# 国联安国证ESG300交易型开放式指数证券投资基金
# 2026年中期报告

2026年6月30日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：上海银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

# §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。

基金托管人上海银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了报告中的财务指标、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 2026 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 ..... 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 ..... 11
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 ..... 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
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 ..... 12

**§5 托管人报告 ..... 12**

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 ..... 12
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 ..... 13
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 ..... 13

**§6 半年度财务会计报告（未经审计） ..... 13**

6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 14
6.3 净资产变动表 ..... 15
6.4 报表附注 ..... 17

**§7 投资组合报告 ..... 35**

7.1 期末基金资产组合情况 ..... 35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 35
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 ..... 36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 45
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 ..... 45

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 ..... 45
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 ..... 45
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 ..... 45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 45
7.12 投资组合报告附注 ..... 45

**§8 基金份额持有人信息 ..... 46**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 46
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情况 ..... 47

**§9 开放式基金份额变动 ..... 47**

**§10 重大事件揭示 ..... 47**

10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 47
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 ..... 47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 47
10.4 基金投资策略的改变 ..... 47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 48
10.8 其他重大事件 ..... 50

**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 52**

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 ..... 52

**§12 备查文件目录 ..... 53**

12.1 备查文件目录 ..... 53
12.2 存放地点 ..... 53
12.3 查阅方式 ..... 53

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | |
|---|---|
| 基金名称 | 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 国联安 ESG300ETF |
| 场内简称 | ESG300ETF 国联安 |
| 基金主代码 | 159653 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2023 年 3 月 6 日 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 上海银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 55,972,068.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2023 年 3 月 24 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 0.2%以内，年化跟踪误差控制在 2%以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。<br>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括抽样复制在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股或增发；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）其他可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。<br>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股、成份股个股衍生品等进行替代。 |
| 业绩比较基准 | 国证 ESG300 指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 |

## 2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---|---|---|
| 名称 | 国联安基金管理有限公司 | 上海银行股份有限公司 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李露 | 周直毅 |
| | 联系电话 | 021-38992888 | 021-68475608 |
| | 电子邮箱 | customer.service@cpicfunds.com | custody@bosc.cn |
| 客户服务电话 | | 021-38784766/4007000365 | 95594 |
| 传真 | | 021-50151582 | 021-68476901 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼 | 上海市黄浦区中山南路 688 号 |
| 办公地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 168 号 37 层 |
| 邮政编码 | | 200121 | 200120 |
| 法定代表人 | | 于业明 | 顾建忠 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 上海证券报、深交所网站 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.cpicfunds.com |
| 基金中期报告置备地点 | 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(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日) |
|---|---|
| 本期已实现收益 | 1,958,349.43 |
| 本期利润 | 3,290,827.42 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0591 |
| 本期加权平均净值利润率 | 4.79% |
| 本期基金份额净值增长率 | 5.07% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | 3,677,080.66 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0657 |
| 期末基金资产净值 | 70,771,871.76 |
| 期末基金份额净值 | 1.2644 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2026 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 26.44% |

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，包含停牌股票按公允价值调整的影响；

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

3、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

（报告期：2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）

| 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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 8.59% | 1.23% | 8.14% | 1.26% | 0.45% | -0.03% |
| 过去六个月 | 5.07% | 1.12% | 4.60% | 1.15% | 0.47% | -0.03% |
| 过去一年 | 27.67% | 1.02% | 26.62% | 1.05% | 1.05% | -0.03% |
| 过去三年 | 31.93% | 1.08% | 26.20% | 1.13% | 5.73% | -0.05% |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去七年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去十年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 26.44% | 1.05% | 16.62% | 1.10% | 9.82% | -0.05% |

### 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




注：1、本基金业绩比较基准为国证 ESG300 指数收益率；

2、本基金基金合同于 2023 年 3 月 6 日生效；

3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月，建仓期结束时各项资产配置符合合同约定。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 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 | | |
| 黄欣 | 基金经理 | 2023 年 3 月 6 日 | - | 24 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)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 月至 2025 年 9 月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；2025 年 9月起兼任国联安中证A500红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月起兼任国联安恒生港股通科技主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。 |
| 章椹元 | 基金经理、量化投资部总经理 | 2023 年 3 月 6 日 | - | 18 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、国联安沪深 300 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 月至 2025 年 9 月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；2025 年 8 月起兼任国联安上证科创板综合指数增强型证券投资基金的基金经理；2025 年 9 月起兼任国联安中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2025 年 11 月起兼任国联安恒生港股通科技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 | 17 | 41,544,545,428.95 | 2020 年 5 月 6 日 |
| | 私募资产管理计划 | 5 | 24,666,924,468.65 | 2024 年 9 月 2 日 |
| | 其他组合 | - | - | - |
| | 合计 | 22 | 66,211,469,897.60 | - |

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量未发现有超过该证券当日成交量 5%的情况。公平交易制度总体执行情况良好。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现存在可能导致不公平交易和利益输送的无法解释的异常交易行为。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，国际方面，美国、以色列与伊朗之间的战争爆发，中东再次陷入战乱之中，随着地区形势的进展，原油等大宗商品价格出现大幅的上涨及回调，未来战争走势、何时结束难以预测。

国内方面，以半导体为代表的科技股出现大幅上涨，而消费、地产等传统行业表现不尽人意，股市两极分化效应明显。未来地产低迷、消费信心不足仍是宏观调控需要解决的重要问题。

上半年股市分化较大，创业板、科技类的股票表现相对较好，消费医药等传统板块的股票表现相对落后。上半年沪深 300 指数上涨 7.55%，中证 A100 指数上涨 8.47%，创业板综指上涨 24.15%，ESG300 指数上涨 4.6%。

依据基金合同的约定，ESG300ETF 基金始终保持合理的仓位，采用完全复制的方法跟踪 ESG300 指数，将跟踪误差控制在合理范围。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 1.2644 元，本报告期份额净值增长率为 5.07%，同期业绩比较基准收益率为 4.60%。

## 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，虽然科技股在 7 月出现了较大的回调，未来高科技领域依旧是中国与西方国家竞争的重中之重，值得长期关注。相信在中央的相应政策之下，国内消费、房地产行业预计会逐步复苏，相应的板块也或将存在投资机会。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司成立估值委员会，对估值业务总体负责。估值委员会由公司负责营运相关领导、运营部、权益投资部、现金管理部、固定收益部、专户投资部、交易部、量化投资部、研究部、监察稽核部和风险管理部部门负责人组成，并根据业务分工履行相应的职责，所有成员都具备丰富的专业能力和估值经验，参与估值流程各方不存在重大利益冲突。基金经理不直接参与估值决策，估值决策由估值委员会成员 1/2 以上多数票通过，估值决策由公司总经理签署后生效。对于估值政策，公司和基金托管银行有充分沟通，积极商讨达成一致意见；对于估值结果，公司和基金托管银行有详细的核对流程，达成一致意见后才能对外披露。会计师事务所认可公司基金估值的政策和流程的适当性与合理性。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

## 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

# §5 托管人报告

## 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

报告期内，本基金的利润分配情况符合有关法律法规和基金合同的相关约定。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为复核内容真实、准确、完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

# §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 2,191,996.63 | 3,112,651.94 |
| 结算备付金 | | - | 42,621.99 |
| 存出保证金 | | 10,276.97 | 4,061.26 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 68,658,480.18 | 61,154,211.82 |
| 其中：股票投资 | | 68,658,480.18 | 61,154,211.82 |
| 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 | | 70,860,753.78 | 64,313,547.01 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2025 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 28,778.19 | 26,996.23 |
| 应付托管费 | | 3,453.37 | 3,239.53 |
| 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 | 56,650.46 | 535,936.54 |
| 负债合计 | | 88,882.02 | 566,172.30 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 55,972,068.00 | 52,972,068.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 14,799,803.76 | 10,775,306.71 |
| 净资产合计 | | 70,771,871.76 | 63,747,374.71 |
| 负债和净资产总计 | | 70,860,753.78 | 64,313,547.01 |

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2644 元，基金份额总额 55,972,068.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 3,535,877.48 | 307,371.29 |
| 1.利息收入 | | 5,897.64 | 5,744.27 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 5,897.64 | 5,744.27 |
| 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） | | 2,215,729.90 | 903,716.09 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 1,459,340.58 | 79,644.79 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | 1,712.97 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 收益 | | | |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.13 | 756,389.32 | 822,358.33 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 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 | 1,332,477.99 | -628,523.23 |
| 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 | -18,228.05 | 26,434.16 |
| **减：二、营业总支出** | | 245,050.06 | 214,977.30 |
| 1. 管理人报酬 | | 170,057.29 | 138,772.27 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | | 20,406.80 | 16,652.66 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.16 | 54,585.97 | 59,552.37 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | 3,290,827.42 | 92,393.99 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 3,290,827.42 | 92,393.99 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 3,290,827.42 | 92,393.99 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净 | 52,972,068.00 | - | 10,775,306.71 | 63,747,374.71 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 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 | 52,972,068.00 | - | 10,775,306.71 | 63,747,374.71 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | 3,000,000.00 | - | 4,024,497.05 | 7,024,497.05 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 3,290,827.42 | 3,290,827.42 |
| （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） | 3,000,000.00 | - | 733,669.63 | 3,733,669.63 |
| 其中：1.基金申购款 | 9,000,000.00 | - | 2,210,492.01 | 11,210,492.01 |
| 2.基金赎回款 | -6,000,000.00 | - | -1,476,822.38 | -7,476,822.38 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 55,972,068.00 | - | 14,799,803.76 | 70,771,871.76 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 58,972,068.00 | - | -815,645.66 | 58,156,422.34 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 二、本期期初净资产 | 58,972,068.00 | - | -815,645.66 | 58,156,422.34 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -3,000,000.00 | - | 276,263.03 | -2,723,736.97 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 92,393.99 | 92,393.99 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -3,000,000.00 | - | 183,869.04 | -2,816,130.96 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,000,000.00 | - | -120,984.06 | 2,879,015.94 |
| 2.基金赎回款 | -6,000,000.00 | - | 304,853.10 | -5,695,146.90 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 55,972,068.00 | - | -539,382.63 | 55,432,685.37 |

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：

| 唐华 | 蔡蓓蕾 | 仲晓峰 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]1537 号《关于准予国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由基金管理人国联安基金管理有限公司向社会公开发行募集。基金合同于 2023 年 3 月 6 日正式生效，首次设立募集规模 232,972,068.00

基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国联安基金管理有限公司，基金托管人为上海银行股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金主要投资于标的指数成份股和备选成份股。为更好地实现基金的投资目标，本基金还可投资于非成份股（包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务以及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述比例。

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

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本报告期内本基金无会计政策和会计估计变更，未发生过会计差错。

### 6.4.6 税项

（1） 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

（2） 增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、国家税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%的规定征收率计算缴纳增值税，公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入免征增值税；自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，金融同业往来利息收入免征增值税，金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入；取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税；本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为适用简易计税方法，按照 3%的征收率计算缴纳增值税；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

（3） 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》

及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

（4） 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（5） 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

（6） 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 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<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 2,191,996.63 |
| 等于：本金 | 2,191,584.83 |
| 加：应计利息 | 411.80 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 2,191,996.63 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 56,105,684.95 | - | 68,658,480.18 | 12,552,795.23 |
| 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 | | 56,105,684.95 | - | 68,658,480.18 | 12,552,795.23 |

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/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

本报告期末本基金未持有买入返售金融资产。

### 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

本报告期末本基金未持有其他资产。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 2,102.49 |
| 其中：交易所市场 | 2,102.49 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提信息披露费 | 39,671.58 |
| 预提审计费 | 14,876.39 |
| 合计 | 56,650.46 |

### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 52,972,068.00 | 52,972,068.00 |
| 本期申购 | 9,000,000.00 | 9,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -6,000,000.00 | -6,000,000.00 |
| 本期末 | 55,972,068.00 | 55,972,068.00 |

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | 1,610,348.76 | 9,164,957.95 | 10,775,306.71 |
| 本期期初 | 1,610,348.76 | 9,164,957.95 | 10,775,306.71 |
| 本期利润 | 1,958,349.43 | 1,332,477.99 | 3,290,827.42 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 108,382.47 | 625,287.16 | 733,669.63 |
| 其中：基金申购款 | 369,459.76 | 1,841,032.25 | 2,210,492.01 |
| 基金赎回款 | -261,077.29 | -1,215,745.09 | -1,476,822.38 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,677,080.66 | 11,122,723.10 | 14,799,803.76 |

### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 5,834.44 |
| 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 | 40.48 |
| 其他 | 22.72 |
| 合计 | 5,897.64 |

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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 641,890.92 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 817,449.66 |
| 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 | 1,459,340.58 |

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 7,787,124.37 |
| 减：卖出股票成本总额 | 7,136,498.15 |
| 减：交易费用 | 8,735.30 |
| 买卖股票差价收入 | 641,890.92 |

### 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<br>2026年1月1日至2026年6月30日 |
|---|---|
| 赎回基金份额对价总额 | 7,476,822.38 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 4,175,397.38 |
| 减：赎回股票成本总额 | 2,483,975.34 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | 817,449.66 |

### 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

本报告期内本基金无债券投资收益。

### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本报告期内本基金无买卖债券差价收入。

### 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收益。

### 6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 756,389.32 |
| 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 | 756,389.32 |

### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | 1,332,477.99 |
| ——股票投资 | 1,332,477.99 |
| ——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 | 1,332,477.99 |

### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | - |
| ETF 替代损益 | -18,228.05 |
| 合计 | -18,228.05 |

### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 14,876.39 |
| 信息披露费 | 39,671.58 |
| 证券出借违约金 | - |
| 银行汇划费用 | 38.00 |
| 合计 | 54,585.97 |

## 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，本基金无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方无变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 国联安基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 上海银行股份有限公司（“上海银行”） | 基金托管人 |
| 太平洋资产管理有限责任公司 （“太平洋资管”） | 基金管理人的股东 |
| 安联集团 | 基金管理人的股东 |
| 中国太平洋保险（集团）股份有限公司（“太保集团”） | 基金管理人的最终控制人 |
| 中国太平洋人寿保险股份有限公司（“太保人寿”） | 基金管理人的最终控制人控制的机构 |

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 6.4.10.1.2 债券交易

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交易。

##### 6.4.10.1.3 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。

##### 6.4.10.1.4 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。

##### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 170,057.29 | 138,772.27 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 337.06 | 10.58 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 169,720.23 | 138,761.69 |

注：支付基金管理人国联安基金管理有限公司的基金管理费按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 20,406.80 | 16,652.66 |

注：支付基金托管人上海银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.06%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费＝前一日基金资产净值×0.06%/当年天数。

### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未发生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，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

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2025年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的<br>基金份额 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的<br>比例（%） | 持有的<br>基金份额 | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比<br>例（%） |
| 太保人寿 | 50,668,900.00 | 90.53 | 50,668,900.00 | 95.65 |

### 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<br>2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2025年1月1日至2025年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 上海银行 | 2,191,996.63 | 5,834.44 | 1,545,753.94 | 5,718.28 |

注：本基金的银行存款由基金托管人上海银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。本基金通过“上海银行股份有限公司基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司的结算备付金，于 2026 年 06 月 30 日的相关余额为人民币 0.00 元。(2025 年 06 月 30 日：30,890.91 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，本基金均无其他关联交易事项。

### 6.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金未进行利润分配。

### 6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本报告期末本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本报告期末本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0 元，因此没有作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0.00 元，因此没有作为抵押的债券。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本报告期末，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金金融工具的风险主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

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

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

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

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2026 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%（2025 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 2026 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 2,191,996.63 | - | - | - | - | - | 2,191,996.63 |
| 结算备付金 | - | - | - | - | - | - | - |
| 存出保证金 | 10,276.97 | - | - | - | - | - | 10,276.97 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 68,658,480.18 | 68,658,480.18 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 2,202,273.60 | - | - | - | - | 68,658,480.18 | 70,860,753.78 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 28,778.19 | 28,778.19 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 3,453.37 | 3,453.37 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 56,650.46 | 56,650.46 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 88,882.02 | 88,882.02 |
| 利率敏感度缺口 | 2,202,273.60 | - | - | - | - | 68,569,598.16 | 70,771,871.76 |
| 上年度末 2025 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 | 3,112,651.94 | - | - | - | - | - | 3,112,651.94 |
| 结算备付金 | 42,621.99 | - | - | - | - | - | 42,621.99 |
| 存出保证金 | 4,061.26 | - | - | - | - | - | 4,061.26 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | - | - | 61,154,211.82 | 61,154,211.82 |
| 衍生金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收股利 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应收清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他资产 | - | - | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 3,159,335.19 | - | - | - | - | 61,154,211 | 64,313,547.0 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | | .82 | 1 |
| 负债 | | | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | - | 26,996.23 | 26,996.23 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | - | 3,239.53 | 3,239.53 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付投资顾问费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | - | - | 535,936.54 | 535,936.54 |
| 负债总计 | - | - | - | - | - | 566,172.30 | 566,172.30 |
| 利率敏感度缺口 | 3,159,335.19 | - | - | - | - | 60,588,039.52 | 63,747,374.71 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2026 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%（2025 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（2025 年 12 月 31 日：同）。银行存款、结算备付金及存出保证金之浮动利率根据中国人民银行的基准利率和相关机构的相关政策浮动。

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和债券以及银行间同业市场交易的债券，所面临的其他价格风险由所持有的金融工具公允价值的变动情况决定。

本基金为被动式股票指数基金，采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相

应调整。若因特殊情况(如市场流动性不足、个别成份股被限制投资、法律法规禁止或限制投资等)导致无法获得足够数量的股票时，基金可能不能按照成份股权重持有成份股，基金管理人将采用合理方法替代等指数投资技术适当调整基金投资组合，并可在条件允许的情况下，辅以金融衍生工具进行投资管理，以有效控制基金的跟踪误差，追求尽可能贴近标的指数的表现。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2025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 | 68,658,480.18 | 97.01 | 61,154,211.82 | 95.93 |
| 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 | 68,658,480.18 | 97.01 | 61,154,211.82 | 95.93 |

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 （2026 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2025 年 12 月 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | | 31 日 ） |
| | 业绩比较基准上升 5% | 3,443,319.33 | 3,096,986.88 |
| | 业绩比较基准下降 5% | -3,443,319.33 | -3,096,986.88 |

## 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。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<br>2026 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 68,658,480.18 | 61,154,211.82 |
| 第二层次 | - | - |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 68,658,480.18 | 61,154,211.82 |

#### 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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

### 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 | 68,658,480.18 | 96.89 |
| | 其中：股票 | 68,658,480.18 | 96.89 |
| 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 | 2,191,996.63 | 3.09 |
| 8 | 其他各项资产 | 10,276.97 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 70,860,753.78 | 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 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 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 | 344,425.00 | 0.49 |
| B | 采矿业 | 3,235,120.00 | 4.57 |
| C | 制造业 | 48,597,707.88 | 68.67 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,176,686.00 | 3.08 |
| E | 建筑业 | 583,160.00 | 0.82 |
| F | 批发和零售业 | 247,925.00 | 0.35 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 1,540,671.00 | 2.18 |
| H | 住宿和餐饮业 | 28,784.00 | 0.04 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,726,317.00 | 2.44 |
| J | 金融业 | 8,194,537.00 | 11.58 |
| K | 房地产业 | 277,558.00 | 0.39 |
| L | 租赁和商务服务业 | 187,985.00 | 0.27 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,292,617.50 | 1.83 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 89,357.60 | 0.13 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 135,629.20 | 0.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 68,658,480.18 | 97.01 |

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 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本报告期末本基金未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 300308 | 中际旭创 | 3,200 | 4,064,000.00 | 5.74 |
| 2 | 300750 | 宁德时代 | 9,600 | 3,772,896.00 | 5.33 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 2,100 | 2,489,529.00 | 3.52 |
| 4 | 603986 | 兆易创新 | 2,300 | 1,874,500.00 | 2.65 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 36,900 | 1,761,606.00 | 2.49 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 6 | 600036 | 招商银行 | 44,600 | 1,583,300.00 | 2.24 |
| 7 | 601899 | 紫金矿业 | 55,200 | 1,387,728.00 | 1.96 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 17,800 | 1,344,434.00 | 1.90 |
| 9 | 688008 | 澜起科技 | 4,000 | 1,239,600.00 | 1.75 |
| 10 | 002475 | 立讯精密 | 17,300 | 1,217,920.00 | 1.72 |
| 11 | 002384 | 东山精密 | 4,600 | 1,206,810.00 | 1.71 |
| 12 | 600900 | 长江电力 | 43,800 | 1,159,386.00 | 1.64 |
| 13 | 688981 | 中芯国际 | 7,150 | 1,135,563.00 | 1.60 |
| 14 | 000725 | 京东方 A | 120,000 | 1,041,600.00 | 1.47 |
| 15 | 603259 | 药明康德 | 7,900 | 983,629.00 | 1.39 |
| 16 | 300059 | 东方财富 | 47,300 | 963,974.00 | 1.36 |
| 17 | 601166 | 兴业银行 | 57,500 | 952,200.00 | 1.35 |
| 18 | 601138 | 工业富联 | 12,200 | 880,230.00 | 1.24 |
| 19 | 300274 | 阳光电源 | 5,460 | 868,249.20 | 1.23 |
| 20 | 600183 | 生益科技 | 4,600 | 797,640.00 | 1.13 |
| 21 | 002594 | 比亚迪 | 9,300 | 741,210.00 | 1.05 |
| 22 | 600487 | 亨通光电 | 6,700 | 732,578.00 | 1.04 |
| 23 | 601288 | 农业银行 | 108,800 | 660,416.00 | 0.93 |
| 24 | 600522 | 中天科技 | 10,085 | 611,957.80 | 0.86 |
| 25 | 600887 | 伊利股份 | 21,900 | 524,724.00 | 0.74 |
| 26 | 000338 | 潍柴动力 | 18,500 | 504,125.00 | 0.71 |
| 27 | 000858 | 五粮液 | 6,700 | 495,800.00 | 0.70 |
| 28 | 603019 | 中科曙光 | 4,600 | 493,258.00 | 0.70 |
| 29 | 300124 | 汇川技术 | 7,400 | 490,842.00 | 0.69 |
| 30 | 600309 | 万华化学 | 6,900 | 472,029.00 | 0.67 |
| 31 | 002415 | 海康威视 | 13,600 | 465,120.00 | 0.66 |
| 32 | 002281 | 光迅科技 | 1,800 | 462,492.00 | 0.65 |
| 33 | 603993 | 洛阳钼业 | 25,900 | 454,545.00 | 0.64 |
| 34 | 000063 | 中兴通讯 | 11,700 | 423,423.00 | 0.60 |
| 35 | 601816 | 京沪高铁 | 93,400 | 423,102.00 | 0.60 |
| 36 | 002916 | 深南电路 | 910 | 416,689.00 | 0.59 |
| 37 | 601088 | 中国神华 | 10,200 | 398,208.00 | 0.56 |
| 38 | 600000 | 浦发银行 | 45,700 | 393,477.00 | 0.56 |
| 39 | 300433 | 蓝思科技 | 7,100 | 380,986.00 | 0.54 |
| 40 | 601857 | 中国石油 | 43,100 | 374,108.00 | 0.53 |
| 41 | 300136 | 信维通信 | 3,000 | 357,750.00 | 0.51 |
| 42 | 600089 | 特变电工 | 15,723 | 353,767.50 | 0.50 |
| 43 | 002050 | 三花智控 | 7,900 | 346,257.00 | 0.49 |
| 44 | 300014 | 亿纬锂能 | 5,300 | 344,659.00 | 0.49 |
| 45 | 601601 | 中国太保 | 11,500 | 327,980.00 | 0.46 |
| 46 | 000657 | 中钨高新 | 3,400 | 325,448.00 | 0.46 |
| 47 | 002714 | 牧原股份 | 9,100 | 318,409.00 | 0.45 |
| 48 | 600549 | 厦门钨业 | 3,700 | 315,240.00 | 0.45 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 49 | 000001 | 平安银行 | 31,000 | 311,550.00 | 0.44 |
| 50 | 300760 | 迈瑞医疗 | 2,200 | 298,826.00 | 0.42 |
| 51 | 600406 | 国电南瑞 | 13,040 | 297,964.00 | 0.42 |
| 52 | 601012 | 隆基绿能 | 22,700 | 297,824.00 | 0.42 |
| 53 | 601668 | 中国建筑 | 66,500 | 288,610.00 | 0.41 |
| 54 | 600690 | 海尔智家 | 13,800 | 281,658.00 | 0.40 |
| 55 | 002352 | 顺丰控股 | 8,800 | 275,088.00 | 0.39 |
| 56 | 603799 | 华友钴业 | 5,700 | 275,082.00 | 0.39 |
| 57 | 603501 | 豪威集团 | 2,900 | 275,065.00 | 0.39 |
| 58 | 600660 | 福耀玻璃 | 5,400 | 272,376.00 | 0.38 |
| 59 | 688777 | 中控技术 | 2,300 | 270,250.00 | 0.38 |
| 60 | 002460 | 赣锋锂业 | 4,100 | 268,140.00 | 0.38 |
| 61 | 000977 | 浪潮信息 | 3,800 | 266,000.00 | 0.38 |
| 62 | 002709 | 天赐材料 | 5,100 | 262,293.00 | 0.37 |
| 63 | 601985 | 中国核电 | 28,900 | 260,967.00 | 0.37 |
| 64 | 601919 | 中远海控 | 19,500 | 258,570.00 | 0.37 |
| 65 | 002938 | 鹏鼎控股 | 2,400 | 252,912.00 | 0.36 |
| 66 | 000425 | 徐工机械 | 31,000 | 250,790.00 | 0.35 |
| 67 | 002851 | 麦格米特 | 1,500 | 250,770.00 | 0.35 |
| 68 | 000021 | 深科技 | 3,900 | 250,653.00 | 0.35 |
| 69 | 601600 | 中国铝业 | 29,500 | 242,490.00 | 0.34 |
| 70 | 600028 | 中国石化 | 53,100 | 236,826.00 | 0.33 |
| 71 | 002466 | 天齐锂业 | 3,800 | 233,016.00 | 0.33 |
| 72 | 603083 | 剑桥科技 | 900 | 229,383.00 | 0.32 |
| 73 | 002202 | 金风科技 | 9,500 | 227,050.00 | 0.32 |
| 74 | 002080 | 中材科技 | 2,500 | 225,000.00 | 0.32 |
| 75 | 600498 | 烽火通信 | 3,000 | 220,800.00 | 0.31 |
| 76 | 601869 | 长飞光纤 | 400 | 218,360.00 | 0.31 |
| 77 | 002241 | 歌尔股份 | 9,300 | 209,529.00 | 0.30 |
| 78 | 000568 | 泸州老窖 | 2,700 | 209,304.00 | 0.30 |
| 79 | 605117 | 德业股份 | 1,900 | 201,742.00 | 0.29 |
| 80 | 601628 | 中国人寿 | 5,700 | 201,495.00 | 0.28 |
| 81 | 002600 | 领益智造 | 11,600 | 201,144.00 | 0.28 |
| 82 | 300390 | 天华新能 | 2,100 | 196,371.00 | 0.28 |
| 83 | 601766 | 中国中车 | 37,000 | 192,400.00 | 0.27 |
| 84 | 002179 | 中航光电 | 4,160 | 192,192.00 | 0.27 |
| 85 | 601888 | 中国中免 | 3,500 | 187,985.00 | 0.27 |
| 86 | 600905 | 三峡能源 | 50,300 | 186,613.00 | 0.26 |
| 87 | 688271 | 联影医疗 | 1,800 | 182,214.00 | 0.26 |
| 88 | 603288 | 海天味业 | 5,420 | 179,727.20 | 0.25 |
| 89 | 601818 | 光大银行 | 59,900 | 173,111.00 | 0.24 |
| 90 | 300373 | 扬杰科技 | 1,100 | 172,953.00 | 0.24 |
| 91 | 600958 | 东方证券 | 18,200 | 171,808.00 | 0.24 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 92 | 601168 | 西部矿业 | 6,300 | 170,982.00 | 0.24 |
| 93 | 688111 | 金山办公 | 800 | 170,440.00 | 0.24 |
| 94 | 601872 | 招商轮船 | 9,700 | 170,429.00 | 0.24 |
| 95 | 000807 | 云铝股份 | 7,600 | 168,264.00 | 0.24 |
| 96 | 300037 | 新宙邦 | 1,800 | 167,130.00 | 0.24 |
| 97 | 002273 | 水晶光电 | 4,700 | 166,756.00 | 0.24 |
| 98 | 600989 | 宝丰能源 | 8,200 | 166,706.00 | 0.24 |
| 99 | 688396 | 华润微 | 1,700 | 165,835.00 | 0.23 |
| 100 | 600019 | 宝钢股份 | 30,400 | 165,072.00 | 0.23 |
| 101 | 300450 | 先导智能 | 4,000 | 162,880.00 | 0.23 |
| 102 | 002422 | 科伦药业 | 4,200 | 161,784.00 | 0.23 |
| 103 | 601336 | 新华保险 | 2,700 | 161,082.00 | 0.23 |
| 104 | 601825 | 沪农商行 | 21,200 | 158,788.00 | 0.22 |
| 105 | 600885 | 宏发股份 | 4,360 | 150,376.40 | 0.21 |
| 106 | 002648 | 卫星化学 | 6,300 | 147,987.00 | 0.21 |
| 107 | 603296 | 华勤技术 | 1,960 | 145,569.20 | 0.21 |
| 108 | 600760 | 中航沈飞 | 3,500 | 143,850.00 | 0.20 |
| 109 | 600547 | 山东黄金 | 6,200 | 143,158.00 | 0.20 |
| 110 | 601390 | 中国中铁 | 34,300 | 143,031.00 | 0.20 |
| 111 | 001389 | 广合科技 | 600 | 142,350.00 | 0.20 |
| 112 | 601377 | 兴业证券 | 23,200 | 140,128.00 | 0.20 |
| 113 | 002126 | 银轮股份 | 2,800 | 139,440.00 | 0.20 |
| 114 | 600875 | 东方电气 | 4,800 | 138,096.00 | 0.20 |
| 115 | 300015 | 爱尔眼科 | 16,420 | 135,629.20 | 0.19 |
| 116 | 300316 | 晶盛机电 | 2,200 | 132,880.00 | 0.19 |
| 117 | 600066 | 宇通客车 | 4,900 | 131,369.00 | 0.19 |
| 118 | 600585 | 海螺水泥 | 7,700 | 130,515.00 | 0.18 |
| 119 | 002129 | TCL 中环 | 10,800 | 129,816.00 | 0.18 |
| 120 | 002821 | 凯莱英 | 800 | 129,600.00 | 0.18 |
| 121 | 600426 | 华鲁恒升 | 5,400 | 129,168.00 | 0.18 |
| 122 | 000538 | 云南白药 | 2,700 | 127,899.00 | 0.18 |
| 123 | 600011 | 华能国际 | 16,600 | 125,994.00 | 0.18 |
| 124 | 600048 | 保利发展 | 27,000 | 125,010.00 | 0.18 |
| 125 | 000157 | 中联重科 | 17,900 | 124,763.00 | 0.18 |
| 126 | 601868 | 中国能建 | 45,800 | 122,286.00 | 0.17 |
| 127 | 600570 | 恒生电子 | 5,700 | 120,783.00 | 0.17 |
| 128 | 600436 | 片仔癀 | 1,100 | 120,208.00 | 0.17 |
| 129 | 600580 | 卧龙电驱 | 3,620 | 119,822.00 | 0.17 |
| 130 | 688183 | 生益电子 | 900 | 119,160.00 | 0.17 |
| 131 | 600346 | 恒力石化 | 6,700 | 118,657.00 | 0.17 |
| 132 | 600886 | 国投电力 | 8,800 | 117,128.00 | 0.17 |
| 133 | 002340 | 格林美 | 17,700 | 116,997.00 | 0.17 |
| 134 | 603228 | 景旺电子 | 1,600 | 115,856.00 | 0.16 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 135 | 600438 | 通威股份 | 9,400 | 113,834.00 | 0.16 |
| 136 | 002236 | 大华股份 | 6,900 | 113,781.00 | 0.16 |
| 137 | 605499 | 东鹏饮料 | 906 | 111,827.58 | 0.16 |
| 138 | 603659 | 璞泰来 | 3,790 | 109,644.70 | 0.15 |
| 139 | 601058 | 赛轮轮胎 | 9,200 | 106,076.00 | 0.15 |
| 140 | 600196 | 复星医药 | 4,700 | 105,609.00 | 0.15 |
| 141 | 300759 | 康龙化成 | 3,650 | 105,594.50 | 0.15 |
| 142 | 002517 | 恺英网络 | 6,400 | 104,000.00 | 0.15 |
| 143 | 688036 | 传音控股 | 1,700 | 100,215.00 | 0.14 |
| 144 | 003816 | 中国广核 | 25,600 | 100,096.00 | 0.14 |
| 145 | 301236 | 软通动力 | 2,300 | 97,635.00 | 0.14 |
| 146 | 600563 | 法拉电子 | 500 | 95,400.00 | 0.13 |
| 147 | 601877 | 正泰电器 | 3,800 | 95,266.00 | 0.13 |
| 148 | 300207 | 欣旺达 | 5,000 | 94,950.00 | 0.13 |
| 149 | 601360 | 三六零 | 10,900 | 94,721.00 | 0.13 |
| 150 | 002056 | 横店东磁 | 3,100 | 94,488.00 | 0.13 |
| 151 | 002797 | 第一创业 | 14,200 | 93,294.00 | 0.13 |
| 152 | 600219 | 南山铝业 | 23,200 | 92,568.00 | 0.13 |
| 153 | 300347 | 泰格医药 | 1,900 | 91,200.00 | 0.13 |
| 154 | 600372 | 中航机载 | 8,200 | 88,970.00 | 0.13 |
| 155 | 000895 | 双汇发展 | 3,900 | 87,360.00 | 0.12 |
| 156 | 300454 | 深信服 | 900 | 86,580.00 | 0.12 |
| 157 | 600026 | 中远海能 | 4,800 | 86,112.00 | 0.12 |
| 158 | 601111 | 中国国航 | 14,200 | 85,910.00 | 0.12 |
| 159 | 000733 | 振华科技 | 1,500 | 84,960.00 | 0.12 |
| 160 | 601231 | 环旭电子 | 2,600 | 84,240.00 | 0.12 |
| 161 | 002304 | 洋河股份 | 2,200 | 83,930.00 | 0.12 |
| 162 | 300866 | 安克创新 | 800 | 83,600.00 | 0.12 |
| 163 | 002487 | 大金重工 | 1,400 | 81,158.00 | 0.11 |
| 164 | 300496 | 中科创达 | 1,300 | 80,327.00 | 0.11 |
| 165 | 001979 | 招商蛇口 | 12,400 | 79,732.00 | 0.11 |
| 166 | 000963 | 华东医药 | 2,800 | 78,736.00 | 0.11 |
| 167 | 300748 | 金力永磁 | 2,540 | 78,359.00 | 0.11 |
| 168 | 600741 | 华域汽车 | 5,000 | 77,600.00 | 0.11 |
| 169 | 601319 | 中国人保 | 11,400 | 77,064.00 | 0.11 |
| 170 | 688195 | 腾景科技 | 400 | 77,032.00 | 0.11 |
| 171 | 300142 | 沃森生物 | 5,900 | 76,641.00 | 0.11 |
| 172 | 601615 | 明阳智能 | 6,600 | 76,362.00 | 0.11 |
| 173 | 002025 | 航天电器 | 1,000 | 76,220.00 | 0.11 |
| 174 | 688676 | 金盘科技 | 900 | 76,176.00 | 0.11 |
| 175 | 600732 | 爱旭股份 | 5,500 | 76,175.00 | 0.11 |
| 176 | 002252 | 上海莱士 | 17,500 | 75,950.00 | 0.11 |
| 177 | 688599 | 天合光能 | 5,314 | 75,033.68 | 0.11 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 178 | 000661 | 长春高新 | 1,100 | 73,260.00 | 0.10 |
| 179 | 688301 | 奕瑞科技 | 588 | 72,912.00 | 0.10 |
| 180 | 000002 | 万科 A | 24,600 | 72,816.00 | 0.10 |
| 181 | 000423 | 东阿阿胶 | 1,600 | 72,576.00 | 0.10 |
| 182 | 600060 | 海信视像 | 2,600 | 72,462.00 | 0.10 |
| 183 | 002078 | 太阳纸业 | 5,800 | 72,442.00 | 0.10 |
| 184 | 300073 | 当升科技 | 1,500 | 72,060.00 | 0.10 |
| 185 | 603444 | 吉比特 | 200 | 71,684.00 | 0.10 |
| 186 | 002747 | 埃斯顿 | 1,900 | 70,927.00 | 0.10 |
| 187 | 300012 | 华测检测 | 5,100 | 70,686.00 | 0.10 |
| 188 | 600021 | 上海电力 | 4,600 | 69,322.00 | 0.10 |
| 189 | 600699 | 均胜电子 | 3,200 | 69,152.00 | 0.10 |
| 190 | 002831 | 裕同科技 | 1,863 | 66,248.28 | 0.09 |
| 191 | 300919 | 中伟新材 | 1,500 | 65,625.00 | 0.09 |
| 192 | 688223 | 晶科能源 | 13,600 | 64,600.00 | 0.09 |
| 193 | 688187 | 时代电气 | 940 | 64,540.40 | 0.09 |
| 194 | 603345 | 安井食品 | 800 | 64,152.00 | 0.09 |
| 195 | 600171 | 上海贝岭 | 2,000 | 63,880.00 | 0.09 |
| 196 | 603806 | 福斯特 | 3,800 | 63,802.00 | 0.09 |
| 197 | 601633 | 长城汽车 | 4,200 | 63,378.00 | 0.09 |
| 198 | 002624 | 完美世界 | 5,100 | 63,342.00 | 0.09 |
| 199 | 000617 | 中油资本 | 9,600 | 63,264.00 | 0.09 |
| 200 | 600600 | 青岛啤酒 | 1,200 | 62,676.00 | 0.09 |
| 201 | 300677 | 英科医疗 | 1,600 | 62,672.00 | 0.09 |
| 202 | 601607 | 上海医药 | 3,800 | 58,520.00 | 0.08 |
| 203 | 300628 | 亿联网络 | 1,700 | 57,494.00 | 0.08 |
| 204 | 600177 | 雅戈尔 | 7,500 | 56,475.00 | 0.08 |
| 205 | 002223 | 鱼跃医疗 | 2,200 | 56,452.00 | 0.08 |
| 206 | 000039 | 中集集团 | 6,800 | 55,148.00 | 0.08 |
| 207 | 300832 | 新产业 | 1,300 | 54,600.00 | 0.08 |
| 208 | 688568 | 中科星图 | 1,300 | 53,911.00 | 0.08 |
| 209 | 000887 | 中鼎股份 | 3,000 | 53,670.00 | 0.08 |
| 210 | 002459 | 晶澳科技 | 6,600 | 53,460.00 | 0.08 |
| 211 | 002506 | 协鑫集成 | 16,800 | 53,424.00 | 0.08 |
| 212 | 600312 | 平高电气 | 3,000 | 52,980.00 | 0.07 |
| 213 | 000999 | 华润三九 | 2,336 | 52,536.64 | 0.07 |
| 214 | 603236 | 移远通信 | 1,020 | 52,193.40 | 0.07 |
| 215 | 600873 | 梅花生物 | 7,100 | 52,185.00 | 0.07 |
| 216 | 600332 | 白云山 | 2,600 | 52,104.00 | 0.07 |
| 217 | 000400 | 许继电气 | 2,400 | 52,080.00 | 0.07 |
| 218 | 688772 | 珠海冠宇 | 2,600 | 51,038.00 | 0.07 |
| 219 | 002266 | 浙富控股 | 10,000 | 50,600.00 | 0.07 |
| 220 | 600803 | 新奥股份 | 3,200 | 50,560.00 | 0.07 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 221 | 000155 | 川能动力 | 4,200 | 50,316.00 | 0.07 |
| 222 | 600765 | 中航重机 | 3,800 | 49,096.00 | 0.07 |
| 223 | 000876 | 新希望 | 7,800 | 48,906.00 | 0.07 |
| 224 | 600500 | 中化国际 | 6,200 | 48,546.00 | 0.07 |
| 225 | 300122 | 智飞生物 | 4,150 | 48,513.50 | 0.07 |
| 226 | 002841 | 视源股份 | 1,400 | 48,342.00 | 0.07 |
| 227 | 603605 | 珀莱雅 | 800 | 47,936.00 | 0.07 |
| 228 | 603195 | 公牛集团 | 1,200 | 46,980.00 | 0.07 |
| 229 | 002683 | 广东宏大 | 1,600 | 46,864.00 | 0.07 |
| 230 | 002249 | 大洋电机 | 6,200 | 46,500.00 | 0.07 |
| 231 | 002430 | 杭氧股份 | 1,500 | 46,440.00 | 0.07 |
| 232 | 300296 | 利亚德 | 8,100 | 45,360.00 | 0.06 |
| 233 | 601799 | 星宇股份 | 500 | 45,310.00 | 0.06 |
| 234 | 600486 | 扬农化工 | 890 | 45,123.00 | 0.06 |
| 235 | 600845 | 宝信软件 | 2,700 | 44,901.00 | 0.06 |
| 236 | 000729 | 燕京啤酒 | 4,400 | 44,572.00 | 0.06 |
| 237 | 002152 | 广电运通 | 4,700 | 44,086.00 | 0.06 |
| 238 | 600161 | 天坛生物 | 3,800 | 44,004.00 | 0.06 |
| 239 | 300773 | 拉卡拉 | 2,800 | 42,840.00 | 0.06 |
| 240 | 603341 | 龙旗科技 | 1,000 | 42,490.00 | 0.06 |
| 241 | 688248 | 南网科技 | 600 | 41,508.00 | 0.06 |
| 242 | 688114 | 华大智造 | 800 | 40,864.00 | 0.06 |
| 243 | 002410 | 广联达 | 5,000 | 40,800.00 | 0.06 |
| 243 | 600008 | 首创环保 | 15,000 | 40,800.00 | 0.06 |
| 244 | 300896 | 爱美客 | 460 | 40,112.00 | 0.06 |
| 245 | 600282 | 南钢股份 | 8,700 | 39,933.00 | 0.06 |
| 246 | 600998 | 九州通 | 8,500 | 39,865.00 | 0.06 |
| 247 | 603939 | 益丰药房 | 2,200 | 39,556.00 | 0.06 |
| 248 | 000708 | 中信特钢 | 3,100 | 39,122.00 | 0.06 |
| 249 | 603568 | 伟明环保 | 2,520 | 38,757.60 | 0.05 |
| 250 | 000582 | 北部湾港 | 3,600 | 38,628.00 | 0.05 |
| 251 | 000921 | 海信家电 | 1,400 | 38,248.00 | 0.05 |
| 252 | 000513 | 丽珠集团 | 1,300 | 37,557.00 | 0.05 |
| 253 | 300573 | 兴齐眼药 | 915 | 37,295.40 | 0.05 |
| 254 | 600535 | 天士力 | 2,800 | 37,044.00 | 0.05 |
| 255 | 601018 | 宁波港 | 11,700 | 36,855.00 | 0.05 |
| 256 | 688009 | 中国通号 | 7,700 | 36,652.00 | 0.05 |
| 257 | 603486 | 科沃斯 | 700 | 35,525.00 | 0.05 |
| 258 | 603338 | 浙江鼎力 | 800 | 34,000.00 | 0.05 |
| 259 | 600562 | 国睿科技 | 1,600 | 33,952.00 | 0.05 |
| 260 | 600380 | 健康元 | 3,600 | 33,912.00 | 0.05 |
| 261 | 300413 | 芒果超媒 | 2,300 | 33,649.00 | 0.05 |
| 262 | 600685 | 中船防务 | 1,300 | 33,072.00 | 0.05 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 263 | 688278 | 特宝生物 | 600 | 32,640.00 | 0.05 |
| 263 | 688778 | 厦钨新能 | 600 | 32,640.00 | 0.05 |
| 264 | 601880 | 辽港股份 | 22,700 | 31,326.00 | 0.04 |
| 265 | 600511 | 国药股份 | 1,200 | 31,248.00 | 0.04 |
| 266 | 600801 | 华新建材 | 2,000 | 31,200.00 | 0.04 |
| 267 | 601866 | 中远海发 | 13,800 | 30,498.00 | 0.04 |
| 268 | 600970 | 中材国际 | 4,100 | 29,233.00 | 0.04 |
| 269 | 600132 | 重庆啤酒 | 700 | 28,910.00 | 0.04 |
| 270 | 600754 | 锦江酒店 | 1,600 | 28,784.00 | 0.04 |
| 271 | 688567 | 孚能科技 | 2,700 | 28,350.00 | 0.04 |
| 272 | 600004 | 白云机场 | 3,900 | 28,314.00 | 0.04 |
| 273 | 600131 | 国网信通 | 1,900 | 27,740.00 | 0.04 |
| 274 | 603899 | 晨光股份 | 1,300 | 26,819.00 | 0.04 |
| 275 | 600598 | 北大荒 | 2,400 | 26,016.00 | 0.04 |
| 276 | 601966 | 玲珑轮胎 | 2,500 | 25,475.00 | 0.04 |
| 277 | 300682 | 朗新科技 | 2,500 | 24,750.00 | 0.03 |
| 278 | 002773 | 康弘药业 | 1,200 | 24,540.00 | 0.03 |
| 279 | 600528 | 中铁工业 | 3,700 | 24,383.00 | 0.03 |
| 280 | 601808 | 中海油服 | 2,100 | 22,701.00 | 0.03 |
| 281 | 600377 | 宁沪高速 | 1,800 | 20,826.00 | 0.03 |
| 282 | 300979 | 华利集团 | 700 | 20,825.00 | 0.03 |
| 283 | 688563 | 航材股份 | 400 | 20,492.00 | 0.03 |
| 284 | 601298 | 青岛港 | 2,500 | 20,125.00 | 0.03 |
| 285 | 600779 | 水井坊 | 700 | 19,838.00 | 0.03 |
| 286 | 601568 | 北元化工 | 5,800 | 19,720.00 | 0.03 |
| 287 | 300888 | 稳健医疗 | 700 | 19,593.00 | 0.03 |
| 288 | 601598 | 中国外运 | 3,900 | 19,344.00 | 0.03 |
| 289 | 000959 | 首钢股份 | 4,800 | 16,848.00 | 0.02 |
| 290 | 688475 | 萤石网络 | 600 | 16,410.00 | 0.02 |
| 291 | 001872 | 招商港口 | 800 | 15,544.00 | 0.02 |
| 292 | 603733 | 仙鹤股份 | 500 | 13,505.00 | 0.02 |
| 293 | 603556 | 海兴电力 | 600 | 13,200.00 | 0.02 |
| 294 | 001289 | 龙源电力 | 500 | 7,815.00 | 0.01 |
| 295 | 600956 | 新天绿能 | 1,100 | 7,689.00 | 0.01 |

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

本报告期末本基金未持有积极投资股票。

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 600519 | 贵州茅台 | 539,806.00 | 0.85 |
| 2 | 601816 | 京沪高铁 | 464,198.00 | 0.73 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 3 | 601318 | 中国平安 | 426,735.00 | 0.67 |
| 4 | 601899 | 紫金矿业 | 364,718.00 | 0.57 |
| 5 | 600036 | 招商银行 | 313,854.00 | 0.49 |
| 6 | 000657 | 中钨高新 | 272,879.00 | 0.43 |
| 7 | 600900 | 长江电力 | 215,896.00 | 0.34 |
| 8 | 601166 | 兴业银行 | 206,337.00 | 0.32 |
| 9 | 601168 | 西部矿业 | 196,308.00 | 0.31 |
| 10 | 605117 | 德业股份 | 194,411.00 | 0.30 |
| 11 | 688981 | 中芯国际 | 181,988.00 | 0.29 |
| 12 | 603083 | 剑桥科技 | 164,301.00 | 0.26 |
| 13 | 603259 | 药明康德 | 156,069.36 | 0.24 |
| 14 | 601138 | 工业富联 | 154,125.00 | 0.24 |
| 15 | 002273 | 水晶光电 | 152,258.00 | 0.24 |
| 16 | 002648 | 卫星化学 | 151,515.00 | 0.24 |
| 17 | 601288 | 农业银行 | 148,896.00 | 0.23 |
| 18 | 600276 | 恒瑞医药 | 146,072.00 | 0.23 |
| 19 | 002126 | 银轮股份 | 133,416.00 | 0.21 |
| 20 | 000157 | 中联重科 | 131,565.00 | 0.21 |

### 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 | 600276 | 恒瑞医药 | 803,768.00 | 1.26 |
| 2 | 600031 | 三一重工 | 465,348.00 | 0.73 |
| 3 | 601688 | 华泰证券 | 437,451.00 | 0.69 |
| 4 | 601939 | 建设银行 | 296,748.00 | 0.47 |
| 5 | 600519 | 贵州茅台 | 264,282.00 | 0.41 |
| 6 | 601318 | 中国平安 | 245,614.00 | 0.39 |
| 7 | 601658 | 邮储银行 | 226,596.00 | 0.36 |
| 8 | 601899 | 紫金矿业 | 212,400.00 | 0.33 |
| 9 | 600036 | 招商银行 | 188,347.00 | 0.30 |
| 10 | 600188 | 兖矿能源 | 144,664.20 | 0.23 |
| 11 | 600900 | 长江电力 | 142,152.00 | 0.22 |
| 12 | 000166 | 申万宏源 | 139,216.00 | 0.22 |
| 13 | 300751 | 迈为股份 | 127,839.00 | 0.20 |
| 14 | 601166 | 兴业银行 | 126,224.00 | 0.20 |
| 15 | 688981 | 中芯国际 | 105,772.00 | 0.17 |
| 16 | 601138 | 工业富联 | 105,395.00 | 0.17 |
| 17 | 600839 | 四川长虹 | 103,930.00 | 0.16 |
| 18 | 600000 | 浦发银行 | 97,803.00 | 0.15 |
| 19 | 600109 | 国金证券 | 85,120.00 | 0.13 |
| 20 | 688008 | 澜起科技 | 84,934.00 | 0.13 |

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 10,930,923.86 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 7,787,124.37 |

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

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中国人民银行安徽省分行、中国人民银行山东省分行、烟台市牟平区市场监督管理局、济南市市中区财政局、国家金融监督管理总局浙江监管局、国家金融监督管理总局江苏监管局的处罚。立讯精密工业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到市场监管总局的处罚。

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 10,276.97 |
| 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 | 10,276.97 |

### 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的情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本报告期末本基金未持有积极投资股票，不存在前五名积极投资流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额比例（%） | 持有份额 | 占总份额比例（%） |
| 191 | 293,047.48 | 54,396,180.00 | 97.18 | 1,575,888.00 | 2.82 |

### 8.2 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。

### 8.3 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情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
| --- | --- |
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

注：截止本报告期末，本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本基金份额总量的数量区间均为 0；本基金基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
| --- | --- |
| 基金合同生效日（2023 年 3 月 6 日）基金份额总额 | 232,972,068.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 52,972,068.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 9,000,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 6,000,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 55,972,068.00 |

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

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，李华先生离任基金管理人督察长，唐华先生代任；李露女士任职基金管理人督察长，唐华先生不再代任；黄峰先生任职、离任基金管理人首席信息官；王宏超先生任职基金管理人首席信息官。

2、2026 年 6 月，樊玲同志担任上海银行股份有限公司资产托管部见习总经理助理。上述人事变动已进行备案、公告。

### 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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

| 管理人受调查或处罚等情况- | 内容 |
|---|---|
| 受到调查或处罚等措施的主体 | 管理人 |
| 受到调查或处罚等措施的时间 | 2026 年 2 月 4 日 |
| 采取调查或处罚等措施的机构 | 中国证券监督管理委员会上海监管局 |
| 受到调查或处罚等措施类型 | 行政监管措施 |
| 受到的具体措施类型 | 责令整改 |
| 受到调查或处罚等措施的原因 | 人员管理、公司治理、其他问题（权限管理） |
| 受到处罚的依据 | 《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《证券基金经营机构信息技术管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》 |
| 管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见） | 本报告期内，管理人已从完善制度流程、优化管理机制、强化监督检查等方面完成整改，整改成果已经中国证券监督管理委员会上海监管局验收通过。 |
| 其他 | 无 |

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人相关从业人员受调查或处罚等情况。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门无受调查或处罚等情况。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的分管公募基金托管业务的高级管理人员无受调查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

### 10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例(%) | 佣金 | 占当期佣金总量的比例(%) | |
| 方正证券股份有限公司 | 2 | 8,149,928.37 | 43.54 | 1,571.15 | 43.14 | - |
| 山西证券股份有限公司 | 1 | 10,568,119.86 | 56.46 | 2,070.68 | 56.86 | - |
| 中泰证券 | 1 | - | - | - | - | - |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 股份有限公司 | | | | | | |

注：一、选择证券经营机构参与证券交易的标准

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

（一） 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币；

（二） 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；

（三）经营行为稳健、规范；

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

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

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

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

（八）能协助基金管理人拓展资产管理业务和能力，促进基金管理人业务发展等。

二、选择证券经营机构参与证券交易的程序

基金管理人根据上述标准对拟合作证券经营机构开展尽职调查、建立证券经营机构白名单。基金管理人与白名单内的证券经营机构签订交易单元使用协议，通知基金托管人协同办理相关交易单元租用手续。之后，基金管理人定期对合作证券经营机构开展服务评价，根据各证券经营机构的研究能力和质量、投资研究服务水平、上市公司交流机会和投资研讨会质量等进行评比排名，并对排名靠前的证券经营机构在交易量的分配上采取适当的倾斜政策。

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

三、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

无。

四、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 10.7.2 基金租用或者通过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(%) |
| 方正证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 山西证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券股份有限公司 | - | - | - | - | - | - |

## 10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|---|---|---|---|
| 1 | 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年第 4 季度报告 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 2 | 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026 年 1 月 22 日 |
| 3 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国联民生证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 2 月 13 日 |
| 4 | 国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026 年 2 月 27 日 |
| 5 | 国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 规定报刊、规定网站 | 2026 年 3 月 2 日 |
| 6 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加兴业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 | 2026 年 3 月 11 日 |
| 7 | 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 | 2026 年 3 月 16 日 |
| 8 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告 | 规定网站、规定报刊、深圳证券交易所 | 2026 年 3 月 23 日 |
| 9 | 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2026 年 3 月 24 日 |
| 10 | 国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 规定报刊、规定网站 | 2026 年 3 月 28 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 11 | 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2025 年年度报告 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 12 | 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（2025 年度） | 规定网站 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 13 | 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年年度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026 年 3 月 31 日 |
| 14 | 国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 15 | 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金 2026 年第 1 季度报告 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2026 年 4 月 22 日 |
| 16 | 国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026 年 4 月 30 日 |
| 17 | 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2026 年第 1 号） | 规定网站、深圳证券交易所 | 2026 年 5 月 15 日 |
| 18 | 国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新 | 规定网站、深圳证券交易所 | 2026 年 5 月 15 日 |
| 19 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加民生证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 5 月 25 日 |
| 20 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国投证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 5 日 |
| 21 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中泰证券等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 | 2026 年 6 月 5 日 |
| 22 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加国金证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 5 日 |
| 23 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加西南证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 5 日 |
| 24 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金财富证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 5 日 |
| 25 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东海证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 5 日 |
| 26 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加山西证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 5 日 |
| 27 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部 | 规定网站、规定报刊、 | 2026 年 6 月 16 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 分基金增加金融街证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 上海证券交易所、深圳证券交易所 | |
| 28 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中金公司为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 16 日 |
| 29 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加招商证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 22 日 |
| 30 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加东财证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 22 日 |
| 31 | 国联安基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026 年 6 月 22 日 |
| 32 | 国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发证券为基金申购赎回代办券商的公告 | 规定网站、规定报刊、上海证券交易所、深圳证券交易所 | 2026 年 6 月 22 日 |
| 33 | 国联安基金管理有限公司关于终止浦领基金销售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 | 2026 年 6 月 26 日 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比（%） |
| 机构 | 1 | 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日 | 50,668,900.00 | 0.00 | 0.00 | 50,668,900.00 | 90.53 |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| （1）持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。<br>（2）基金净值大幅波动的风险<br>高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。<br>（3）基金规模较小导致的风险<br>高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 | | | | | | | |

注：申购份额包含本报告期内发生的买入份额；赎回份额包含本报告期内发生的卖出份额。

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件

2、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

3、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》

4、《国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件和营业执照

6、基金托管人业务资格批件和营业执照

7、中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

## 12.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日