

国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金
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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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
1.2	目录	3
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	8
4	管理人报告	10
4.1	基金管理人及基金经理情况	10
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	14
5	托管人报告	14
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
6	半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1	资产负债表	14
6.2	利润表	15
6.3	净资产变动表	17
6.4	报表附注	18
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	51
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10	本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12	投资组合报告附注	53
8	基金份额持有人信息	54

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	55
9 开放式基金份额变动	56
10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	56
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	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	57
10.8 其他重大事件	58
11 备查文件目录	59
11.1 备查文件目录	59
11.2 存放地点	59
11.3 查阅方式	59

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	国联安沪深 300 指数增强	
基金主代码	020220	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 23 日	
基金管理人	国联安基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	205,432,272.61 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	020220	020221
报告期末下属分级基金的份额总额	151,536,755.10 份	53,895,517.51 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，通过量化策略精选个股增强并优化指数组合管理和风险控制，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。
投资策略	<p>本基金将运用指数化的投资方法，通过研究标的指数成份股的构成及其权重确定本基金投资组合的基本构成和大致占比，并通过控制投资组合中成份股对标的指数权重的偏离，控制跟踪误差，从而达成对标的指数的跟踪目标。</p> <p>本基金在对标的指数进行有效跟踪的基础上，运用数量化的策略体系构建投资组合，主要包括多因子选股策略、事件驱动策略和风险优化等策略。同时，基金管理人通过事中监控、事后调整等手段优化组合交易并严格控制组合风险，力争获取超越业绩比较基准的超额收益，追求基金资产的长期增值。</p>
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%

风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时，本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	方圆
	联系电话	021-38992888	95559
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95559
传真		021-50151582	021-62701216
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		200121	200336
法定代表人		于业明	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金中期报告备置地点	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国联安基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路

		1318 号 9 楼
--	--	------------

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）	
	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
本期已实现收益	6,554,577.27	2,722,210.07
本期利润	5,343,770.07	1,795,978.80
加权平均基金份额本期利润	0.0359	0.0290
本期加权平均净值利润率	3.00%	2.43%
本期基金份额净值增长率	3.02%	2.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
期末可供分配利润	30,358,778.38	10,607,460.18
期末可供分配基金份额利润	0.2003	0.1968
期末基金资产净值	188,429,428.81	66,823,394.61
期末基金份额净值	1.2435	1.2399
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)	
	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	24.35%	23.99%

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，包含停牌股票按公允价值调整的影响。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国联安沪深 300 指数增强 A

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	3.75%	0.54%	2.37%	0.55%	1.38%	-0.01%
过去三个月	3.00%	1.10%	1.21%	1.04%	1.79%	0.06%
过去六个月	3.02%	0.98%	0.07%	0.97%	2.95%	0.01%
过去一年	18.81%	1.30%	13.12%	1.32%	5.69%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	24.35%	1.15%	21.24%	1.19%	3.11%	-0.04%

国联安沪深 300 指数增强 C

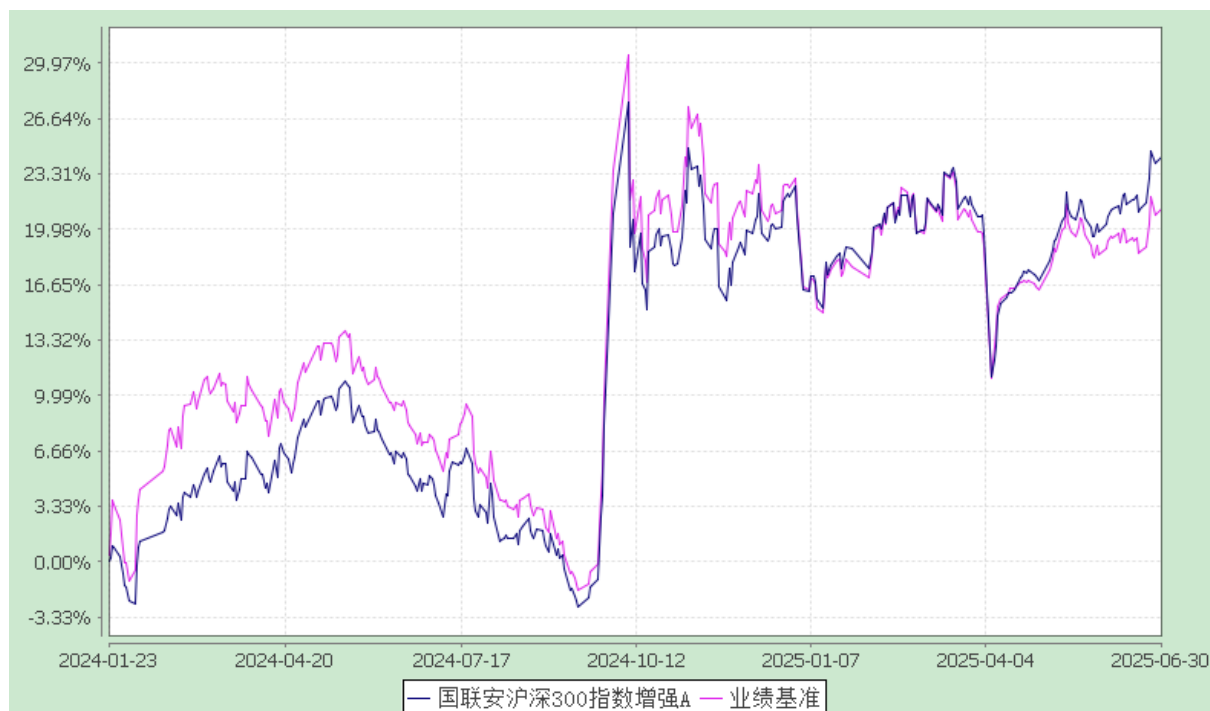
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	3.72%	0.54%	2.37%	0.55%	1.35%	-0.01%
过去三个月	2.95%	1.10%	1.21%	1.04%	1.74%	0.06%
过去六个月	2.91%	0.98%	0.07%	0.97%	2.84%	0.01%
过去一年	18.57%	1.30%	13.12%	1.32%	5.45%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	23.99%	1.15%	21.24%	1.19%	2.75%	-0.04%

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

国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024 年 1 月 23 日至 2025 年 6 月 30 日)

国联安沪深 300 指数增强 A

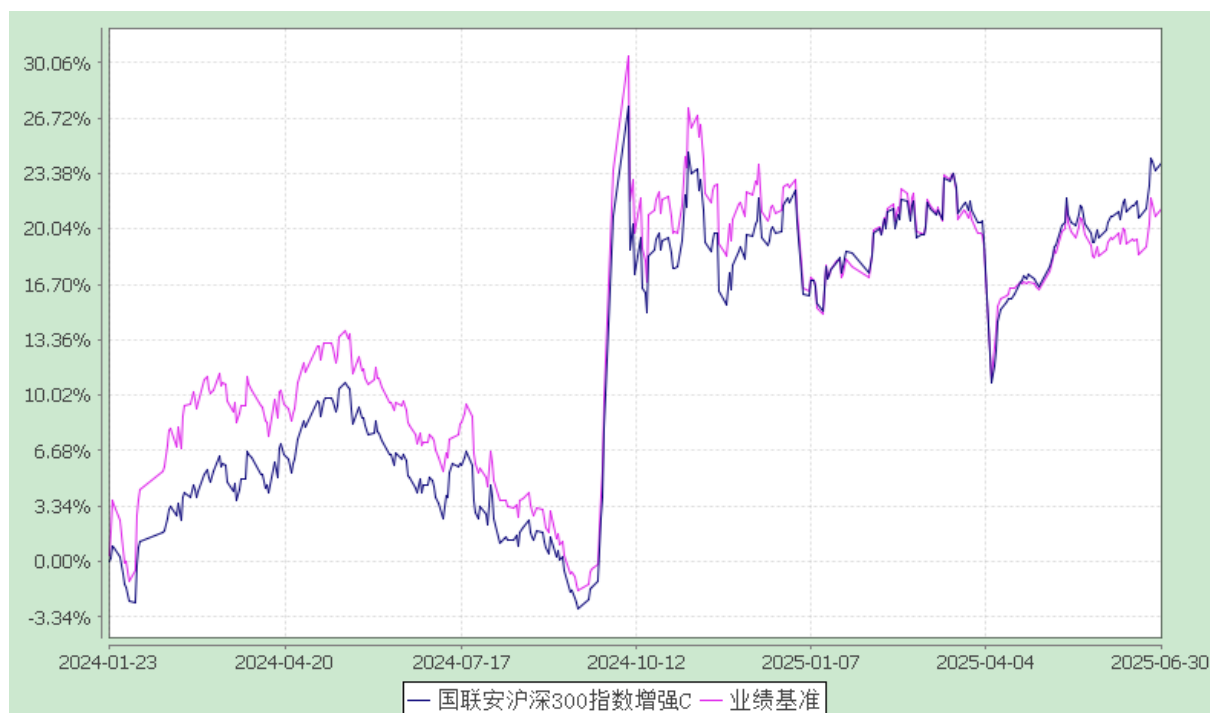


注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%；

2、本基金基金合同于 2024 年 1 月 23 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。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

国联安沪深 300 指数增强 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 2024 年 1 月 23 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。本基金建仓期结束距本报告期末不满一年，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成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
章榭元	基金经理、量化投资部总经理	2024-01-23	-	17 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。
--	--	--	--	--	---

- 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；
- 3、冯雪女士自 2025 年 7 月 30 日起担任此基金的基金经理（2025 年 7 月 31 日公告）。

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
章榭元	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》、《国联安沪深 300 指数增强型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，总体来看，沪深 300 指数上涨 0.03%，中证 500 指数上涨 3.31%，中证 1000 指数上涨 6.69%，中证 2000 指数上涨 15.24%，市场呈现上涨态势，小盘股表现明显强于大盘股。一季度，deepseek 横空出世带来中国人工智能的历史性发展机遇，人形机器人产业发展迎来重大突破，A 股科技成长风格表现强势，传统周期行业较为低迷。二季度初，特朗普关税政策的冲击导致市场大

幅下挫，前期表现亮眼的科技成长板块跌幅较大。随着关税战缓和及国内经济政策频出，A 股重回上涨态势，小盘成长风格领涨。在投资管理上，我们坚持定量与定性相结合的价值投资理念，精选优质股票，努力获取超额收益率。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，国联安沪深 300 指数增强 A 的份额净值为 1.2435 元，国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值为 1.2399 元。本报告期内，国联安沪深 300 指数增强 A 的份额净值增长率为 3.02%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%；国联安沪深 300 指数增强 C 的份额净值增长率为 2.91%，同期业绩比较基准收益率为 0.07%。

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 2025 年下半年，经济层面，政策将持续发力稳增长，利率有望维持在相对低位，为市场提供宽松的资金环境。海外局势也有望缓和，降低外部不确定性。A 股有望迎来业绩回升，企业盈利改善将支撑市场上行。从板块来看，科技成长板块仍极具潜力，随着技术的不断成熟与应用拓展，智能驾驶、机器人、AI 芯片等细分领域将迎来更多发展机遇，有望成为市场的热门投资方向。对于传统行业，“反内卷”带来的落后产能退出和技术升级亦存在投资机遇。我们将紧密跟踪市场动态，把握相关的投资机会，持续以定量与定性结合的价值投资理念，挖掘优质股票，力求为投资者创造丰厚回报。

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，本基金本报告期末进行利润分配，符合本基金基金合同的相关规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期内，国联安基金管理有限公司国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由国联安基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	39,127,044.43	12,805,641.29
结算备付金		870,889.41	705,728.83
存出保证金		-	1,559,764.80
交易性金融资产	6.4.7.2	239,703,686.00	216,152,480.37
其中：股票投资		239,703,686.00	216,152,480.37
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		71,519.88	15,918,057.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		279,773,139.72	247,141,672.58
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		24,208,547.36	704,314.20
应付管理人报酬		173,792.20	158,022.00
应付托管费		21,724.03	19,752.77
应付销售服务费		10,957.01	15,200.51
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	105,295.70	150,000.00
负债合计		24,520,316.30	1,047,289.48
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	205,432,272.61	204,008,084.89
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	49,820,550.81	42,086,298.21
净资产合计		255,252,823.42	246,094,383.10
负债和净资产总计		279,773,139.72	247,141,672.58

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，A 类基金的份额净值 1.2435 元，C 类基金的份额净值 1.2399 元，基金份额总额 205,432,272.61 份，其中 A 类基金的份额总额 151,536,755.10 份，C 类基金的份额总额 53,895,517.51 份。

6.2 利润表

会计主体：国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金

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 23 日（基 金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		8,422,621.09	12,271,745.02
1.利息收入		35,000.04	113,047.82
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,000.04	113,047.82
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）		10,523,726.86	14,346,573.39
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,252,151.02	11,761,338.15
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-1,094,425.59	-14,983.84
股利收益	6.4.7.13	3,366,001.43	2,600,219.08
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	-2,137,038.47	-2,191,181.25
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	932.66	3,305.06
减：二、营业总支出		1,282,872.22	1,014,362.69
1. 管理人报酬		999,915.45	758,231.89
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		124,989.33	94,778.99
3. 销售服务费		73,664.88	86,932.61
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	84,302.56	74,419.20
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		7,139,748.87	11,257,382.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		7,139,748.87	11,257,382.33

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		7,139,748.87	11,257,382.33

6.3 净资产变动表

会计主体：国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金

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	204,008,084.89	-	42,086,298.21	246,094,383.10
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	204,008,084.89	-	42,086,298.21	246,094,383.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,424,187.72	-	7,734,252.60	9,158,440.32
（一）、综合收益总额	-	-	7,139,748.87	7,139,748.87
（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）	1,424,187.72	-	594,503.73	2,018,691.45
其中：1.基金申购款	72,025,735.77	-	15,372,257.87	87,397,993.64
2.基金赎回款	-70,601,548.05	-	-14,777,754.14	-85,379,302.19
（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	205,432,272.61	-	49,820,550.81	255,252,823.42

项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 23 日（基金合同生效日）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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	258,628,266.52	-	-	258,628,266.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,310,935.31	-	10,267,096.70	-26,043,838.61
（一）、综合收益总额	-	-	11,257,382.33	11,257,382.33
（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）	-36,310,935.31	-	-990,285.63	-37,301,220.94
其中：1.基金申购款	82,002,423.81	-	5,228,999.48	87,231,423.29
2.基金赎回款	-118,313,359.12	-	-6,219,285.11	-124,532,644.23
（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	222,317,331.21	-	10,267,096.70	232,584,427.91

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

国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2638 号《关于准予国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由国联安基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 258,586,760.81 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2024)第 0029 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2024 年 1 月 23 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 258,628,266.52 基金份额,其中认购资金利息折合 41,505.71 份基金份额。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)。

根据《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式等的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别的基金资产中计提销售服务费的,称为 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认购/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国联安沪深 300 指数增强型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的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 80%-95%,其中投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%;每个交易日日终,在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例不低于基金资产净值的 5%,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金中期财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 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

本报告期内本基金无会计政策和会计估计变更, 未发生过会计差错。

6.4.6 税项

根据财税[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	24,482,381.24
等于：本金	24,481,972.12
加：应计利息	409.12
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	14,644,663.19
等于：本金	14,644,349.15
加：应计利息	314.04
合计	39,127,044.43

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		228,550,834.52	-	239,703,686.00	11,152,851.48
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		228,550,834.52	-	239,703,686.00	11,152,851.48

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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他	20,993.14
预提审计费	24,795.19
预提信息披露费	59,507.37
合计	105,295.70

6.4.7.7 实收基金

国联安沪深300指数增强A

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	131,728,060.92	131,728,060.92
本期申购	54,190,933.63	54,190,933.63
本期赎回（以“-”号填列）	-34,382,239.45	-34,382,239.45
本期末	151,536,755.10	151,536,755.10

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

国联安沪深300指数增强C

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	72,280,023.97	72,280,023.97
本期申购	17,834,802.14	17,834,802.14
本期赎回（以“-”号填列）	-36,219,308.60	-36,219,308.60

本期末	53,895,517.51	53,895,517.51
-----	---------------	---------------

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

国联安沪深300指数增强A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,413,858.76	6,867,715.40	27,281,574.16
本期期初	20,413,858.76	6,867,715.40	27,281,574.16
本期利润	6,554,577.27	-1,210,807.20	5,343,770.07
本期基金份额交易产生的 变动数	3,390,342.35	876,987.13	4,267,329.48
其中：基金申购款	9,786,023.34	2,175,595.46	11,961,618.80
基金赎回款	-6,395,680.99	-1,298,608.33	-7,694,289.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	30,358,778.38	6,533,895.33	36,892,673.71

国联安沪深300指数增强C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	11,040,724.81	3,763,999.24	14,804,724.05
本期期初	11,040,724.81	3,763,999.24	14,804,724.05
本期利润	2,722,210.07	-926,231.27	1,795,978.80
本期基金份额交易产生的 变动数	-3,155,474.70	-517,351.05	-3,672,825.75
其中：基金申购款	3,033,083.05	377,556.02	3,410,639.07
基金赎回款	-6,188,557.75	-894,907.07	-7,083,464.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,607,460.18	2,320,416.92	12,927,877.10

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	4,579.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	23,199.58
结算备付金利息收入	7,221.37
其他	-
合计	35,000.04

注：此处其他存款利息收入列示的是券商保证金利息收入。

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	478,428,268.53
减：卖出股票成本总额	469,675,441.47
减：交易费用	500,676.04
买卖股票差价收入	8,252,151.02

6.4.7.11 债券投资收益

本报告期内本基金无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股指期货投资收益	-1,094,425.59

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	3,366,001.43
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	3,366,001.43

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	-2,329,638.47
——股票投资	-2,329,638.47
——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	192,600.00
——权证投资	-
——期货投资	192,600.00
4.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	-2,137,038.47

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	811.62
转换费收入	121.04
合计	932.66

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	24,795.19
信息披露费	59,507.37

证券出借违约金	-
合计	84,302.56

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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	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
国联安基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

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的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月23日（基金合同 生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	999,915.45	758,231.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	180,622.17	170,974.31
应支付基金管理人的净管理费	819,293.28	587,257.58

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 0.80% 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 × 0.80% / 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23日（基金合同 生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	124,989.33	94,778.99

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

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安沪深 300 指数 增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C	合计
国联安基金管理有限 公司	-	1.07	1.07
交通银行	-	244.62	244.62
合计	-	245.69	245.69
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024年1月23日（基金合同生效日）至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国联安沪深300指数 增强A	国联安沪深300指数增强 C	合计
国联安基金管理有限	-	0.07	0.07

公司			
交通银行	-	1,086.58	1,086.58
合计	-	1,086.65	1,086.65

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未与关联方通过银行间同业市场进行债券(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，本基金管理人均未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

国联安沪深300指数增强A

份额单位：份

关联方名称	国联安沪深300指数增强A本期末 2025年6月30日		国联安沪深300指数增强A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
太平洋资产管理有 限责任公司	17,847,999.63	11.78%	17,847,999.63	13.55%

国联安沪深300指数增强C

本报告期末和上年度末，除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金 C 类份额。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年6月30日	2024年1月23日（基金合同生效

			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
交通银行股份有限公司	24,482,381.24	4,579.09	13,803,546.77	62,816.00

注：本基金的银行存款由基金托管人交通银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无须作说明的其他关联交易事项。

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
688411	海博思创	2025-01-20	6 个月	新股锁定	19.38	83.49	422	8,178.36	35,232.78	-
688775	影石创新	2025-06-04	6 个月	新股锁定	47.27	124.16	203	9,595.81	25,204.48	-
688583	思看科技	2025-01-08	6 个月	新股锁定	33.46	79.68	175	5,855.50	13,944.00	-
688545	兴福电子	2025-01-15	6 个月	新股锁定	11.68	26.95	671	7,837.28	18,083.45	-
301458	钧崴电子	2025-01-02	6 个月	新股锁定	10.40	34.11	526	5,470.40	17,941.86	-
301678	新恒汇	2025-06-13	6 个月	新股锁定	12.80	44.54	371	4,748.80	16,524.34	-
301602	超研股份	2025-01-15	6 个月	新股锁定	6.70	24.80	658	4,408.60	16,318.40	-
301479	弘景光电	2025-05-28	1-6 个月内(含)	新股锁定	0.00	77.87	50	-	3,893.50	-
301501	恒鑫生活	2025-06-06	1-6 个月内	新股锁定	0.00	45.22	61	-	2,758.42	-

			(含)							
301535	浙江华远	2025-03-18	6 个月	新股锁定	4.92	18.99	734	3,611.28	13,938.66	-
688757	胜科纳米	2025-03-18	6 个月	新股锁定	9.08	25.94	536	4,866.88	13,903.84	-
001388	信通电子	2025-06-24	1-6 个月内 (含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
301479	弘景光电	2025-03-06	6 个月	新股锁定	41.90	77.87	125	5,237.50	9,733.75	-
688758	赛分科技	2025-01-02	6 个月	新股锁定	4.32	16.97	777	3,356.64	13,185.69	-
301662	宏工科技	2025-04-10	6 个月	新股锁定	26.60	82.50	143	3,803.80	11,797.50	-
301601	惠通科技	2025-01-08	6 个月	新股锁定	11.80	33.85	342	4,035.60	11,576.70	-
301658	首航新能	2025-03-26	6 个月	新股锁定	11.80	22.98	437	5,156.60	10,042.26	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6 个月	新股锁定	12.30	54.45	172	2,115.60	9,365.40	-
301501	恒鑫生活	2025-03-11	6 个月	新股锁定	39.92	45.22	136	5,429.12	6,149.92	-
301665	泰禾股份	2025-04-02	6 个月	新股锁定	10.27	22.39	393	4,036.11	8,799.27	-
301590	优优绿能	2025-05-28	6 个月	新股锁定	89.60	139.48	59	5,286.40	8,229.32	-
001356	富岭股份	2025-01-16	6 个月	新股锁定	5.30	14.44	561	2,973.30	8,100.84	-
688583	思看科技	2025-06-19	1-6 个月内 (含)	新股锁定	0.00	79.68	52	-	4,143.36	-
688755	汉邦科技	2025-05-09	6 个月	新股锁定	22.77	39.33	203	4,622.31	7,983.99	-
301173	毓恬冠佳	2025-02-24	6 个月	新股锁定	28.33	44.98	173	4,901.09	7,781.54	-
001382	新亚电缆	2025-03-13	6 个月	新股锁定	7.40	20.21	366	2,708.40	7,396.86	-
301636	泽润新能	2025-04-30	6 个月	新股锁定	33.06	47.46	128	4,231.68	6,074.88	-
301275	汉朔科技	2025-03-04	6 个月	新股锁定	27.50	56.19	103	2,832.50	5,787.57	-
301595	太力科技	2025-05-12	6 个月	新股锁定	17.05	29.10	196	3,341.80	5,703.60	-
30156	众捷	2025-0	6 个月	新股	16.50	27.45	190	3,135.	5,215.	-

0	汽车	4-17		锁定				00	50	
603049	中策橡胶	2025-05-27	6 个月	新股锁定	46.50	42.85	116	5,394.00	4,970.60	-
603210	泰鸿万立	2025-04-01	6 个月	新股锁定	8.60	15.61	286	2,459.60	4,464.46	-
603124	江南新材	2025-03-12	6 个月	新股锁定	10.54	46.31	88	927.52	4,075.28	-
603014	威高血净	2025-05-12	6 个月	新股锁定	26.50	32.68	123	3,259.50	4,019.64	-
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	-
603202	天有为	2025-04-16	6 个月	新股锁定	93.50	90.66	37	3,459.50	3,354.42	-
001390	古麒绒材	2025-05-21	6 个月	新股锁定	12.08	18.12	178	2,150.24	3,225.36	-
603257	中国瑞林	2025-03-28	6 个月	新股锁定	20.52	37.47	78	1,600.56	2,922.66	-
603409	汇通控股	2025-02-25	6 个月	新股锁定	24.18	33.32	80	1,934.40	2,665.60	-
603400	华之杰	2025-06-12	6 个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6 个月	新股锁定	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
001335	信凯科技	2025-04-02	6 个月	新股锁定	12.80	28.05	80	1,024.00	2,244.00	-
603120	肯特催化	2025-04-09	6 个月	新股锁定	15.00	33.43	65	975.00	2,172.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6 个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本报告期末，除完全按照有关指数的构成比例进行证券投资的开放式基金以及中国证监会认定的特殊投资组合以外，本基金管理人管理的全部开放式基金持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票未超过该上市公司可流通股票的 30%。本基金参与转融通证券出借交易的资产不得超过基金资产净值的 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	39,127,044.43	-	-	-	-	-	39,127,044.43
结算备付金	870,889.41	-	-	-	-	-	870,889.41
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	-	-	-	-	-	239,703,686.00	239,703,686.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-

应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	71,519.88	71,519.88
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	39,997,933.84	-	-	-	-	239,775,205.88	279,773,139.72
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	24,208,547.36	24,208,547.36
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	173,792.20	173,792.20
应付托管费	-	-	-	-	-	21,724.03	21,724.03
应付销售服务费	-	-	-	-	-	10,957.01	10,957.01
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	105,295.70	105,295.70
负债总计	-	-	-	-	-	24,520,316.30	24,520,316.30
利率敏感度缺口	39,997,933.84	-	-	-	-	215,254,889.58	255,252,823.42
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	12,805,641.29	-	-	-	-	-	12,805,641.29
结算备付金	705,728.83	-	-	-	-	-	705,728.83
存出保证	1,559,76	-	-	-	-	-	1,559,764.80

金	4.80						
交易性金融资产	-	-	-	-	-	216,152,480.37	216,152,480.37
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	15,918,057.29	15,918,057.29
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	15,071,134.92	-	-	-	-	232,070,537.66	247,141,672.58
负债							
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	704,314.20	704,314.20
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	158,022.00	158,022.00
应付托管费	-	-	-	-	-	19,752.77	19,752.77
应付销售服务费	-	-	-	-	-	15,200.51	15,200.51
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	1,047,289.48	1,047,289.48
利率敏感度缺口	15,071,134.92	-	-	-	-	231,023,248.18	246,094,383.10

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进行了分类。

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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金所持有的股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 80%-95%, 其中投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后, 本基金保持的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。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		上年度末	
	2025 年 6 月 30 日		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	239,703,686.00	93.91	216,152,480.37	87.83
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	239,703,686.00	93.91	216,152,480.37	87.83

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 12,717,947.29	增加 11,542,053.42
	业绩比较基准下降 5%	减少 12,717,947.29	减少 11,542,053.42

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	239,320,745.69	215,622,565.67
第二层次	15,385.54	21,069.90
第三层次	367,554.77	508,844.80
合计	239,703,686.00	216,152,480.37

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工具。

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	239,703,686.00	85.68
	其中：股票	239,703,686.00	85.68
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	39,997,933.84	14.30
8	其他各项资产	71,519.88	0.03
9	合计	279,773,139.72	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
----	------	---------	--------------

A	农、林、牧、渔业	2,452,400.00	0.96
B	采矿业	9,033,504.00	3.54
C	制造业	100,860,573.62	39.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,147,804.00	2.41
E	建筑业	4,336,861.00	1.70
F	批发和零售业	56,504.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,725,716.44	2.24
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,416,963.00	2.91
J	金融业	58,689,058.56	22.99
K	房地产业	45,360.00	0.02
L	租赁和商务服务业	765,694.00	0.30
M	科学研究和技术服务业	2,928,055.00	1.15
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	223,392.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	198,681,885.62	77.84

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 （%）
A	农、林、牧、渔业	30,740.00	0.01

B	采矿业	743,890.00	0.29
C	制造业	24,827,261.20	9.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,452,460.00	0.96
E	建筑业	549,143.00	0.22
F	批发和零售业	1,168,535.00	0.46
G	交通运输、仓储和邮政业	1,465,248.00	0.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,535,105.98	0.99
J	金融业	4,382,382.00	1.72
K	房地产业	1,352,290.00	0.53
L	租赁和商务服务业	152,022.00	0.06
M	科学研究和技术服务业	28,403.20	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	1,334,320.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	41,021,800.38	16.07

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净
----	------	------	-------	------	--------

					值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	7,700	10,853,304.00	4.25
2	300750	宁德时代	29,600	7,465,712.00	2.92
3	600036	招商银行	135,400	6,221,630.00	2.44
4	601318	中国平安	107,865	5,984,350.20	2.34
5	000333	美的集团	66,000	4,765,200.00	1.87
6	600030	中信证券	145,200	4,010,424.00	1.57
7	600276	恒瑞医药	67,600	3,508,440.00	1.37
8	601166	兴业银行	146,800	3,426,312.00	1.34
9	600900	长江电力	112,600	3,393,764.00	1.33
10	601899	紫金矿业	173,700	3,387,150.00	1.33
11	002594	比亚迪	9,200	3,053,572.00	1.20
12	300059	东方财富	131,500	3,041,595.00	1.19
13	601288	农业银行	505,800	2,974,104.00	1.17
14	688981	中芯国际	33,451	2,949,374.67	1.16
15	603259	药明康德	42,100	2,928,055.00	1.15
16	600919	江苏银行	245,000	2,925,300.00	1.15
17	600887	伊利股份	102,100	2,846,548.00	1.12
18	601398	工商银行	362,900	2,754,411.00	1.08
19	000725	京东方 A	648,400	2,587,116.00	1.01
20	300502	新易盛	20,300	2,578,506.00	1.01
21	688256	寒武纪	3,772	2,268,858.00	0.89
22	600016	民生银行	474,800	2,255,300.00	0.88
23	002714	牧原股份	52,400	2,201,324.00	0.86
24	601668	中国建筑	361,800	2,087,586.00	0.82
25	600031	三一重工	116,000	2,082,200.00	0.82
26	601229	上海银行	192,900	2,046,669.00	0.80
27	000858	五粮液	17,100	2,033,190.00	0.80
28	601988	中国银行	345,300	1,940,586.00	0.76
29	601919	中远海控	128,400	1,931,136.00	0.76
30	002371	北方华创	4,000	1,768,840.00	0.69
31	600050	中国联通	330,900	1,767,006.00	0.69
32	601766	中国中车	238,200	1,676,928.00	0.66
33	002463	沪电股份	39,000	1,660,620.00	0.65
34	603993	洛阳钼业	195,400	1,645,268.00	0.64
35	600000	浦发银行	118,197	1,640,574.36	0.64
36	000063	中兴通讯	48,000	1,559,520.00	0.61
37	000651	格力电器	34,100	1,531,772.00	0.60
38	603288	海天味业	39,100	1,521,381.00	0.60
39	603501	豪威集团	11,900	1,519,035.00	0.60
40	000425	徐工机械	194,400	1,510,488.00	0.59
41	601658	邮储银行	275,500	1,506,985.00	0.59
42	601600	中国铝业	213,500	1,503,040.00	0.59

43	000977	浪潮信息	29,100	1,480,608.00	0.58
44	600926	杭州银行	88,000	1,480,160.00	0.58
45	000538	云南白药	25,560	1,425,992.40	0.56
46	002475	立讯精密	40,200	1,394,538.00	0.55
47	601995	中金公司	39,000	1,379,040.00	0.54
48	603799	华友钴业	37,200	1,377,144.00	0.54
49	688008	澜起科技	16,490	1,352,180.00	0.53
50	601688	华泰证券	75,300	1,341,093.00	0.53
51	000776	广发证券	79,300	1,333,033.00	0.52
52	600183	生益科技	44,000	1,326,600.00	0.52
53	601901	方正证券	164,000	1,297,240.00	0.51
54	688041	海光信息	9,063	1,280,511.27	0.50
55	600989	宝丰能源	79,200	1,278,288.00	0.50
56	002736	国信证券	109,800	1,264,896.00	0.50
57	300124	汇川技术	19,200	1,239,744.00	0.49
58	002001	新和成	56,800	1,208,136.00	0.47
59	600176	中国巨石	104,300	1,189,020.00	0.47
60	600066	宇通客车	47,000	1,168,420.00	0.46
61	601800	中国交建	129,900	1,154,811.00	0.45
62	600011	华能国际	160,800	1,148,112.00	0.45
63	600219	南山铝业	294,000	1,126,020.00	0.44
64	601816	京沪高铁	189,400	1,089,050.00	0.43
65	600958	东方证券	106,600	1,031,888.00	0.40
66	601628	中国人寿	24,500	1,009,155.00	0.40
67	000895	双汇发展	41,300	1,008,133.00	0.39
68	300999	金龙鱼	34,100	1,006,973.00	0.39
69	002648	卫星化学	57,600	998,208.00	0.39
70	600660	福耀玻璃	16,300	929,263.00	0.36
71	000157	中联重科	125,100	904,473.00	0.35
72	300274	阳光电源	13,300	901,341.00	0.35
73	601169	北京银行	131,600	898,828.00	0.35
74	601857	中国石油	103,000	880,650.00	0.35
75	601989	中国重工	189,700	880,208.00	0.34
76	600690	海尔智家	34,600	857,388.00	0.34
77	002230	科大讯飞	17,700	847,476.00	0.33
78	601138	工业富联	37,900	810,302.00	0.32
79	601916	浙商银行	237,000	803,430.00	0.31
80	002352	顺丰控股	16,400	799,664.00	0.31
81	600406	国电南瑞	35,300	791,073.00	0.31
82	000100	TCL 科技	182,400	789,792.00	0.31
83	002236	大华股份	48,100	763,828.00	0.30
84	000166	申万宏源	151,700	761,534.00	0.30
85	601818	光大银行	182,300	756,545.00	0.30
86	601225	陕西煤业	38,900	748,436.00	0.29

87	600362	江西铜业	31,900	747,417.00	0.29
88	600460	士兰微	30,100	747,082.00	0.29
89	601728	中国电信	93,100	721,525.00	0.28
90	601009	南京银行	61,900	719,278.00	0.28
91	300760	迈瑞医疗	3,200	719,200.00	0.28
92	000708	中信特钢	60,300	709,128.00	0.28
93	002920	德赛西威	6,900	704,697.00	0.28
94	600018	上港集团	123,300	704,043.00	0.28
95	300014	亿纬锂能	14,900	682,569.00	0.27
96	688111	金山办公	2,400	672,120.00	0.26
97	600875	东方电气	39,200	656,208.00	0.26
98	601088	中国神华	16,000	648,640.00	0.25
99	600547	山东黄金	19,800	632,214.00	0.25
100	300628	亿联网络	18,100	629,156.00	0.25
101	600015	华夏银行	76,500	605,115.00	0.24
102	300408	三环集团	18,000	601,200.00	0.24
103	600160	巨化股份	20,900	599,412.00	0.23
104	600019	宝钢股份	88,900	585,851.00	0.23
105	601319	中国人保	65,000	566,150.00	0.22
106	605499	东鹏饮料	1,800	565,290.00	0.22
107	601868	中国能建	231,600	516,468.00	0.20
108	601788	光大证券	28,600	514,228.00	0.20
109	601898	中煤能源	46,000	503,240.00	0.20
110	601066	中信建投	20,500	493,025.00	0.19
111	603296	华勤技术	5,900	476,012.00	0.19
112	688012	中微公司	2,600	473,980.00	0.19
113	000001	平安银行	38,800	468,316.00	0.18
114	003816	中国广核	128,200	466,648.00	0.18
115	600039	四川路桥	46,300	458,370.00	0.18
116	002600	领益智造	52,800	453,552.00	0.18
117	300308	中际旭创	3,100	452,166.00	0.18
118	002938	鹏鼎控股	13,700	438,811.00	0.17
119	600999	招商证券	24,000	422,160.00	0.17
120	601111	中国国航	52,500	414,225.00	0.16
121	000999	华润三九	12,476	390,249.28	0.15
122	601127	赛力斯	2,900	389,528.00	0.15
123	600027	华电国际	70,200	383,994.00	0.15
124	601888	中国中免	6,000	365,820.00	0.14
125	600377	宁沪高速	22,900	351,286.00	0.14
126	600941	中国移动	3,100	348,905.00	0.14
127	002142	宁波银行	12,400	339,264.00	0.13
128	001289	龙源电力	20,200	326,836.00	0.13
129	600809	山西汾酒	1,800	317,502.00	0.12
130	600309	万华化学	5,800	314,708.00	0.12

131	002415	海康威视	11,200	310,576.00	0.12
132	603019	中科曙光	4,300	302,720.00	0.12
133	000792	盐湖股份	17,700	302,316.00	0.12
134	600346	恒力石化	20,900	298,034.00	0.12
135	600415	小商品城	13,300	275,044.00	0.11
136	601012	隆基绿能	17,800	267,356.00	0.10
137	600600	青岛啤酒	3,800	263,948.00	0.10
138	601872	招商轮船	41,700	261,042.00	0.10
139	300498	温氏股份	14,700	251,076.00	0.10
140	600188	兖矿能源	18,700	227,579.00	0.09
141	300015	爱尔眼科	17,900	223,392.00	0.09
142	600674	川投能源	13,200	211,728.00	0.08
143	600028	中国石化	36,700	206,988.00	0.08
144	603986	兆易创新	1,500	189,795.00	0.07
145	000338	潍柴动力	12,200	187,636.00	0.07
146	601006	大秦铁路	25,100	165,660.00	0.06
147	601985	中国核电	16,900	157,508.00	0.06
148	601939	建设银行	16,600	156,704.00	0.06
149	600111	北方稀土	5,700	141,930.00	0.06
150	601077	渝农商行	19,100	136,374.00	0.05
151	600104	上汽集团	8,300	133,215.00	0.05
152	002027	分众传媒	17,100	124,830.00	0.05
153	600150	中国船舶	3,600	117,144.00	0.05
154	000938	紫光股份	4,300	103,157.00	0.04
155	302132	中航成飞	1,100	96,734.00	0.04
156	601808	中海油服	6,400	88,064.00	0.03
157	600436	片仔癀	400	80,004.00	0.03
158	002050	三花智控	3,000	79,140.00	0.03
159	688271	联影医疗	600	76,644.00	0.03
160	600585	海螺水泥	3,100	66,557.00	0.03
161	000625	长安汽车	5,200	66,352.00	0.03
162	600938	中国海油	2,500	65,275.00	0.03
163	600089	特变电工	5,300	63,229.00	0.02
164	600905	三峡能源	13,900	59,214.00	0.02
165	002311	海大集团	1,000	58,590.00	0.02
166	601998	中信银行	6,800	57,800.00	0.02
167	000963	华东医药	1,400	56,504.00	0.02
168	300033	同花顺	200	54,602.00	0.02
169	300433	蓝思科技	2,400	53,520.00	0.02
170	601117	中国化学	6,900	52,923.00	0.02
171	600760	中航沈飞	900	52,758.00	0.02
172	002709	天赐材料	2,800	50,736.00	0.02
173	605117	德业股份	900	47,394.00	0.02
174	600048	保利发展	5,600	45,360.00	0.02

175	600482	中国动力	1,900	43,833.00	0.02
176	601825	沪农商行	4,300	41,710.00	0.02
177	601390	中国中铁	6,100	34,221.00	0.01
178	601618	中国中冶	10,900	32,482.00	0.01
179	002241	歌尔股份	1,300	30,316.00	0.01
180	601336	新华保险	500	29,250.00	0.01
181	000596	古井贡酒	200	26,630.00	0.01
182	600085	同仁堂	500	18,030.00	0.01
183	001391	国货航	1,428	9,610.44	0.00
184	000301	东方盛虹	800	6,664.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	603659	璞泰来	54,900.00	1,031,022.00	0.40
2	300476	胜宏科技	5,900.00	792,842.00	0.31
3	000423	东阿阿胶	14,900.00	779,270.00	0.31
4	002948	青岛银行	148,100.00	737,538.00	0.29
5	002056	横店东磁	51,500.00	728,725.00	0.29
6	002487	大金重工	20,500.00	674,450.00	0.26
7	001389	广合科技	11,037.00	648,644.49	0.25
8	603236	移远通信	7,300.00	626,340.00	0.25
9	601311	骆驼股份	67,100.00	605,913.00	0.24
10	688692	达梦数据	2,682.00	597,790.98	0.23
11	688208	道通科技	19,413.00	594,037.80	0.23
12	002007	华兰生物	37,900.00	593,893.00	0.23
13	603612	索通发展	32,100.00	589,998.00	0.23
14	601991	大唐发电	185,800.00	588,986.00	0.23
15	002993	奥海科技	14,200.00	588,874.00	0.23
16	002434	万里扬	79,500.00	582,735.00	0.23
17	600728	佳都科技	105,700.00	576,065.00	0.23
18	000623	吉林敖东	33,900.00	574,605.00	0.23
19	600064	南京高科	74,100.00	571,311.00	0.22
20	001301	尚太科技	11,700.00	570,492.00	0.22
21	002532	天山铝业	68,600.00	570,066.00	0.22
22	002249	大洋电机	86,400.00	568,512.00	0.22
23	603218	日月股份	44,500.00	564,705.00	0.22
24	002233	塔牌集团	74,800.00	553,520.00	0.22
25	600909	华安证券	94,500.00	550,935.00	0.22
26	000030	富奥股份	93,300.00	549,537.00	0.22
27	002081	金螳螂	160,100.00	549,143.00	0.22
28	600583	海油工程	100,300.00	547,638.00	0.21

29	000019	深粮控股	81,900.00	545,454.00	0.21
30	000650	仁和药业	100,500.00	544,710.00	0.21
31	600578	京能电力	120,100.00	539,249.00	0.21
32	603565	中谷物流	56,400.00	538,620.00	0.21
33	001227	兰州银行	212,500.00	531,250.00	0.21
34	601860	紫金银行	176,500.00	529,500.00	0.21
35	600757	长江传媒	56,900.00	528,032.00	0.21
36	600335	国机汽车	81,300.00	524,385.00	0.21
37	600750	江中药业	24,000.00	523,920.00	0.21
38	601801	皖新传媒	76,700.00	523,861.00	0.21
39	600021	上海电力	59,500.00	523,005.00	0.20
40	601678	滨化股份	126,200.00	522,468.00	0.20
41	000537	中绿电	61,200.00	511,632.00	0.20
42	003006	百亚股份	16,700.00	457,246.00	0.18
43	002516	旷达科技	69,000.00	355,350.00	0.14
44	600166	福田汽车	129,500.00	350,945.00	0.14
45	688183	生益电子	6,400.00	327,680.00	0.13
46	603486	科沃斯	5,600.00	326,088.00	0.13
47	002414	高德红外	31,700.00	324,925.00	0.13
48	002624	完美世界	21,300.00	323,121.00	0.13
49	300803	指南针	4,000.00	322,640.00	0.13
50	301316	慧博云通	7,400.00	318,792.00	0.12
51	300570	太辰光	3,300.00	318,054.00	0.12
52	300496	中科创达	5,500.00	314,710.00	0.12
53	603609	禾丰股份	38,000.00	313,880.00	0.12
54	603766	隆鑫通用	24,400.00	311,344.00	0.12
55	002244	滨江集团	31,900.00	311,025.00	0.12
56	300207	欣旺达	15,500.00	310,930.00	0.12
57	300573	兴齐眼药	6,000.00	310,740.00	0.12
58	600038	中直股份	8,000.00	310,480.00	0.12
59	603529	爱玛科技	9,000.00	309,600.00	0.12
60	601777	千里科技	36,300.00	308,187.00	0.12
61	601298	青岛港	35,400.00	307,626.00	0.12
62	601727	上海电气	41,500.00	306,685.00	0.12
63	002939	长城证券	36,500.00	305,870.00	0.12
64	600012	皖通高速	18,000.00	305,640.00	0.12
65	601456	国联民生	29,500.00	305,325.00	0.12
66	000783	长江证券	43,800.00	303,534.00	0.12
67	603235	天新药业	11,100.00	302,919.00	0.12
68	600884	杉杉股份	32,000.00	302,720.00	0.12
69	603586	金麒麟	16,400.00	300,448.00	0.12
70	000750	国海证券	72,900.00	300,348.00	0.12
71	601555	东吴证券	34,300.00	300,125.00	0.12
72	300474	景嘉微	4,100.00	299,300.00	0.12

73	603858	步长制药	18,200.00	295,568.00	0.12
74	002603	以岭药业	20,800.00	293,280.00	0.11
75	600663	陆家嘴	31,900.00	282,634.00	0.11
76	601233	桐昆股份	26,200.00	277,720.00	0.11
77	600487	亨通光电	17,400.00	266,220.00	0.10
78	002217	合力泰	97,600.00	262,544.00	0.10
79	601216	君正集团	47,300.00	261,096.00	0.10
80	600221	海航控股	192,800.00	258,352.00	0.10
81	600285	羚锐制药	9,300.00	210,831.00	0.08
82	300101	振芯科技	9,100.00	205,933.00	0.08
83	688578	艾力斯	2,200.00	204,688.00	0.08
84	600256	广汇能源	32,600.00	196,252.00	0.08
85	000600	建投能源	27,700.00	191,407.00	0.07
86	300133	华策影视	25,100.00	188,501.00	0.07
87	002317	众生药业	12,400.00	186,124.00	0.07
88	600685	中船防务	6,400.00	174,016.00	0.07
89	300017	网宿科技	15,100.00	161,872.00	0.06
90	600862	中航高科	5,900.00	153,872.00	0.06
91	600246	万通发展	23,900.00	146,029.00	0.06
92	002384	东山精密	3,800.00	143,526.00	0.06
93	000877	天山股份	23,500.00	109,040.00	0.04
94	600057	厦门象屿	14,900.00	104,747.00	0.04
95	600299	安迪苏	10,300.00	99,395.00	0.04
96	001308	康冠科技	4,100.00	92,742.00	0.04
97	688065	凯赛生物	1,800.00	84,780.00	0.03
98	002595	豪迈科技	1,300.00	76,986.00	0.03
99	605080	浙江自然	2,600.00	72,280.00	0.03
100	002905	金逸影视	7,700.00	71,456.00	0.03
101	600398	海澜之家	8,500.00	59,160.00	0.02
102	601519	大智慧	5,600.00	57,064.00	0.02
103	002670	国盛金控	3,600.00	54,180.00	0.02
104	300972	万辰集团	300.00	54,072.00	0.02
105	000785	居然智家	15,500.00	47,275.00	0.02
106	002925	盈趣科技	2,500.00	44,950.00	0.02
107	300777	中简科技	1,200.00	43,500.00	0.02
108	603233	大参林	2,600.00	42,380.00	0.02
109	601677	明泰铝业	3,400.00	42,228.00	0.02
110	600866	星湖科技	6,100.00	42,151.00	0.02
111	600499	科达制造	4,300.00	42,140.00	0.02
112	002563	森马服饰	8,000.00	42,080.00	0.02
113	002202	金风科技	4,100.00	42,025.00	0.02
114	002881	美格智能	900.00	41,760.00	0.02
115	002489	浙江永强	11,400.00	41,724.00	0.02
116	002408	齐翔腾达	9,300.00	41,664.00	0.02

117	002267	陕天然气	5,500.00	41,635.00	0.02
118	600780	通宝能源	7,000.00	41,510.00	0.02
119	002314	南山控股	15,700.00	41,291.00	0.02
120	003022	联泓新科	2,600.00	41,158.00	0.02
121	600020	中原高速	8,600.00	41,108.00	0.02
122	000987	越秀资本	5,900.00	40,474.00	0.02
123	002958	青农商行	11,100.00	40,071.00	0.02
124	000889	中嘉博创	10,200.00	36,822.00	0.01
125	688411	海博思创	422.00	35,232.78	0.01
126	300548	长芯博创	500.00	33,385.00	0.01
127	000672	上峰水泥	4,000.00	31,600.00	0.01
128	605296	神农集团	1,000.00	30,740.00	0.01
129	603081	大丰实业	2,500.00	27,050.00	0.01
130	688775	影石创新	203.00	25,204.48	0.01
131	600063	皖维高新	5,000.00	22,900.00	0.01
132	603103	横店影视	1,400.00	22,470.00	0.01
133	603730	岱美股份	3,460.00	19,687.40	0.01
134	688583	思看科技	227.00	18,087.36	0.01
135	688545	兴福电子	671.00	18,083.45	0.01
136	301458	钧崑电子	526.00	17,941.86	0.01
137	301678	新恒汇	371.00	16,524.34	0.01
138	301602	超研股份	658.00	16,318.40	0.01
139	001388	信通电子	937.00	15,385.54	0.01
140	601619	嘉泽新能	4,200.00	15,036.00	0.01
141	600315	上海家化	700.00	14,749.00	0.01
142	301535	浙江华远	734.00	13,938.66	0.01
143	688757	胜科纳米	536.00	13,903.84	0.01
144	001872	招商港口	700.00	13,902.00	0.01
145	301479	弘景光电	175.00	13,627.25	0.01
146	688758	赛分科技	777.00	13,185.69	0.01
147	301662	宏工科技	143.00	11,797.50	0.00
148	301601	惠通科技	342.00	11,576.70	0.00
149	301658	首航新能	437.00	10,042.26	0.00
150	603072	天和磁材	172.00	9,365.40	0.00
151	301501	恒鑫生活	197.00	8,908.34	0.00
152	301665	泰禾股份	393.00	8,799.27	0.00
153	600169	太原重工	3,600.00	8,712.00	0.00
154	301590	优优绿能	59.00	8,229.32	0.00
155	001356	富岭股份	561.00	8,100.84	0.00
156	688755	汉邦科技	203.00	7,983.99	0.00
157	301173	毓恬冠佳	173.00	7,781.54	0.00
158	001382	新亚电缆	366.00	7,396.86	0.00
159	301636	泽润新能	128.00	6,074.88	0.00
160	301275	汉朔科技	103.00	5,787.57	0.00

161	301595	太力科技	196.00	5,703.60	0.00
162	301560	众捷汽车	190.00	5,215.50	0.00
163	603049	中策橡胶	116.00	4,970.60	0.00
164	603210	泰鸿万立	286.00	4,464.46	0.00
165	603124	江南新材	88.00	4,075.28	0.00
166	603014	威高血净	123.00	4,019.64	0.00
167	001395	亚联机械	80.00	3,780.00	0.00
168	600928	西安银行	900.00	3,528.00	0.00
169	603202	天有为	37.00	3,354.42	0.00
170	001390	古麒绒材	178.00	3,225.36	0.00
171	603257	中国瑞林	78.00	2,922.66	0.00
172	603409	汇通控股	80.00	2,665.60	0.00
173	603400	华之杰	57.00	2,497.17	0.00
174	603382	海阳科技	105.00	2,350.95	0.00
175	001335	信凯科技	80.00	2,244.00	0.00
176	603120	肯特催化	65.00	2,172.95	0.00
177	301113	雅艺科技	40.00	836.40	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	600519	贵州茅台	4,884,979.00	1.99
2	300750	宁德时代	4,614,483.00	1.88
3	600036	招商银行	4,300,522.00	1.75
4	600030	中信证券	4,079,845.00	1.66
5	601398	工商银行	3,892,551.00	1.58
6	000425	徐工机械	3,637,546.00	1.48
7	600276	恒瑞医药	3,620,938.87	1.47
8	688981	中芯国际	3,592,708.73	1.46
9	002463	沪电股份	3,564,693.00	1.45
10	601229	上海银行	3,550,111.00	1.44
11	601288	农业银行	3,502,388.00	1.42
12	000333	美的集团	3,410,693.00	1.39
13	688008	澜起科技	3,243,067.83	1.32
14	600050	中国联通	3,242,926.00	1.32
15	000001	平安银行	3,236,056.00	1.31
16	600016	民生银行	3,112,436.00	1.26
17	000977	浪潮信息	3,048,772.00	1.24

18	300408	三环集团	3,041,736.00	1.24
19	600031	三一重工	2,954,632.00	1.20
20	603993	洛阳钼业	2,864,145.00	1.16

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	601288	农业银行	4,070,831.00	1.65
2	601899	紫金矿业	3,817,397.00	1.55
3	601398	工商银行	3,765,903.00	1.53
4	603986	兆易创新	3,696,304.00	1.50
5	601229	上海银行	3,658,161.00	1.49
6	002230	科大讯飞	3,553,841.00	1.44
7	688008	澜起科技	3,451,129.92	1.40
8	000333	美的集团	3,442,302.00	1.40
9	300750	宁德时代	3,426,975.00	1.39
10	600036	招商银行	3,376,398.00	1.37
11	601318	中国平安	3,367,173.00	1.37
12	300433	蓝思科技	3,333,522.00	1.35
13	000001	平安银行	3,099,193.00	1.26
14	000166	申万宏源	3,065,443.00	1.25
15	002463	沪电股份	2,997,155.00	1.22
16	600660	福耀玻璃	2,966,400.20	1.21
17	002241	歌尔股份	2,956,425.00	1.20
18	600031	三一重工	2,943,814.00	1.20
19	601225	陕西煤业	2,918,151.00	1.19
20	600585	海螺水泥	2,913,793.00	1.18

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	495,556,285.57
卖出股票收入（成交）总额	478,428,268.53

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末本基金未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本报告期末本基金未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本报告期末本基金未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本报告期末本基金未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本报告期末本基金未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金将在风险可控的前提下，本着谨慎原则，以套期保值为目的，适度参与股指期货投资。通过对现货市场和期货市场运行趋势的研究，结合基金股票组合的实际情况及对股指期货的估值水平、基差水平、流动性等因素的分析，选择合适的股指期货合约构建相应的头寸，以调整投资组合的风险暴露，降低系统性风险。基金还将利用股指期货作为组合流动性管理工具，降低现货市场流动性不足导致的冲击成本过高的风险，提高基金的建仓或变现效率。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资政策。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本报告期末本基金未持有国债期货，没有相关投资评价。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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。中信证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到浙江证监局、深圳证券交易所、上海证券交易所、深圳证监局、江苏证监局、陕西证监局、北京证券交易所监管执行部、贵州证监局的处罚。兴业银行股份有限公司在报

告编制日前一年内曾受到海南证监局、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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	71,519.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	71,519.88

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

本报告期末本基金前五名积极投资中不存在流通受限情况。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
国联安沪深 300 指数增强 A	1,039	145,848.66	128,155,130.90	84.57%	23,381,624.20	15.43%
国联安沪深 300 指数增强 C	769	70,085.20	14,560,702.61	27.02%	39,334,814.90	72.98%
合计	1,808	113,624.04	142,715,833.51	69.47%	62,716,439.10	30.53%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	国联安沪深 300 指数增强 A	292,322.79	0.19%
	国联安沪深 300 指数增强 C	19.17	0.00%
	合计	292,341.96	0.14%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	国联安沪深 300 指数增强 A	10~50
	国联安沪深 300 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国联安沪深 300 指数增强 A	0
	国联安沪深 300 指数增强 C	0

	强 C	
	合计	0

注：截止本报告期末，本基金基金经理持有本开放式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

项目	国联安沪深 300 指数增强 A	国联安沪深 300 指数增强 C
基金合同生效日（2024 年 1 月 23 日）基金份额总额	124,092,565.57	134,535,700.95
本报告期期初基金份额总额	131,728,060.92	72,280,023.97
本报告期基金总申购份额	54,190,933.63	17,834,802.14
减：本报告期基金总赎回份额	34,382,239.45	36,219,308.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	151,536,755.10	53,895,517.51

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

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内未发生基金投资策略的改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内基金未有改聘为其审计的会计师事务所的情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未有受监管部门稽查或处罚的情形发生。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的 比例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
西南证券股份有限公司	2	972,505,848.26	100.00%	199,107.53	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测试并考察后，确定拟合作证券经营机构，并与其签订证券经纪服务协议。若证券经营机构不再符合上述标准的，经与基金托管人协商后，基金管理人可与其中止合作。

三、报告期内使用证券经营机构交易单元的变更情况

本报告期内使用证券经营机构交易单元情况无变化。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中邮证券为销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2025-01-02
2	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销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2025-01-03
3	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	规定网站	2025-01-22
4	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
5	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	规定网站	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
8	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加邮储银行为销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2025-04-09
9	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
10	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025-04-22
11	国联安基金管理有限公司关于旗下国联安沪	规定网站、规定报刊	2025-05-07

	深 300 指数增强型证券投资基金增加浦发银行为销售机构的公告		
12	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金（A 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2025-05-16
13	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金（C 份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2025-05-16
14	国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书更新（2025 年第 1 号）	规定网站	2025-05-16
15	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华创证券为销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2025-06-09
16	国联安基金管理有限公司关于终止民商基金销售（上海）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2025-06-18

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沪深 300 指数增强型证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照
- 7、中国证监会要求的其他文件

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