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

本报告期内，本基金托管人依法复核国联安基金管理有限公司编制和披露的 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配、财务会计报告、投资组合报告等内容，以上内容真实、准确和完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联安创业板科技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	1,919,368.68	2,633,065.55
结算备付金		291.28	116,640.69
存出保证金		1,481.73	52,331.11
交易性金融资产	6.4.7.2	87,986,755.19	139,030,563.93
其中：股票投资		87,986,755.19	139,030,563.93
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		89,907,896.88	141,832,601.28
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		1,989.80	37,906.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		36,942.62	65,567.21
应付托管费		7,388.55	13,113.45
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	101,421.65	51,209.35
负债合计		147,742.62	167,796.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	127,280,565.00	203,280,565.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-37,520,410.74	-61,615,760.14
净资产合计		89,760,154.26	141,664,804.86
负债和净资产总计		89,907,896.88	141,832,601.28

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.7052 元，基金份额总额 127,280,565.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安创业板科技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		**2,902,573.42**	**-337,714.95**
1.利息收入		10,396.06	2,562.28
其中：存款利息收入	6.4.7.9	10,396.06	2,562.28
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）		-4,389,308.90	-547,423.53
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-5,275,097.69	-639,060.95
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	33,320.39	-
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	852,468.40	91,637.42
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	7,264,300.36	207,682.35
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	17,185.90	-536.05

减：二、营业总支出		**399,860.49**	**50,392.85**
1．管理人报酬		260,899.96	26,329.04
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2．托管费		52,180.01	5,265.93
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		0.07	-
8．其他费用	6.4.7.16	86,780.45	18,797.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**2,502,712.93**	**-388,107.80**
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**2,502,712.93**	**-388,107.80**
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		**2,502,712.93**	**-388,107.80**

6.3 净资产变动表

会计主体：国联安创业板科技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	203,280,565.00	-	-61,615,760.14	141,664,804.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	203,280,565.00	-	-61,615,760.14	141,664,804.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-76,000,000.00	-	24,095,349.40	-51,904,650.60
（一）、综合收益总额	-	-	2,502,712.93	2,502,712.93
（二）、本期基金份额交易产生的	-76,000,000.00	-	21,592,636.47	-54,407,363.53

净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	24,000,000.00	-	-8,192,069.02	15,807,930.98
2.基金赎回款	-100,000,000.00	-	29,784,705.49	-70,215,294.51
（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	127,280,565.00	-	-37,520,410.74	89,760,154.26
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	16,280,565.00	-	-5,851,454.49	10,429,110.51
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	16,280,565.00	-	-5,851,454.49	10,429,110.51
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00	-	-1,008,748.89	-1,008,748.89
（一）、综合收益总额	-	-	-388,107.80	-388,107.80
（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）	0.00	-	-620,641.09	-620,641.09
其中：1.基金申购款	161,000,000.00	-	-67,638,642.75	93,361,357.25
2.基金赎回款	-161,000,000.00	-	67,018,001.66	-93,981,998.34
（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	16,280,565.00	-	-6,860,203.38	9,420,361.62

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

国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金(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[2021]第 1936 号《关于准予国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金证券投资基金注册的批复》核准，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《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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 249,269,224.00 元(含募集股票市值)，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(2021)第 1014 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 9 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 249,280,565.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 11,341.00 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，基金托管人为中国银河证券股份有限公司(以下简称“中国银河证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，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)、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。本基金的业绩比较基准为：创业板科技指数收益率。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所“)深证上[2021]990 号文审核同意，本基金 249,280,565.00 份基金份额于 2021 年 10 月 18 日在深交所挂牌交易。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部 (以下简称“财政部”) 颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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 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基金净资产变动情况等有关信息。

6.4.4本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金在本报告期内无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财税[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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税 [2017] 2 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b)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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴

纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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	1,919,368.68
等于：本金	1,918,988.94
加：应计利息	379.74
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	1,919,368.68

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		91,306,932.10	-	87,986,755.19	-3,320,176.91
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	91,306,932.10	-	87,986,755.19	-3,320,176.91

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金无衍生金融资产/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从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本报告期末本基金无其他资产。

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	4,782.09
其中：交易所市场	4,782.09
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	27,273.08
预提信息披露费	59,507.37
ETF 申赎证券清算款	9,859.11
合计	101,421.65

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	203,280,565.00	203,280,565.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-100,000,000.00	-100,000,000.00
本期末	127,280,565.00	127,280,565.00

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	-89,844,136.68	28,228,376.54	-61,615,760.14
本期期初	-89,844,136.68	28,228,376.54	-61,615,760.14
本期利润	-4,761,587.43	7,264,300.36	2,502,712.93
本期基金份额交易产生的变动数	34,459,381.97	-12,866,745.50	21,592,636.47
其中：基金申购款	-10,842,128.75	2,650,059.73	-8,192,069.02
基金赎回款	45,301,510.72	-15,516,805.23	29,784,705.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,146,342.14	22,625,931.40	-37,520,410.74

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	10,271.12
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	65.53
其他	59.41
合计	10,396.06

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	-790,814.19
股票投资收益——赎回差价收入	-4,484,283.50
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	-5,275,097.69

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	12,759,302.55
减：卖出股票成本总额	13,537,045.40
减：交易费用	13,071.34
买卖股票差价收入	-790,814.19

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	70,215,294.51
减：现金支付赎回款总额	410,830.51
减：赎回股票成本总额	74,288,747.50
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,484,283.50

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	19.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	33,300.43
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	33,320.39

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	257,031.30
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	223,699.02
减：应计利息总额	21.57
减：交易费用	10.28
买卖债券差价收入	33,300.43

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内本基金无债券投资收益申购差价收入。

6.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内本基金无衍生工具投资收益。

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	852,468.40
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	852,468.40

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	7,264,300.36
——股票投资	7,264,300.36
——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	7,264,300.36

注：此处其他列示的是可退替代款公允价值变动损益。

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	17,185.90
合计	17,185.90

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	27,273.08
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	86,780.45

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国联安基金管理有限公司	基金管理人
中国银河证券股份有限公司（“银河证券”）	基金托管人、基金销售机构

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

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

金额单位：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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
银河证券	26,763,950.55	100.00%	13,843,450.00	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
银河证券	257,031.30	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
银河证券	4,975.45	100.00%	4,782.09	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
银河证券	12,956.01	100.00%	4,082.30	100.00%

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	260,899.96	26,329.04
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,573.92	204.45
应支付基金管理人的净管理费	257,326.04	26,124.59

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 0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.5%/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	52,180.01	5,265.93

注：支付基金托管人银河证券的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.1%/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

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 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
中国银河证券股份有限公司	1,919,368.68	10,271.12	640,507.75	2,207.77

注：本基金的银行存款由基金托管人银河证券转存于中国工商银行股份有限公司北京复兴门支行，按银行同业利率计息。本基金通过“银河证券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 日的相关余额为人民币 291.28 元。(2024 年 6 月 30 日：人民币 160.79 元）

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内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实施利润分配。

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

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

001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股锁定	12.80	28.05	64	819.20	1,795.20	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股锁定	5.30	14.44	313	1,658.90	4,519.72	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	183	1,354.20	3,698.43	-
001388	信通电子	2025-06-24	1 个月内（含）	新股待上市	16.42	16.42	421	6,912.82	6,912.82	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股待上市并锁定	16.42	16.42	47	771.74	771.74	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股锁定	12.08	18.12	79	954.32	1,431.48	-
001395	亚联机械	2025-01-20	6 个月	新股锁定	19.08	47.25	80	1,526.40	3,780.00	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股锁定	28.33	44.98	98	2,776.34	4,408.04	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股锁定	27.50	56.19	100	2,750.00	5,619.00	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股锁定	10.40	34.11	414	4,305.60	14,121.54	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6 个月（含）	新股锁定	-	77.87	23	-	1,791.01	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股锁定	41.90	77.87	58	2,430.20	4,516.46	-
301501	恒鑫生活	2025-06-06	1-6 个月（含）	新股锁定	-	45.22	27	-	1,220.94	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股锁定	39.92	45.22	60	2,395.20	2,713.20	-
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股锁定	4.92	18.99	479	2,356.68	9,096.21	-
301560	众捷汽车	2025-04-17	6 个月	新股锁定	16.50	27.45	90	1,485.00	2,470.50	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	20	1,792.00	2,789.60	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	100	1,705.00	2,910.00	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	新股锁定	11.80	33.85	319	3,764.20	10,798.15	-
30163	泽润	2025-0	6 个月	新股	33.06	47.46	53	1,752.	2,515.	-

6	新能	4-30		锁定				18	38	
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股锁定	11.80	22.98	213	2,513.40	4,894.74	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股锁定	26.60	82.50	76	2,021.60	6,270.00	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股锁定	10.27	22.39	219	2,249.13	4,903.41	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	128	1,638.40	5,701.12	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期根据交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

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，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，本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 0 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末本基金无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。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

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	1,919,368.68	-	-	-	-	-	1,919,368.68
结算备付金	291.28	-	-	-	-	-	291.28
存出保证金	1,481.73	-	-	-	-	-	1,481.73
交易性金融资产	-	-	-	-	-	87,986,755.19	87,986,755.19
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	1,921,141.69	-	-	-	-	87,986,755.19	89,907,896.88
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	1,989.80	1,989.80
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	36,942.62	36,942.62
应付托管费	-	-	-	-	-	7,388.55	7,388.55
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	101,421.65	101,421.65
负债总计	-	-	-	-	-	147,742.62	147,742.62
利率敏感度缺口	1,921,141.69	-	-	-	-	87,839,012.57	89,760,154.26
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	2,633,065.55	-	-	-	-	-	2,633,065.55
结算备付金	116,640.69	-	-	-	-	-	116,640.69
存出保证金	52,331.11	-	-	-	-	-	52,331.11
交易性金融资产	-	-	-	-	-	139,030,563.93	139,030,563.93
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	2,802,037.35	-	-	-	-	139,030,563.93	141,832,601.28
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算	-	-	-	-	-	37,906.41	37,906.41

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	65,567.21	65,567.21
应付托管费	-	-	-	-	-	13,113.45	13,113.45
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	51,209.35	51,209.35
负债总计	-	-	-	-	-	167,796.42	167,796.42
利率敏感度缺口	2,802,037.35	-	-	-	-	138,862,767.51	141,664,804.86

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，本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。本基金投资组合中投资于标的指数成份股及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	87,986,755.19	98.02	139,030,563.93	98.14
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	87,986,755.19	98.02	139,030,563.93	98.14

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的

		影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 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 4,368,893.12	增加 6,818,345.13
	业绩比较基准下降 5%	减少 4,368,893.12	减少 6,818,345.13

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	87,877,106.50	139,024,328.33
第二层次	7,684.56	-
第三层次	101,964.13	6,235.60
合计	87,986,755.19	139,030,563.93

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 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	87,986,755.19	97.86
	其中：股票	87,986,755.19	97.86
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	1,919,659.96	2.14
8	其他各项资产	1,481.73	0.00
9	合计	89,907,896.88	100.00

注：1、上表中的权益投资股票项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值；

2、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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	68,333,516.08	76.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,422,707.01	17.18
J	金融业	3,876,742.00	4.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	237,970.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	87,870,935.09	97.90

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	97,055.34	0.11

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	1,795.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	6,171.41	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	10,798.15	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	115,820.10	0.13

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	59,360	8,658,249.60	9.65
2	300750	宁德时代	33,880	8,545,213.60	9.52
3	300760	迈瑞医疗	35,400	7,956,150.00	8.86
4	300274	阳光电源	100,820	6,832,571.40	7.61
5	300014	亿纬锂能	86,900	3,980,889.00	4.44
6	300033	同花顺	14,200	3,876,742.00	4.32
7	300408	三环集团	86,500	2,889,100.00	3.22
8	300394	天孚通信	30,100	2,403,184.00	2.68

9	301236	软通动力	40,800	2,229,312.00	2.48
10	300661	圣邦股份	27,598	2,008,306.46	2.24
11	300418	昆仑万维	58,600	1,970,718.00	2.20
12	300207	欣旺达	93,400	1,873,604.00	2.09
13	300866	安克创新	14,790	1,680,144.00	1.87
14	300782	卓胜微	23,460	1,674,340.20	1.87
15	300458	全志科技	41,270	1,638,006.30	1.82
16	300454	深信服	16,800	1,582,224.00	1.76
17	301269	华大九天	12,400	1,536,112.00	1.71
18	300115	长盈精密	65,100	1,393,140.00	1.55
19	300496	中科创达	24,028	1,374,882.16	1.53
20	300253	卫宁健康	125,300	1,328,180.00	1.48
21	300832	新产业	22,800	1,293,216.00	1.44
22	300346	南大光电	40,596	1,284,457.44	1.43
23	300142	沃森生物	111,500	1,226,500.00	1.37
24	300627	华测导航	33,800	1,183,000.00	1.32
25	300316	晶盛机电	42,700	1,159,305.00	1.29
26	300674	宇信科技	37,900	1,147,991.00	1.28
27	300628	亿联网络	32,100	1,115,796.00	1.24
28	300568	星源材质	83,500	1,058,780.00	1.18
29	300377	赢时胜	39,250	1,018,537.50	1.13
30	300724	捷佳伟创	18,500	1,004,550.00	1.12
31	300672	国科微	10,600	900,152.00	1.00
32	300638	广和通	30,800	881,804.00	0.98
33	300751	迈为股份	10,288	715,633.28	0.80
34	300601	康泰生物	43,040	653,777.60	0.73
35	300113	顺网科技	32,800	648,128.00	0.72
36	300045	华力创通	33,200	633,788.00	0.71
37	300166	东方国信	57,800	630,020.00	0.70
38	300456	赛微电子	34,800	598,212.00	0.67
39	300624	万兴科技	9,559	593,135.95	0.66
40	300525	博思软件	37,940	552,406.40	0.62
41	300693	盛弘股份	17,300	518,308.00	0.58
42	300776	帝尔激光	9,200	489,532.00	0.55
43	300634	彩讯股份	17,600	476,960.00	0.53
44	300633	开立医疗	16,000	475,520.00	0.53
45	301165	锐捷网络	7,320	449,887.20	0.50
46	300482	万孚生物	19,000	405,650.00	0.45
47	300363	博腾股份	22,800	389,424.00	0.43
48	301589	诺瓦星云	2,500	363,325.00	0.40
49	300533	冰川网络	10,000	334,100.00	0.37
50	301096	百诚医药	5,300	237,970.00	0.27

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	301458	钧崴电子	414.00	14,121.54	0.02
2	301601	惠通科技	319.00	10,798.15	0.01
3	301535	浙江华远	479.00	9,096.21	0.01
4	001388	信通电子	468.00	7,684.56	0.01
5	301479	弘景光电	81.00	6,307.47	0.01
6	301662	宏工科技	76.00	6,270.00	0.01
7	001391	国货航	917.00	6,171.41	0.01
8	301678	新恒汇	128.00	5,701.12	0.01
9	301275	汉朔科技	100.00	5,619.00	0.01
10	301665	泰禾股份	219.00	4,903.41	0.01
11	301658	首航新能	213.00	4,894.74	0.01
12	001356	富岭股份	313.00	4,519.72	0.01
13	301173	毓恬冠佳	98.00	4,408.04	0.00
14	301501	恒鑫生活	87.00	3,934.14	0.00
15	001395	亚联机械	80.00	3,780.00	0.00
16	001382	新亚电缆	183.00	3,698.43	0.00
17	301595	太力科技	100.00	2,910.00	0.00
18	301590	优优绿能	20.00	2,789.60	0.00
19	301636	泽润新能	53.00	2,515.38	0.00
20	301560	众捷汽车	90.00	2,470.50	0.00
21	001335	信凯科技	64.00	1,795.20	0.00
22	001390	古麒绒材	79.00	1,431.48	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	300394	天孚通信	2,430,347.00	1.72
2	301236	软通动力	2,291,039.00	1.62
3	300207	欣旺达	1,820,828.00	1.29
4	300115	长盈精密	1,453,921.00	1.03
5	300308	中际旭创	923,137.00	0.65
6	300568	星源材质	894,682.00	0.63
7	300760	迈瑞医疗	728,861.00	0.51
8	300750	宁德时代	494,908.00	0.35
9	300482	万孚生物	441,299.00	0.31
10	300363	博腾股份	401,847.00	0.28

11	300274	阳光电源	380,869.00	0.27
12	300033	同花顺	331,450.00	0.23
13	300014	亿纬锂能	174,409.00	0.12
14	300672	国科微	100,384.00	0.07
15	301269	华大九天	59,325.00	0.04
16	300408	三环集团	53,614.00	0.04
17	300638	广和通	51,962.00	0.04
18	300661	圣邦股份	51,362.00	0.04
19	300624	万兴科技	48,031.00	0.03
20	300458	全志科技	45,615.00	0.03

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	300122	智飞生物	1,785,830.00	1.26
2	300003	乐普医疗	1,270,033.00	0.90
3	300009	安科生物	828,581.00	0.58
4	300685	艾德生物	517,488.00	0.37
5	300687	赛意信息	499,976.00	0.35
6	300866	安克创新	461,370.00	0.33
7	300454	深信服	447,203.00	0.32
8	300408	三环集团	396,998.00	0.28
9	300776	帝尔激光	382,539.00	0.27
10	301153	中科江南	339,187.00	0.24
11	300768	迪普科技	299,480.00	0.21
12	301165	锐捷网络	296,826.00	0.21
13	300782	卓胜微	290,078.00	0.20
14	301269	华大九天	280,135.00	0.20
15	300496	中科创达	268,627.00	0.19
16	300418	昆仑万维	266,761.00	0.19
17	300661	圣邦股份	208,273.00	0.15
18	301096	百诚医药	192,355.00	0.14
19	300674	宇信科技	191,554.00	0.14
20	300627	华测导航	188,358.00	0.13

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	14,433,052.80
卖出股票的收入（成交）总额	12,759,302.55

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，浙江核新同花顺网络信息股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到浙江证监局的处罚。

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	1,481.73
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	1,481.73

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本报告期末本基金未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301458	钧崴电子	14,121.54	0.02	新股锁定
2	301601	惠通科技	10,798.15	0.01	新股锁定
3	301535	浙江华远	9,096.21	0.01	新股锁定
4	001388	信通电子	6,912.82	0.01	新股待上市
4	001388	信通电子	771.74	0.00	新股待上市并锁定
5	301479	弘景光电	6,307.47	0.01	新股锁定

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
3,440	37,000.16	7,772,086.00	6.11%	119,508,479.00	93.89%

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	崔子欣	10,000,000.00	7.86%
2	三亚天泽酒店物业管理有限公司	4,000,000.00	3.14%
3	杨亚惠	2,093,400.00	1.64%
4	华泰证券股份有限公司	2,050,048.00	1.61%
5	程晓斌	2,000,000.00	1.57%
6	陈育南	1,904,200.00	1.50%
7	阮薇	1,694,900.00	1.33%
8	BARCLAYS BANK PLC	1,549,201.00	1.22%
9	吴立春	1,250,000.00	0.98%
10	梁英杰	1,086,800.00	0.85%

注：以上持有人信息由中国证券登记结算有限责任公司提供。

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（2021 年 9 月 27 日）基金份额总额	249,280,565.00
本报告期期初基金份额总额	203,280,565.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	100,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	127,280,565.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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未受到监管部门的稽查或处罚。

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	
中国银河证券股份有限公司	2	26,763,950.55	100.00%	4,975.45	100.00%	-

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

报告期内租用证券公司交易单元无变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	257,031.30	100.00%	-	-	-	-

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
2	国联安创业板科技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
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	国联安创业板科技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关于旗下部分基金增加国信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	2025-03-31
6	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
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	国联安创业板科技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
9	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金	规定网站、规定报刊、深	2025-05-15

	增加东吴证券为基金申购赎回代办券商的公告	圳证券交易所、上海证券交易所	
10	国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2025 年第 1 号）	规定网站、深圳证券交易所	2025-05-16
11	国联安创业板科技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
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
13	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东莞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	2025-06-25

11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

4、《国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

11.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

11.3 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