

**国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2023 年年度报告**  
**2023 年 12 月 31 日**

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§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	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
8.6	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 .....	70
8.7	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 .....	71
8.8	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 .....	71
8.9	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 .....	71
8.10	本基金投资股指期货的投资政策 .....	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
8.12	投资组合报告附注 .....	71
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息</b> .....	<b>73</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	73
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	73
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	73
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 .....	73
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动</b> .....	<b>74</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示</b> .....	<b>74</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	74
11.2	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 .....	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4	基金投资策略的改变 .....	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.8	其他重大事件 .....	77
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>78</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录</b> .....	<b>79</b>
13.1	备查文件目录 .....	79
13.2	存放地点 .....	79
13.3	查阅方式 .....	79

## §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国联安沪深 300ETF
场内简称	国联安沪深 300ETF
基金主代码	515660
交易代码	515660
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 11 月 25 日
基金管理人	国联安基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	427,294,165.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019 年 12 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。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。
投资策略	<p>1、股票投资策略</p> <p>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。</p> <p>2、债券投资策略</p> <p>本基金进行债券投资的目的是在保证基金资产流动性的基础上，使基金资</p>

	<p>产得到更加合理有效的利用，从而提高投资组合收益。</p> <p>3、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将在宏观经济和基本面分析的基础上，对资产支持证券的质量和构成、利率风险、信用风险、流动性风险和提前偿付风险等进行定性和量化的全方面分析，评估其相对投资价值后作出相应的投资决策。</p> <p>4、可转换债券和可交换债券投资策略</p> <p>本基金将对可转换债券和可交换债券的价值进行评估，选择具有较高投资价值的可转换债券、可交换债券，根据基金资产组合情况可适度进行投资。</p> <p>5、金融衍生品投资策略</p> <p>本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，追求对标的指数的紧密跟踪。</p> <p>6、融资及转融通证券出借业务投资策略</p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国联安基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李华	郭明
	联系电话	021-38992888	010-66105799
	电子邮箱	customer.service@cpicfunds.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		021-38784766/4007000365	95588
传真		021-50151582	010-66105798

注册地址	中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路1318号9楼	北京市西城区复兴门内大街55 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	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码	200121	100140
法定代表人	于业明	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报、上交所网站
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cpicfunds.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-74,970,030.73	4,312,640.57	237,045,289.40
本期利润	46,376,417.09	-245,270,894.93	-9,369,494.21
加权平均基金份额本期利润	0.2137	-0.9230	-0.0492
本期加权平均净值利润率	4.74%	-20.41%	-0.89%
本期基金份额净值增长率	-8.30%	-18.96%	-1.35%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末

期末可供分配利润	71,076,167.47	255,861,907.88	199,282,756.51
期末可供分配基金份额利润	0.1663	0.5316	1.5618
期末基金资产净值	1,725,468,970.50	2,119,331,309.66	693,300,426.86
期末基金份额净值	4.0381	4.4034	5.4336
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>2023 年末</b>	<b>2022 年末</b>	<b>2021 年末</b>
基金份额累计净值增长率	4.30%	13.73%	40.34%

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

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

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

4、本基金基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-6.47%	0.78%	-7.00%	0.79%	0.53%	-0.01%
过去六个月	-8.81%	0.83%	-10.71%	0.85%	1.90%	-0.02%
过去一年	-8.30%	0.83%	-11.38%	0.85%	3.08%	-0.02%
过去三年	-26.68%	1.09%	-34.16%	1.11%	7.48%	-0.02%
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	4.30%	1.17%	-10.88%	1.19%	15.18%	-0.02%

注：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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 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 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2019 年 11 月 25 日至 2023 年 12 月 31 日)



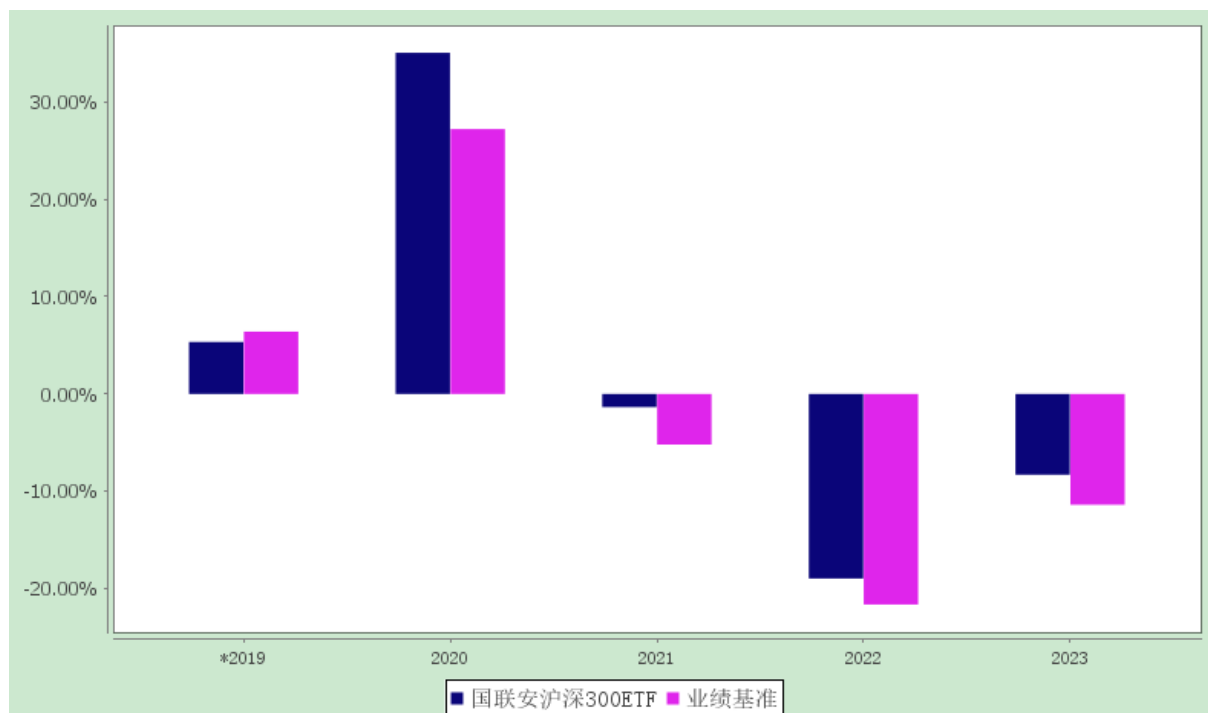


注：1、本基金业绩比较基准为沪深 300 指数收益率；  
 2、本基金基金合同于 2019 年 11 月 25 日生效；  
 3、本基金建仓期为自基金合同生效之日起的 6 个月。建仓期结束时各项资产配置符合合同约定；  
 4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年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 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1、\*基金合同生效当年按实际存续期计算的净值增长率；

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2023	-	-	-	-	-
2022	-	-	-	-	-
2021	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国联安基金管理有限公司是中国第一家获准筹建的中外合资基金管理公司，其中方股东为太平洋资产管理有限责任公司，是国内领先的“A+H”股上市综合性保险集团中国太平洋保险（集团）股份有限公司控股的资产管理公司；外方股东为德国安联集团，是全球顶级综合性金融集团之一。国联安基金管理有限公司拥有国际化的基金管理团队，借鉴外方先进的公司治理和风险管理经验，结

合本地投资研究与客户服务的成功实践，秉持“稳健、专业、卓越、信赖”的经营理念，力争成为中国基金业最佳基金管理公司之一。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
黄欣	本基金基金经理、兼任国联安中证 100 指数证券投资基金（LOF）基金经理、上证大宗商品股票交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理、国联安中证医药 100 指数证券投资基金基金经理、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基金经理、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基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基	2019-11-25	-	21 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、量化投资部总监助理等职。2010 年 4 月起担任国联安中证 100 指数证券投资基金（LOF）的基金经理；2010 年 5 月至 2012 年 9 月兼任国联安德盛安心成长混合型证券投资基金的基金经理；2010 年 11 月起兼任上证大宗商品股票交易型开放式指数证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

	金联接基金基金经理、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基金经理、国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理、国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理、国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。				基金的基金经理；2019 年 12 月起兼任国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 5 月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2022 年 5 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
章榭元	本基金基金经理、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基金经理、国联安中	2020-05-06	-	15 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

	<p>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基金经理、国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理、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基金经理、国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理、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基金经理、国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金基金经理、国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理、国联安国证 ESG300 交易型开放式指</p>				<p>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、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；2021 年 2 月起兼任国联安中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 5 月起兼任国联安中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 6 月起兼任国联安上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 9 月起兼任国联安创业板科技交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2021 年 10 月起兼任国联安新精选灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 11 月起兼任国联安添鑫灵活配置混合型证券投资基金的基金经理；2022 年 12 月起兼任国联安中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理；2023 年 3 月起兼任国联安国证 ESG300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2023 年 4 月起兼任国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；2024 年 1 月起兼任国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金经理。</p>
--	---	--	--	--	---

	数证券投资基金基金经理、国联安中证消费 50 交易型开放式指数证券投资基金基金经理、国联安沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理、量化投资部总经理。				
沈晔	本基金基金经理助理。	2021-04-27	-	5 年（自 2018 年起）	-

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。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金合同》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 公平交易制度和控制方法

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。

本基金管理人建立了健全的投资授权制度，分别明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。本基金管理人建立了统一的研究平台，不同投资组合可共享研究资源。本基金管理人建立了严格的投资组合投资信息的管理及保密制度，通过投资交易管理系统的权限设置确保不同投资组合经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息均做到相互隔离。本基金管理人建立集中交易室实行集中交易制度，投资交易指令统一通过交易室下达，严格遵守公平交易原则，启用交易系统中的公平交易模块，按照时间优先、价格优先、比例分配的原则执行指令；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理根据投资需要

独立申报价格和数量，交易室根据事前申报的满足价格条件的数量进行比例分配；对于银行间交易、固定收益平台、交易所大宗交易等非集中竞价交易，以投资组合的名义向银行间市场或交易对手询价、成交确认，确保上述非集中竞价交易与投资组合一一对应，并保证各投资组合获得公平的交易机会。风险管理部对银行间、固定收益平台和大宗平台的交易进行交易价格的核对。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

本基金管理人每季度和每年度对所有投资组合进行同向交易价差分析、反向及异常交易分析。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。本基金管理人对不同投资组合同日反向交易进行严格的控制，对不同投资组合邻近交易日的反向交易从交易量、交易价格、交易金额等方面进行分析，未发现异常交易。

本基金管理人对本报告期内不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）的不同投资组合同向交易的交易价差进行了分析，执行了 95% 置信区间、假设溢价率为 0 的 T 分布检验，同时进一步对不同投资组合同向交易的交易占优比情况以及潜在的价差金额对投资组合的贡献进行分析，未发现明显异常。

公平交易制度总体执行情况良好。

#### 4.3.3 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

2023 年，俄乌战争仍在持续，世界多地爆发不同程度的武装冲突，包括巴尔干地区以及巴以地区等等，整个世界政局受到多方面的冲击，带动黄金价格一路上涨，国际上通货膨胀也处于较高水平。国内方面，反映制造业景气程度的 PMI 指数一直在荣枯线附近徘徊，消费增长也缺乏强劲动力，经济复苏不达预期，叠加上人民币贬值，给股市带来较大的冲击。

2023 年 A 股市场呈现普遍下跌的态势,全年沪深 300 指数下跌 11.38%,创业板综指下跌 5.41%。

依据基金合同的约定,沪深 300ETF 基金始终保持较高的仓位,采用完全复制的方法跟踪沪深 300 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 4.0381 元,本报告期份额净值增长率为-8.30%,同期业绩比较基准收益率为-11.38%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济基本面仍待修复。A 股市场在在宏观经济疲软、世界政局动荡的环境下依旧处于一个磨底的过程,当下投资还是要注意风险控制,也需要有耐心与信心,消费、医药、地产等板块在经过之前一段时间的调整之后,存在估值修复的动力,同时,以半导体、人工智能、新能源等板块为代表的科技发展这条主线仍旧值得长期关注。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内,基金管理人在内部监察工作中本着一切合法合规运作的指导思想、以保障基金份额持有人利益为宗旨,由独立于各业务部门的内部监察人员对公司的经营管理、基金的投资运作及员工的行为规范等方面进行定期和不定期检查,发现问题及时督促有关部门进行整改,并定期制作报告上报公司管理层。具体来说,报告期内基金管理人的内部监察工作重点集中于以下几个方面:

(1) 报告期内,公司密切关注监管部门所颁布的各项最新的法律法规,及时进行法律法规及监管政策的通报和解读。此外,公司还通过组织各项专题合规培训,使投研、市场、中后台的各条线人员加深对法律法规及公司制度的理解,加强员工的合规意识。

(2) 报告期内,公司在监管机构的指导下,持续推动合规经营和风险防范,多次通过邮件和培训等多种形式对公司员工加强教育、引导和监督,并加大了各项稽核力度。

(3) 通过组织各部门认真贯彻落实法规政策、定期自查、监察部门的定期/不定期的抽查,对公司业务的各个方面进行监督检查,包括基金投资、运作、销售等领域,以实现公司的合法合规经营,维护基金份额持有人、公司股东和公司的合法权益。

(4) 加强与托管人的日常联系。公司与托管人的基金日常监督部门加强联系,确定了日常监督的工作方式、业务合作等,并完善日常监督方面的沟通与联系。

基金管理人将继续致力于维护一个有效率、效果的内部控制体系,以风险防范为核心,提高内部监察稽核工作的科学性和有效性,切实保障基金安全、合规运作。



#### 4.7 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。估值委员会由公司营运总监/副总监(主席/副主席)、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。

#### 4.8 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,本基金本报告期末未进行利润分配,符合本基金基金合同的相关规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对本基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,本基金的管理人——国联安基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国联安基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和

完整。

## §6 审计报告

安永华明（2024）审字第 70076852\_B16 号

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

### 6.1 审计意见

我们审计了国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

### 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 其他信息

国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的持续经

营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

石静筠 骆文慧

上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 50 楼

2024 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	133,248,904.79	28,329,645.90
结算备付金		236,063.03	39,489.60
存出保证金		43,253.05	191,593.35
交易性金融资产	7.4.7.2	1,716,648,394.26	2,091,856,599.51
其中：股票投资		1,716,648,394.26	2,091,856,599.51
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		1,558,439.50	219,607.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	7,396,295.50	-
资产总计		1,859,131,350.13	2,120,636,935.75
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		93,330,638.57	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		129,425.81	547,893.16
应付托管费		21,570.98	91,315.55
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.49
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	40,180,744.27	666,416.89
负债合计		133,662,379.63	1,305,626.09
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	1,654,392,803.03	1,863,469,401.78
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	71,076,167.47	255,861,907.88
净资产合计		1,725,468,970.50	2,119,331,309.66
负债和净资产总计		1,859,131,350.13	2,120,636,935.75

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 4.0381 元，基金份额总额 427,294,165.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日 至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日 至 2022 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		50,348,497.34	-240,532,196.37
1.利息收入		61,332.55	105,088.38
其中：存款利息收入	7.4.7.9	61,332.55	101,510.27
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		-	3,578.11
2.投资收益（损失以“-”填列）		-69,991,768.94	6,894,600.03
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-87,347,261.96	-12,958,896.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	302,281.40
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	17,355,493.02	19,551,215.57

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）	7.4.7.14	121,346,447.82	-249,583,535.50
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-1,067,514.09	2,051,650.72
<b>减：二、营业总支出</b>		3,972,080.25	4,738,698.56
1. 管理人报酬		2,993,524.90	3,575,083.73
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		498,920.83	595,847.32
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		-	13.06
8. 其他费用	7.4.7.16	479,634.52	567,754.45
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>46,376,417.09</b>	<b>-245,270,894.93</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>46,376,417.09</b>	<b>-245,270,894.93</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		46,376,417.09	-245,270,894.93

### 7.3 净资产变动表

会计主体：国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 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	1,863,469,401.78	-	255,861,907.88	2,119,331,309.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,863,469,401.78	-	255,861,907.88	2,119,331,309.66

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-209,076,598.75	-	-184,785,740.41	-393,862,339.16
（一）、综合收益总额	-	-	46,376,417.09	46,376,417.09
（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）	-209,076,598.75	-	-231,162,157.50	-440,238,756.25
其中：1.基金申购款	1,317,182,582.42	-	37,136,911.04	1,354,319,493.46
2.基金赎回款	-1,526,259,181.17	-	-268,299,068.54	-1,794,558,249.71
（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	1,654,392,803.03	-	71,076,167.47	1,725,468,970.50
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 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	494,017,670.35	-	199,282,756.51	693,300,426.86
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	494,017,670.35	-	199,282,756.51	693,300,426.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,369,451,731.43	-	56,579,151.37	1,426,030,882.80
（一）、综合收益总额	-	-	-245,270,894.93	-245,270,894.93
（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	1,369,451,731.43	-	301,850,046.30	1,671,301,777.73

填列)				
其中：1.基金申购款	1,808,512,591.49	-	396,813,734.31	2,205,326,325.80
2.基金赎回款	-439,060,860.06	-	-94,963,688.01	-534,024,548.07
(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	1,863,469,401.78	-	255,861,907.88	2,119,331,309.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告页码(序号)从 7.1 至 7.4, 财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人: 王琤, 主管会计工作负责人: 叶培智, 会计机构负责人: 仲晓峰

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国联安沪深 300 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[2019]1121 号《关于准予国联安沪深 300 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 2019 年 11 月 25 日生效, 首次设立募集规模为 500,986,890.00 份基金份额。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, 基金托管人为中国工商银行股份有限公司, 注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金的投资范围主要为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(包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、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)。本基金可以参与融资业务以及通过证券金融公司办理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%；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，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。

本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数收益率。

#### 7.4.2 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、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征

分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

## (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具,按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的,应对报价进行调整,确定公允价值。

与上述投资品种相同,但具有不同特征的,应以相同资产或负债的公允价值为基础,并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等,如果该限制是针对资产持有者的,那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外,基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价;

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输入值,只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下,才使用不可观察输入值;

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的方法估值;

(4) 如有新增事项,按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且该种法定权利现在是可执行的,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时,金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时,申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入。出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入计入投资收益；

(8) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率时,基金管理人可以进行收益分配。具体分红方案见基金管理人届时发布的相关分红公告;

(2) 在符合有关基金分红条件的前提下,收益分配比例根据以下原则确定:使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配;

(3) 本基金收益分配方式为现金分红;

(4) 基于本基金的性质和特点,本基金收益分配无需以弥补亏损为前提,收益分配后基金份额净值有可能低于面值;

(5) 每一基金份额享有同等分配权;

(6) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

在不违背法律法规及基金合同的规定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下,基金管理人经与托管人协商一致,可在按照监管部门要求履行适当程序后调整基金收益的分配原则,不需召开基金份额持有人大会,但应于变更实施日前在规定媒介公告。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 7.4.6 税项

#### 7.4.6.1 印花税

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

#### **7.4.6.2 增值税**

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。增值税应税行为的销售额根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定确定。

#### **7.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加**

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育费附加的单位外）及地方教育

费附加。

#### 7.4.6.4 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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。

#### 7.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元



项目	本期末	上年度末
	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
活期存款	133,248,904.79	28,329,645.90
等于：本金	133,243,994.89	28,326,832.69
加：应计利息	4,909.90	2,813.21
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	133,248,904.79	28,329,645.90

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,756,428,987.28	-	1,716,648,394.26	-39,780,593.02
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	1,756,428,987.28	-	1,716,648,394.26	-39,780,593.02
项目	上年度末			
	2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,252,983,640.35	-	2,091,856,599.51	-161,127,040.84
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	2,252,983,640.35	-	2,091,856,599.51	-161,127,040.84

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本报告期末及上年度末，本基金均未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本报告期末及上年度末，本基金均未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，本基金均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
ETF 申赎证券清算款	7,396,295.50	-
合计	7,396,295.50	-

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 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	655,830.43	295,964.34
其中：交易所市场	655,830.43	295,964.34
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提审计费	60,000.00	90,000.00
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
ETF 申赎证券清算款	39,310,669.35	-
应付指数使用费	34,244.49	160,452.55
合计	40,180,744.27	666,416.89

#### 7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	481,294,165.00	1,863,469,401.78

本期申购	340,200,000.00	1,317,182,582.42
本期赎回（以“-”号填列）	-394,200,000.00	-1,526,259,181.17
本期末	427,294,165.00	1,654,392,803.03

#### 7.4.7.8 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	949,722,905.74	-693,860,997.86	255,861,907.88
本期期初	949,722,905.74	-693,860,997.86	255,861,907.88
本期利润	-74,970,030.73	121,346,447.82	46,376,417.09
本期基金份额交易产生的变动数	-220,912,373.00	-10,249,784.50	-231,162,157.50
其中：基金申购款	523,610,449.11	-486,473,538.07	37,136,911.04
基金赎回款	-744,522,822.11	476,223,753.57	-268,299,068.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	653,840,502.01	-582,764,334.54	71,076,167.47

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	47,198.60	83,825.50
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	12,075.58	16,102.47
其他	2,058.37	1,582.30
合计	61,332.55	101,510.27

注：此处其他列示的是结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-79,290,359.57	-12,739,804.68
股票投资收益——赎回差价收入	-8,056,902.39	-219,092.26
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	-87,347,261.96	-12,958,896.94

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	926,303,728.23	430,805,614.82
减：卖出股票成本总额	1,003,092,259.86	441,424,474.70
减：交易费用	2,501,827.94	2,120,944.80
买卖股票差价收入	-79,290,359.57	-12,739,804.68

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	1,794,558,249.71	534,024,548.07
减：现金支付赎回款总额	787,954,858.71	240,436,058.07
减：赎回股票成本总额	1,014,660,293.39	293,807,582.26
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-8,056,902.39	-219,092.26

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无股票投资收益——申购差价收入。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
----	---	--

债券投资收益——利息收入	-	166.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-	302,114.72
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	-	302,281.40

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	2,061,306.19
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	1,758,984.59
减：应计利息总额	-	198.10
减：交易费用	-	8.78
买卖债券差价收入	-	302,114.72

#### 7.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券赎回差价收入。

#### 7.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无债券申购差价收入。

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本报告期内及上年度可比期间，本基金均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	17,355,493.02	19,551,215.57
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	17,355,493.02	19,551,215.57

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
1.交易性金融资产	121,346,447.82	-249,583,535.50
——股票投资	121,346,447.82	-249,583,535.50
——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	121,346,447.82	-249,583,535.50

注：股票投资包括公允价值变动损益-可退替代。

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF 替代损益	-1,067,514.09	2,051,650.72
合计	-1,067,514.09	2,051,650.72

7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月	2022年1月1日至2022年12月31日

	31日	
审计费用	60,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行汇划费用	282.00	246.00
指数使用费	299,352.52	357,508.45
合计	479,634.52	567,754.45

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 ("国联安沪深 300ETF 联接基金")	本基金的联接基金
国联安基金管理有限公司 ("国联安基金")	基金管理人
中国工商银行股份有限公司 ("工商银行")	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

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1.1 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。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的权证交易。



#### 7.4.10.1.3 债券交易

本报告期内及上年度可比期间，本基金均未有通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

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

#### 7.4.10.1.5 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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,993,524.90	3,575,083.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,811.65	2,333.54
应支付基金管理人的净管理费	2,991,713.25	3,572,750.19

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 0.30% 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：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.30\% / \text{当年天数}。$$

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12 月31日
当期发生的基金应支付的托管费	498,920.83	595,847.32

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.05% 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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.05\% / \text{当年天数}。$$

### 7.4.10.3 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。

### 7.4.10.4 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。

### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

#### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

#### 7.4.10.5.2 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 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
太保人寿	-	-	20,881,898.00	4.34%
国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	420,494,700.00	98.41%	453,739,300.00	94.27%

#### 7.4.10.6 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	
	2023年1月1日至2023年12月31日		2022年1月1日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
工商银行	133,248,904.79	47,198.60	28,329,645.90	83,825.50

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

本基金通过“中国工商银行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 2023 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 236,063.03 元（2022 年：人民币 39,489.60 元）。

**7.4.10.7 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。

**7.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

本基金在报告期内根据基金合同约定的投资策略投资于基金托管人发行的股票工商银行（601398.SH）和基金管理人的最终控制人发行的股票太保集团（601601.SH）。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期内无利润分配。

**7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券****7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688720	艾森股份	2023-1-29	6 个月	新股锁定	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-
001239	永达股份	2023-1-2-04	6 个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
001306	夏厦精密	2023-1-1-09	6 个月	新股锁定	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023-1-1-01	6 个月	新股锁定	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
001358	兴欣新材	2023-1-2-14	6 个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001378	德冠新材	2023-1-0-23	6 个月	新股锁定	31.68	31.27	205	6,494.40	6,410.35	-
301202	朗威股份	2023-0-6-28	6 个月	新股锁定	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301251	威尔高	2023-0-8-30	6 个月	新股锁定	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
301261	恒工精密	2023-0-6-29	6 个月	新股锁定	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
30127	英华	2023-0-	6 个月	新股	51.39	53.38	173	8,890.	9,234.	-

2	特	7-06		锁定				47	74	
30129 2	海科 新源	2023-0 6-29	6 个月	新股 锁定	19.99	19.35	583	11,654 .17	11,281 .05	-
30132 9	信音 电子	2023-0 7-05	6 个月	新股 锁定	21.00	22.23	458	9,618. 00	10,181 .34	-
30134 8	蓝箭 电子	2023-0 8-01	6 个月	新股 锁定	18.08	44.57	613	11,083 .04	27,321 .41	-
30137 1	敷尔 佳	2023-0 7-24	6 个月	新股 锁定	55.68	37.58	380	21,158 .40	14,280 .40	-
30139 3	昊帆 生物	2023-0 7-05	6 个月	新股 锁定	67.68	59.37	260	17,596 .80	15,436 .20	-
30141 3	安培 龙	2023-1 2-11	6 个月	新股 锁定	33.25	58.19	164	5,453. 00	9,543. 16	-
30141 8	协昌 科技	2023-0 8-10	6 个月	新股 锁定	51.88	50.20	189	9,805. 32	9,487. 80	-
30142 1	波长 光电	2023-0 8-16	6 个月	新股 锁定	29.38	59.37	332	9,754. 16	19,710 .84	-
30145 6	盘古 智能	2023-0 7-06	6 个月	新股 锁定	37.96	30.39	407	15,449 .72	12,368 .73	-
30145 9	丰茂 股份	2023-1 2-06	6 个月	新股 锁定	31.90	39.84	208	6,635. 20	8,286. 72	-
30146 9	恒达 新材	2023-0 8-10	6 个月	新股 锁定	36.58	33.09	275	10,059 .50	9,099. 75	-
30148 6	致尚 科技	2023-0 6-30	6 个月	新股 锁定	57.66	47.25	482	27,792 .12	22,774 .50	-
30148 7	盟固 利	2023-0 8-01	6 个月	新股 锁定	5.32	40.96	867	4,612. 44	35,512 .32	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	6 个月	新股 锁定	39.78	69.09	262	10,422 .36	18,101 .58	-
30148 9	思泉 新材	2023-1 0-16	6 个月	新股 锁定	41.66	64.11	128	5,332. 48	8,206. 08	-
30149 8	乖宝 宠物	2023-0 8-09	6 个月	新股 锁定	39.99	38.81	531	21,234 .69	20,608 .11	-
30149 9	维科 精密	2023-0 7-13	6 个月	新股 锁定	19.50	28.93	371	7,234. 50	10,733 .03	-
30150 0	飞南 资源	2023-0 9-13	6 个月	新股 锁定	23.97	20.89	455	10,906 .35	9,504. 95	-
30150 5	苏州 规划	2023-0 7-12	6 个月	新股 锁定	26.35	35.81	194	5,111.9 0	6,947. 14	-
30150 7	民生 健康	2023-0 8-24	6 个月	新股 锁定	10.00	15.85	851	8,510. 00	13,488 .35	-
30150 8	中机 认检	2023-1 1-23	6 个月	新股 锁定	16.82	26.68	419	7,047. 58	11,178 .92	-
30150	金凯	2023-0	6 个月	新股	56.56	62.23	266	15,044	16,553	-

9	生科	7-26		锁定				.96	.18	
301510	固高科技	2023-08-04	6 个月	新股锁定	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6 个月	新股锁定	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
301516	中远通	2023-12-01	6 个月	新股锁定	6.87	15.51	604	4,149.48	9,368.04	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6 个月	新股锁定	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301518	长华化学	2023-07-26	6 个月	新股锁定	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6 个月	新股锁定	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6 个月	新股锁定	99.57	81.46	164	16,329.48	13,359.44	-
301526	国际复材	2023-12-19	6 个月	新股锁定	2.66	4.45	5,077	13,504.82	22,592.65	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6 个月	新股锁定	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301529	福赛科技	2023-08-31	6 个月	新股锁定	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301533	威马农机	2023-08-07	6 个月	新股锁定	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6 个月	新股锁定	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6 个月	新股锁定	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6 个月	新股锁定	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301558	三态股份	2023-09-21	6 个月	新股锁定	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
301559	中集环科	2023-09-26	6 个月	新股锁定	24.22	18.24	507	12,279.54	9,247.68	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6 个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301568	思泰克	2023-11-21	6 个月	新股锁定	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6 个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6 个月	新股锁定	11.25	11.07	537	6,041.25	5,944.59	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6 个月	新股锁定	1.70	4.06	2,367	4,023.90	9,610.02	-
60300	鼎龙科	2023-1	6 个月	新股	16.80	31.19	180	3,024.	5,614.	-

4	技	2-20		锁定				00	20	
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6 个月	新股锁定	58.08	57.81	79	4,588.32	4,566.99	-
603075	热威股份	2023-09-01	6 个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6 个月	新股锁定	14.23	18.19	270	3,842.10	4,911.30	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6 个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603193	润本股份	2023-10-09	6 个月	新股锁定	17.38	16.66	278	4,831.64	4,631.48	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6 个月	新股锁定	21.29	21.53	151	3,214.79	3,251.03	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6 个月	新股锁定	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603273	天元智能	2023-10-16	6 个月	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6 个月	新股锁定	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6 个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6 个月	新股锁定	80.80	77.75	281	22,704.80	21,847.75	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6 个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-
688450	光格科技	2023-07-17	6 个月	新股锁定	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6 个月	新股锁定	9.87	12.75	2,564	25,306.68	32,691.00	-
688549	中巨芯	2023-08-30	6 个月	新股锁定	5.18	8.09	2,890	14,970.20	23,380.10	-
688563	航材股份	2023-07-12	6 个月	新股锁定	78.99	60.49	490	38,705.10	29,640.10	-
688573	信宇人	2023-08-09	6 个月	新股锁定	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股锁定	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6 个月	新股锁定	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
688592	司南导航	2023-08-07	6 个月	新股锁定	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6 个月	新股锁定	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
68860	天承	2023-0	6 个月	新股	55.00	74.14	140	7,700.	10,379	-

3	科技	6-30		锁定				00	.60	
688612	威迈斯	2023-07-19	6 个月	新股锁定	47.29	37.97	375	17,733.75	14,238.75	-
688627	精智达	2023-07-11	6 个月	新股锁定	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6 个月	新股锁定	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6 个月	新股锁定	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688651	盛邦安全	2023-07-19	6 个月	新股锁定	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6 个月	新股锁定	31.95	52.25	318	10,160.10	16,615.50	-
688653	康希通信	2023-11-10	6 个月	新股锁定	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6 个月	新股锁定	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6 个月	新股锁定	36.12	34.30	205	7,404.60	7,031.50	-
688702	盛科通信	2023-09-06	6 个月	新股锁定	42.66	48.18	289	12,328.74	13,924.02	-
688716	中研股份	2023-09-13	6 个月	新股锁定	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6 个月	新股锁定	69.98	60.10	168	11,756.64	10,096.80	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

3、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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 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。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止, 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 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。

#### 7.4.12.4 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。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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 2023 年 12 月 31 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%（2022 年 12 月 31 日：0.00%）。

#### 7.4.13.3 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。

##### 7.4.13.3.1 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 50%。

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 7.4.12。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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 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							

其他资产	-	-	-	-	-	7,396,295.50	7,396,295.50
货币资金	133,248,904.79	-	-	-	-	-	133,248,904.79
结算备付金	236,063.03	-	-	-	-	-	236,063.03
存出保证金	43,253.05	-	-	-	-	-	43,253.05
交易性金融资产	-	-	-	-	-	1,716,648,394.26	1,716,648,394.26
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	1,558,439.50	1,558,439.50
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	133,528,220.87	-	-	-	-	1,725,603,129.26	1,859,131,350.13
负债							
其他负债	-	-	-	-	-	40,180,744.27	40,180,744.27
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	93,330,638.57	93,330,638.57
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	129,425.81	129,425.81
应付托管费	-	-	-	-	-	21,570.98	21,570.98
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	133,662,379.63	133,662,379.63
利率敏感度缺口	133,528,220.87	-	-	-	-	1,591,940,749.63	1,725,468,970.50
上年度末 2022 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							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-

货币资金	28,329,645.90	-	-	-	-	-	28,329,645.90
结算备付金	39,489.60	-	-	-	-	-	39,489.60
存出保证金	191,593.35	-	-	-	-	-	191,593.35
交易性金融资产	-	-	-	-	-	2,091,856,599.51	2,091,856,599.51
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	219,607.39	219,607.39
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	28,560,728.85	-	-	-	-	2,092,076,206.90	2,120,636,935.75
负债							
其他负债	-	-	-	-	-	666,416.89	666,416.89
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	-	-	-	-	-	547,893.16	547,893.16
应付托管费	-	-	-	-	-	91,315.55	91,315.55
应交税费	-	-	-	-	-	0.49	0.49
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	-	1,305,626.09	1,305,626.09
利率敏感度缺口	28,560,728.85	-	-	-	-	2,090,770,580.81	2,119,331,309.66

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 12 月 31 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% (2022 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(2022 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。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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币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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	1,716,648,394.26	99.49	2,091,856,599.51	98.70
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	-	-	-	-
合计	1,716,648,394.26	99.49	2,091,856,599.51	98.70

注：股票投资包含可退替代款估值增（减）值。

#### 7.4.13.4.3.2 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加 84,669,773.37	增加 103,697,555.28
	业绩比较基准下降 5%	减少 84,669,773.37	减少 103,697,555.28

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 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。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,715,652,795.88	2,090,209,179.67
第二层次	25,058.16	-
第三层次	970,540.22	1,647,419.84
合计	1,716,648,394.26	2,091,856,599.51

###### 7.4.14.2.2 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。

**7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**

**7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,647,419.84	1,647,419.84
当期购买	-	805,467.36	805,467.36
当期出售/ 结算	-	-	-
转入第三 层次	-	-	-
转出第三 层次	-	1,847,065.10	1,847,065.10
当期利得 或损失总 额	-	364,718.12	364,718.12
其中：计入 损益的利 得或损失	-	364,718.12	364,718.12
计入其他综 合收益的 利得或损 失（若有）	-	-	-
期末余额	-	970,540.22	970,540.22
期末仍持 有的第三 层次金融 资产计入 本期损益 的未实现 利得或损 失的变动 ——公允 价值变动 损益	-	165,072.86	165,072.86

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	1,542,310.47	1,542,310.47
当期出售/ 结算	-	-	-
转入第三 层次	-	-	-
转出第三 层次	-	-	-
当期利得 或损失总 额	-	105,109.37	105,109.37
其中：计入 损益的利 得或损失	-	105,109.37	105,109.37
计入其他综 合收益的 利得或损 失（若有）	-	-	-
期末余额	-	1,647,419.84	1,647,419.84
期末仍持 有的第三 层次金融 资产计入 本期损益 的未实现 利得或损 失的变动 ——公允 价值变动 损益	-	105,109.37	105,109.37

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允 价值	采用的估值 技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均 值	与公允价 值之间的 关系
限售股 票	970,540.22	平均价格亚 式期权模型	预期波动率	0.1962-2.1988	负相关
项目	上年度末公	采用的估值	不可观察输入值		



	允价值	技术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	1,647,419.84	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.1891-2.4756	负相关

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 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	1,716,648,394.26	92.34
	其中：股票	1,716,648,394.26	92.34
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	133,484,967.82	7.18
8	其他各项资产	8,997,988.05	0.48
9	合计	1,859,131,350.13	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 8.2 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。

## 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	21,653,954.94	1.25
B	采矿业	81,893,371.30	4.75
C	制造业	940,181,550.46	54.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,573,804.00	3.34
E	建筑业	35,407,571.30	2.05
F	批发和零售业	5,431,162.86	0.31
G	交通运输、仓储和邮政业	53,628,685.40	3.11
H	住宿和餐饮业	1,351,480.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	81,463,357.38	4.72
J	金融业	370,874,712.60	21.49
K	房地产业	22,504,239.08	1.30
L	租赁和商务服务业	14,377,650.17	0.83
M	科学研究和技术服务业	20,141,766.20	1.17
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	7,289,444.68	0.42
R	文化、体育和娱乐业	1,867,320.00	0.11
S	综合	-	-

	合计	1,715,640,070.37	99.43
--	----	------------------	-------

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	917,803.72	0.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,537.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	5,944.59	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,022.15	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,002,930.12	0.06

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

### 8.2.3 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。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	61,900	106,839,400.00	6.19
2	601318	中国平安	1,063,300	42,850,990.00	2.48
3	300750	宁德时代	260,980	42,607,594.80	2.47
4	600036	招商银行	1,222,600	34,012,732.00	1.97
5	000858	五粮液	191,706	26,898,268.86	1.56
6	000333	美的集团	485,544	26,525,268.72	1.54
7	600276	恒瑞医药	533,161	24,114,872.03	1.40
8	601166	兴业银行	1,436,100	23,279,181.00	1.35
9	600900	长江电力	966,500	22,558,110.00	1.31
10	601899	紫金矿业	1,626,700	20,268,682.00	1.17
11	600030	中信证券	963,870	19,634,031.90	1.14
12	002594	比亚迪	89,600	17,740,800.00	1.03
13	300059	东方财富	1,253,273	17,595,952.92	1.02
14	300760	迈瑞医疗	59,734	17,358,700.40	1.01
15	002475	立讯精密	493,907	17,015,096.15	0.99
16	600887	伊利股份	628,600	16,815,050.00	0.97
17	601398	工商银行	3,461,800	16,547,404.00	0.96
18	601328	交通银行	2,713,600	15,576,064.00	0.90
19	603259	药明康德	202,620	14,742,631.20	0.85
20	000725	京东方 A	3,700,300	14,431,170.00	0.84
21	000651	格力电器	444,782	14,308,636.94	0.83
22	600309	万华化学	186,100	14,296,202.00	0.83
23	601012	隆基绿能	592,429	13,566,624.10	0.79
24	300124	汇川技术	210,561	13,294,821.54	0.77
25	000568	泸州老窖	72,897	13,079,179.74	0.76
26	002415	海康威视	368,790	12,804,388.80	0.74
27	600919	江苏银行	1,812,450	12,125,290.50	0.70
28	601816	京沪高铁	2,425,000	11,931,000.00	0.69
29	601288	农业银行	3,153,400	11,478,376.00	0.67
30	002714	牧原股份	270,060	11,121,070.80	0.64
31	600809	山西汾酒	48,180	11,116,571.40	0.64
32	300498	温氏股份	525,069	10,532,884.14	0.61

33	600028	中国石化	1,879,100	10,485,378.00	0.61
34	688981	中芯国际	194,900	10,333,598.00	0.60
35	601088	中国神华	325,800	10,213,830.00	0.59
36	601668	中国建筑	2,070,300	9,958,143.00	0.58
37	002352	顺丰控股	241,700	9,764,680.00	0.57
38	600016	民生银行	2,451,900	9,170,106.00	0.53
39	000001	平安银行	958,300	8,998,437.00	0.52
40	300274	阳光电源	102,600	8,986,734.00	0.52
41	600837	海通证券	953,500	8,934,295.00	0.52
42	600941	中国移动	89,234	8,876,998.32	0.51
43	600406	国电南瑞	396,565	8,851,330.80	0.51
44	000792	盐湖股份	536,400	8,555,580.00	0.50
45	002230	科大讯飞	183,023	8,488,606.74	0.49
46	000063	中兴通讯	315,000	8,341,200.00	0.48
47	601988	中国银行	2,081,800	8,306,382.00	0.48
48	601728	中国电信	1,533,300	8,295,153.00	0.48
49	600050	中国联通	1,884,900	8,255,862.00	0.48
50	000625	长安汽车	490,234	8,250,638.22	0.48
51	600031	三一重工	586,500	8,076,105.00	0.47
52	601888	中国中免	96,393	8,067,130.17	0.47
53	601601	中国太保	338,000	8,037,640.00	0.47
54	601225	陕西煤业	383,000	8,000,870.00	0.46
55	000100	TCL 科技	1,854,730	7,975,339.00	0.46
56	601857	中国石油	1,119,700	7,905,082.00	0.46
57	002142	宁波银行	391,204	7,867,112.44	0.46
58	600690	海尔智家	373,900	7,851,900.00	0.46
59	603501	韦尔股份	72,230	7,707,663.30	0.45
60	600000	浦发银行	1,159,952	7,678,882.24	0.45
61	000338	潍柴动力	535,802	7,313,697.30	0.42
62	300015	爱尔眼科	460,774	7,289,444.68	0.42
63	300122	智飞生物	118,750	7,256,812.50	0.42
64	300308	中际旭创	63,300	7,147,203.00	0.41
65	688111	金山办公	22,600	7,146,120.00	0.41
66	600436	片仔癀	29,443	7,124,911.57	0.41
67	601688	华泰证券	508,700	7,096,365.00	0.41
68	000002	万科 A	672,238	7,031,609.48	0.41
69	600048	保利发展	709,400	7,023,060.00	0.41
70	601985	中国核电	932,700	6,995,250.00	0.41
71	600089	特变电工	499,300	6,890,340.00	0.40
72	600438	通威股份	267,000	6,683,010.00	0.39
73	601169	北京银行	1,461,900	6,622,407.00	0.38
74	601211	国泰君安	445,000	6,621,600.00	0.38
75	002304	洋河股份	59,400	6,528,060.00	0.38
76	688041	海光信息	91,900	6,523,062.00	0.38

77	002050	三花智控	221,416	6,509,630.40	0.38
78	600150	中国船舶	221,000	6,506,240.00	0.38
79	688012	中微公司	42,350	6,504,960.00	0.38
80	002371	北方华创	25,900	6,363,889.00	0.37
81	601766	中国中车	1,201,200	6,318,312.00	0.37
82	002027	分众传媒	998,500	6,310,520.00	0.37
83	600104	上汽集团	461,700	6,246,801.00	0.36
84	603288	海天味业	164,556	6,244,900.20	0.36
85	600905	三峡能源	1,413,600	6,177,432.00	0.36
86	603986	兆易创新	65,664	6,066,696.96	0.35
87	601919	中远海控	629,930	6,034,729.40	0.35
88	601138	工业富联	392,300	5,931,576.00	0.34
89	600660	福耀玻璃	158,100	5,911,359.00	0.34
90	601229	上海银行	982,362	5,864,701.14	0.34
91	601390	中国中铁	1,014,400	5,761,792.00	0.33
92	002466	天齐锂业	102,000	5,690,580.00	0.33
93	688271	联影医疗	40,300	5,521,503.00	0.32
94	600585	海螺水泥	237,000	5,346,720.00	0.31
95	601818	光大银行	1,833,600	5,317,440.00	0.31
96	688008	澜起科技	90,000	5,288,400.00	0.31
97	300782	卓胜微	37,040	5,222,640.00	0.30
98	600019	宝钢股份	874,200	5,184,006.00	0.30
99	300014	亿纬锂能	121,500	5,127,300.00	0.30
100	600999	招商证券	366,640	5,000,969.60	0.29
101	002129	TCL 中环	319,565	4,997,996.60	0.29
102	002241	歌尔股份	236,500	4,968,865.00	0.29
103	600893	航发动力	131,800	4,926,684.00	0.29
104	600111	北方稀土	249,800	4,831,132.00	0.28
105	601658	邮储银行	1,096,500	4,769,775.00	0.28
106	002460	赣锋锂业	111,420	4,768,776.00	0.28
107	000661	长春高新	32,100	4,680,180.00	0.27
108	601628	中国人寿	164,300	4,657,905.00	0.27
109	601989	中国重工	1,126,200	4,651,206.00	0.27
110	600760	中航沈飞	108,744	4,586,821.92	0.27
111	603019	中科曙光	115,420	4,557,935.80	0.26
112	002049	紫光国微	66,880	4,511,056.00	0.26
113	600958	东方证券	516,496	4,493,515.20	0.26
114	603799	华友钴业	135,183	4,451,576.19	0.26
115	601600	中国铝业	783,500	4,418,940.00	0.26
116	601006	大秦铁路	607,400	4,379,354.00	0.25
117	000938	紫光股份	226,120	4,375,422.00	0.25
118	688036	传音控股	31,543	4,365,551.20	0.25
119	000538	云南白药	88,820	4,365,503.00	0.25
120	600938	中国海油	206,500	4,330,305.00	0.25

121	601939	建设银行	663,300	4,318,083.00	0.25
122	600570	恒生电子	150,045	4,315,294.20	0.25
123	600584	长电科技	141,300	4,219,218.00	0.24
124	000776	广发证券	292,200	4,175,538.00	0.24
125	601669	中国电建	850,700	4,159,923.00	0.24
126	600547	山东黄金	178,640	4,085,496.80	0.24
127	002179	中航光电	104,552	4,077,528.00	0.24
128	600426	华鲁恒升	146,800	4,050,212.00	0.23
129	600009	上海机场	123,100	4,035,218.00	0.23
130	601377	兴业证券	682,140	4,004,161.80	0.23
131	000166	申万宏源	890,400	3,953,376.00	0.23
132	300408	三环集团	132,639	3,906,218.55	0.23
133	600886	国投电力	294,400	3,880,192.00	0.22
134	000425	徐工机械	700,400	3,824,184.00	0.22
135	002459	晶澳科技	184,512	3,823,088.64	0.22
136	002271	东方雨虹	198,950	3,819,840.00	0.22
137	601009	南京银行	510,957	3,770,862.66	0.22
138	601916	浙商银行	1,489,800	3,754,296.00	0.22
139	300142	沃森生物	158,600	3,728,686.00	0.22
140	000596	古井贡酒	16,000	3,724,800.00	0.22
141	002311	海大集团	82,256	3,694,116.96	0.21
142	600795	国电电力	881,000	3,664,960.00	0.21
143	600745	闻泰科技	86,000	3,638,660.00	0.21
144	603993	洛阳钼业	698,100	3,630,120.00	0.21
145	600085	同仁堂	67,500	3,624,750.00	0.21
146	600588	用友网络	202,494	3,602,368.26	0.21
147	002236	大华股份	195,200	3,601,440.00	0.21
148	000963	华东医药	86,691	3,594,208.86	0.21
149	600015	华夏银行	628,600	3,532,732.00	0.20
150	600926	杭州银行	351,200	3,515,512.00	0.20
151	002920	德赛西威	27,100	3,509,721.00	0.20
152	600845	宝信软件	71,328	3,480,806.40	0.20
153	601186	中国铁建	454,700	3,460,267.00	0.20
154	001979	招商蛇口	358,220	3,413,836.60	0.20
155	000977	浪潮信息	101,700	3,376,440.00	0.20
156	601111	中国国航	460,000	3,376,400.00	0.20
157	600011	华能国际	434,400	3,344,880.00	0.19
158	600674	川投能源	220,500	3,333,960.00	0.19
159	601995	中金公司	86,700	3,298,935.00	0.19
160	300033	同花顺	21,000	3,294,270.00	0.19
161	002812	恩捷股份	57,800	3,284,196.00	0.19
162	600115	中国东航	845,300	3,279,764.00	0.19
163	601901	方正证券	406,800	3,278,808.00	0.19
164	600010	包钢股份	2,242,100	3,273,466.00	0.19

165	600989	宝丰能源	217,500	3,212,475.00	0.19
166	002709	天赐材料	127,800	3,205,224.00	0.19
167	601689	拓普集团	43,600	3,204,600.00	0.19
168	000157	中联重科	490,400	3,202,312.00	0.19
169	601360	三六零	352,600	3,176,926.00	0.18
170	600196	复星医药	125,800	3,148,774.00	0.18
171	300896	爱美客	10,600	3,119,898.00	0.18
172	002493	荣盛石化	299,900	3,103,965.00	0.18
173	601633	长城汽车	122,300	3,084,406.00	0.18
174	000768	中航西飞	137,400	3,073,638.00	0.18
175	600029	南方航空	532,300	3,066,048.00	0.18
176	688599	天合光能	107,212	3,058,758.36	0.18
177	601066	中信建投	128,500	3,040,310.00	0.18
178	603369	今世缘	61,800	3,012,750.00	0.17
179	601788	光大证券	192,900	2,974,518.00	0.17
180	300496	中科创达	36,500	2,922,190.00	0.17
181	601100	恒立液压	52,932	2,894,321.76	0.17
182	300661	圣邦股份	32,510	2,893,715.10	0.17
183	002555	三七互娱	153,200	2,881,692.00	0.17
184	600489	中金黄金	287,200	2,860,512.00	0.17
185	300347	泰格医药	51,800	2,847,446.00	0.17
186	300316	晶盛机电	64,500	2,843,805.00	0.16
187	603392	万泰生物	37,709	2,833,077.17	0.16
188	002601	龙佰集团	164,700	2,821,311.00	0.16
189	688126	沪硅产业	162,600	2,816,232.00	0.16
190	300450	先导智能	108,100	2,767,360.00	0.16
191	688256	寒武纪	20,400	2,753,184.00	0.16
192	600346	恒力石化	208,400	2,744,628.00	0.16
193	000895	双汇发展	102,600	2,740,446.00	0.16
194	002821	凯莱英	23,440	2,721,384.00	0.16
195	600188	兖矿能源	136,050	2,695,150.50	0.16
196	601868	中国能建	1,281,200	2,690,520.00	0.16
197	601800	中国交建	350,800	2,666,080.00	0.15
198	600600	青岛啤酒	35,200	2,631,200.00	0.15
199	300433	蓝思科技	196,800	2,597,760.00	0.15
200	601699	潞安环能	118,400	2,594,144.00	0.15
201	601881	中国银河	214,900	2,589,545.00	0.15
202	002001	新 和 成	152,524	2,586,807.04	0.15
203	601336	新华保险	82,500	2,568,225.00	0.15
204	300759	康龙化成	88,050	2,551,689.00	0.15
205	600741	华域汽车	155,500	2,531,540.00	0.15
206	600372	中航机载	191,200	2,520,016.00	0.15
207	000301	东方盛虹	261,400	2,509,440.00	0.15
208	600515	海南机场	676,900	2,504,530.00	0.15



209	002648	卫星化学	166,600	2,457,350.00	0.14
210	002736	国信证券	284,800	2,432,192.00	0.14
211	601021	春秋航空	48,300	2,424,660.00	0.14
212	003816	中国广核	776,800	2,415,848.00	0.14
213	002007	华兰生物	108,230	2,395,129.90	0.14
214	000786	北新建材	100,100	2,338,336.00	0.14
215	600176	中国巨石	237,204	2,331,715.32	0.14
216	688396	华润微	51,596	2,305,825.24	0.13
217	601117	中国化学	362,200	2,303,592.00	0.13
218	601877	正泰电器	106,000	2,280,060.00	0.13
219	002074	国轩高科	105,300	2,263,950.00	0.13
220	002410	广联达	131,644	2,256,378.16	0.13
221	000733	振华科技	38,300	2,253,572.00	0.13
222	601615	明阳智能	179,600	2,252,184.00	0.13
223	301269	华大九天	21,200	2,244,020.00	0.13
224	000983	山西焦煤	224,400	2,217,072.00	0.13
225	002180	纳思达	97,900	2,215,477.00	0.13
226	002202	金风科技	272,889	2,183,112.00	0.13
227	601618	中国中冶	705,400	2,158,524.00	0.13
228	600183	生益科技	115,900	2,122,129.00	0.12
229	601838	成都银行	188,400	2,121,384.00	0.12
230	000876	新希望	224,580	2,093,085.60	0.12
231	600233	圆通速递	170,200	2,091,758.00	0.12
232	600219	南山铝业	694,100	2,040,654.00	0.12
233	601878	浙商证券	191,500	1,997,345.00	0.12
234	000408	藏格矿业	78,200	1,981,588.00	0.11
235	600332	白云山	69,200	1,979,120.00	0.11
236	300999	金龙鱼	58,800	1,962,744.00	0.11
237	000999	华润三九	39,100	1,944,443.00	0.11
238	601238	广汽集团	219,200	1,918,000.00	0.11
239	002603	以岭药业	82,600	1,905,582.00	0.11
240	002841	视源股份	41,575	1,902,472.00	0.11
241	601872	招商轮船	321,800	1,892,184.00	0.11
242	600732	爱旭股份	107,220	1,891,360.80	0.11
243	600918	中泰证券	275,400	1,889,244.00	0.11
244	688303	大全能源	63,850	1,888,044.50	0.11
245	600460	士兰微	82,300	1,878,909.00	0.11
246	300413	芒果超媒	74,100	1,867,320.00	0.11
247	601607	上海医药	109,800	1,836,954.00	0.11
248	601799	星宇股份	14,000	1,835,540.00	0.11
249	600023	浙能电力	397,100	1,830,631.00	0.11
250	600362	江西铜业	102,400	1,828,864.00	0.11
251	300223	北京君正	28,200	1,823,130.00	0.11
252	603260	合盛硅业	35,200	1,795,200.00	0.10

253	603806	福斯特	72,916	1,769,671.32	0.10
254	603659	璞泰来	84,530	1,769,212.90	0.10
255	300751	迈为股份	13,620	1,763,926.20	0.10
256	300454	深信服	24,400	1,763,876.00	0.10
257	601898	中煤能源	180,900	1,752,921.00	0.10
258	688223	晶科能源	197,500	1,749,850.00	0.10
259	600061	国投资本	253,660	1,709,668.40	0.10
260	300763	锦浪科技	23,500	1,642,650.00	0.10
261	300919	中伟股份	33,200	1,631,116.00	0.09
262	600875	东方电气	109,600	1,602,352.00	0.09
263	601998	中信银行	302,800	1,601,812.00	0.09
264	600132	重庆啤酒	23,600	1,568,220.00	0.09
265	600803	新奥股份	91,800	1,544,076.00	0.09
266	600025	华能水电	177,900	1,535,277.00	0.09
267	002938	鹏鼎控股	68,500	1,528,920.00	0.09
268	601319	中国人保	315,700	1,527,988.00	0.09
269	603290	斯达半导	8,400	1,520,400.00	0.09
270	000069	华侨城 A	485,900	1,511,149.00	0.09
271	601865	福莱特	56,200	1,500,540.00	0.09
272	300628	亿联网络	49,880	1,473,954.00	0.09
273	605499	东鹏饮料	7,800	1,423,578.00	0.08
274	002916	深南电路	20,040	1,422,639.60	0.08
275	605117	德业股份	16,793	1,408,932.70	0.08
276	000708	中信特钢	99,700	1,399,788.00	0.08
277	603899	晨光股份	36,700	1,378,085.00	0.08
278	600018	上港集团	276,100	1,352,890.00	0.08
279	600754	锦江酒店	45,200	1,351,480.00	0.08
280	000617	中油资本	249,600	1,347,840.00	0.08
281	600039	四川路桥	172,320	1,290,676.80	0.07
282	688363	华熙生物	18,863	1,262,500.59	0.07
283	603195	公牛集团	13,089	1,251,962.85	0.07
284	688065	凯赛生物	22,757	1,251,179.86	0.07
285	603833	欧派家居	17,860	1,243,234.60	0.07
286	000877	天山股份	171,300	1,144,284.00	0.07
287	300957	贝泰妮	16,600	1,131,622.00	0.07
288	601698	中国卫通	62,400	1,080,144.00	0.06
289	688561	奇安信	26,750	1,072,407.50	0.06
290	601236	红塔证券	139,820	1,061,233.80	0.06
291	601155	新城控股	89,400	1,020,054.00	0.06
292	600606	绿地控股	416,545	958,053.50	0.06
293	603486	科沃斯	22,500	932,400.00	0.05
294	688187	时代电气	25,522	927,214.26	0.05
295	601808	中海油服	58,400	853,808.00	0.05
296	300979	华利集团	14,800	779,072.00	0.05

297	000800	一汽解放	91,600	778,600.00	0.05
298	601059	信达证券	32,200	579,278.00	0.03
299	001289	龙源电力	14,800	293,188.00	0.02

### 8.3.2 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	301487	盟固利	867.00	35,512.32	0.00
2	688548	广钢气体	2,564.00	32,691.00	0.00
3	688563	航材股份	490.00	29,640.10	0.00
4	301348	蓝箭电子	613.00	27,321.41	0.00
5	688582	芯动联科	648.00	25,058.16	0.00
6	688549	中巨芯	2,890.00	23,380.10	0.00
7	301486	致尚科技	482.00	22,774.50	0.00
8	301526	国际复材	5,077.00	22,592.65	0.00
9	603296	华勤技术	281.00	21,847.75	0.00
10	301498	乖宝宠物	531.00	20,608.11	0.00
11	301421	波长光电	332.00	19,710.84	0.00
12	301558	三态股份	1,458.00	19,537.20	0.00
13	688627	精智达	222.00	19,473.84	0.00
14	688591	泰凌微	681.00	19,081.62	0.00
15	301488	豪恩汽电	262.00	18,101.58	0.00
16	688652	京仪装备	318.00	16,615.50	0.00
17	301509	金凯生科	266.00	16,553.18	0.00
18	301393	昊帆生物	260.00	15,436.20	0.00
19	301371	敷尔佳	380.00	14,280.40	0.00
20	688612	威迈斯	375.00	14,238.75	0.00
21	688702	盛科通信	289.00	13,924.02	0.00
22	301510	固高科技	396.00	13,863.96	0.00
23	301507	民生健康	851.00	13,488.35	0.00
24	301525	儒竞科技	164.00	13,359.44	0.00
25	301566	达利凯普	576.00	12,752.64	0.00
26	301456	盘古智能	407.00	12,368.73	0.00
27	688602	康鹏科技	1,066.00	11,789.96	0.00
28	301550	斯菱股份	260.00	11,328.20	0.00
29	301292	海科新源	583.00	11,281.05	0.00
30	301508	中机认检	419.00	11,178.92	0.00
31	301251	威尔高	321.00	11,103.39	0.00
32	688592	司南导航	216.00	10,914.48	0.00
33	301499	维科精密	371.00	10,733.03	0.00
34	688603	天承科技	140.00	10,379.60	0.00
35	688653	康希通信	648.00	10,361.52	0.00

36	301528	多浦乐	148.00	10,198.68	0.00
37	301329	信音电子	458.00	10,181.34	0.00
38	688719	爱科赛博	168.00	10,096.80	0.00
39	301261	恒工精密	198.00	10,068.30	0.00
40	301202	朗威股份	306.00	9,730.80	0.00
41	688716	中研股份	267.00	9,716.13	0.00
42	601096	宏盛华源	2,367.00	9,610.02	0.00
43	301413	安培龙	164.00	9,543.16	0.00
44	301500	飞南资源	455.00	9,504.95	0.00
45	301418	协昌科技	189.00	9,487.80	0.00
46	301516	中远通	604.00	9,368.04	0.00
47	301559	中集环科	507.00	9,247.68	0.00
48	301272	英华特	173.00	9,234.74	0.00
49	301469	恒达新材	275.00	9,099.75	0.00
50	301518	长华化学	385.00	8,858.85	0.00
51	301568	思泰克	246.00	8,752.68	0.00
52	301520	万邦医药	160.00	8,438.40	0.00
53	301459	丰茂股份	208.00	8,286.72	0.00
54	688720	艾森股份	165.00	8,223.60	0.00
55	688573	信宇人	285.00	8,208.00	0.00
56	301489	思泉新材	128.00	8,206.08	0.00
57	688651	盛邦安全	178.00	8,196.90	0.00
58	301517	陕西华达	185.00	8,082.65	0.00
59	301578	辰奕智能	118.00	8,061.76	0.00
60	301548	崇德科技	136.00	8,022.64	0.00
61	688657	浩辰软件	101.00	7,901.23	0.00
62	688646	逸飞激光	219.00	7,899.33	0.00
63	603275	众辰科技	193.00	7,662.10	0.00
64	301533	威马农机	225.00	7,461.00	0.00
65	688429	时创能源	346.00	7,331.74	0.00
66	301555	惠柏新材	224.00	7,266.56	0.00
67	688671	碧兴物联	205.00	7,031.50	0.00
68	301505	苏州规划	194.00	6,947.14	0.00
69	301529	福赛科技	182.00	6,894.16	0.00
70	301515	港通医疗	230.00	6,502.10	0.00
71	688648	中邮科技	303.00	6,493.29	0.00
72	001378	德冠新材	205.00	6,410.35	0.00
73	688450	光格科技	167.00	6,082.14	0.00
74	601083	锦江航运	537.00	5,944.59	0.00
75	603270	金帝股份	195.00	5,768.10	0.00
76	603004	鼎龙科技	180.00	5,614.20	0.00
77	603119	浙江荣泰	226.00	5,394.62	0.00
78	603107	上海汽配	270.00	4,911.30	0.00
79	001306	夏厦精密	64.00	4,823.04	0.00

80	001326	联域股份	99.00	4,815.36	0.00
81	603193	润本股份	278.00	4,631.48	0.00
82	603062	麦加芯彩	79.00	4,566.99	0.00
83	603075	热威股份	182.00	4,242.42	0.00
84	001358	兴欣新材	87.00	3,841.92	0.00
85	001239	永达股份	189.00	3,764.88	0.00
86	603273	天元智能	178.00	3,376.66	0.00
87	603276	恒兴新材	134.00	3,333.92	0.00
88	603231	索宝蛋白	151.00	3,251.03	0.00
89	603373	安邦护卫	88.00	3,058.00	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	300750	宁德时代	37,818,659.59	1.78
2	000858	五粮液	21,104,544.65	1.00
3	000333	美的集团	20,982,817.00	0.99
4	600519	贵州茅台	19,640,025.50	0.93
5	000568	泸州老窖	17,731,885.00	0.84
6	002594	比亚迪	16,016,770.00	0.76
7	300760	迈瑞医疗	14,400,516.00	0.68
8	300059	东方财富	14,180,798.68	0.67
9	002475	立讯精密	13,846,010.00	0.65
10	000651	格力电器	12,402,326.00	0.59
11	000725	京东方 A	11,565,736.00	0.55
12	300124	汇川技术	10,951,946.50	0.52
13	002415	海康威视	10,575,920.00	0.50
14	002714	牧原股份	10,147,543.00	0.48
15	300498	温氏股份	8,403,172.00	0.40
16	300122	智飞生物	7,814,368.00	0.37
17	002352	顺丰控股	7,664,963.00	0.36
18	000001	平安银行	7,525,324.00	0.36
19	000063	中兴通讯	7,254,359.00	0.34
20	002230	科大讯飞	7,245,689.00	0.34

##### 8.4.2 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	300750	宁德时代	60,047,437.20	2.83
2	000858	五粮液	33,423,197.00	1.58
3	600519	贵州茅台	24,924,537.40	1.18
4	000333	美的集团	24,535,548.62	1.16
5	002594	比亚迪	23,668,929.90	1.12
6	000568	泸州老窖	23,418,890.00	1.11
7	300059	东方财富	20,197,706.80	0.95
8	002415	海康威视	17,558,878.85	0.83
9	000651	格力电器	15,881,047.00	0.75
10	002475	立讯精密	14,599,212.00	0.69
11	000725	京东方 A	14,432,525.00	0.68
12	300760	迈瑞医疗	13,722,054.40	0.65
13	002714	牧原股份	12,643,836.00	0.60
14	300124	汇川技术	12,000,889.92	0.57
15	000001	平安银行	11,872,662.00	0.56
16	002352	顺丰控股	11,706,213.00	0.55
17	000792	盐湖股份	11,616,180.00	0.55
18	300274	阳光电源	10,722,008.15	0.51
19	000063	中兴通讯	10,363,569.00	0.49
20	300015	爱尔眼科	10,361,143.72	0.49

#### 8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	724,701,919.90
卖出股票的收入（成交）总额	926,303,728.23

注：不考虑相关交易费用

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。

本基金可根据风险管理原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整带来的交易成本，追求对标的指数的紧密跟踪。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资政策。

#### 8.11.2 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，宁德时代新能源科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宁德市市场监督管理局的处罚。招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局深圳市分局、上海银保监局、中国银行间市场交易商协会、国家金融监督管理总局宁波监管局的处罚。兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆证监局、上海银保监局、福建证监局、湖北银保监局、中国银行间市场交易商协会的处罚。

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。

8.12.2 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。

**8.12.3 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	43,253.05
2	应收清算款	1,558,439.50
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	ETF 申赎证券清算款	7,396,295.50
9	其他	-
10	合计	8,997,988.05

**8.12.4 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。

**8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

**8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301487	盟固利	35,512.32	0.00	新股锁定
2	688548	广钢气体	32,691.00	0.00	新股锁定
3	688563	航材股份	29,640.10	0.00	新股锁定
4	301348	蓝箭电子	27,321.41	0.00	新股锁定
5	688582	芯动联科	25,058.16	0.00	新股锁定



## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
1,408	303,475.97	421,888,430.00	98.73%	5,405,735.00	1.27%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国工商银行股份有限公司—国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	420,494,700.00	98.41%
2	广发证券股份有限公司	1,218,659.00	0.29%
3	华泰证券股份有限公司	154,771.00	0.04%
4	华夏基金—民生银行—华夏基金—瑞博多资产策略 1 号集合资产管理计划	13,400.00	0.00%
5	香港中央结算有限公司	5,900.00	0.00%
6	深圳昱恒晟贸易有限公司	1,000.00	0.00%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	0.00	0.00%

注：截止本报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019 年 11 月 25 日)基金份额总额	500,986,890.00
本报告期期初基金份额总额	481,294,165.00
本报告期基金总申购份额	340,200,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	394,200,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	427,294,165.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 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。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 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。本基金报告年度支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 6 万元人民币。目前该事务所已向本基金提供连续 2 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 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，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
光大证券股份有限公司	1	499,807,288.51	30.72%	461,188.52	30.49%	-
申万宏源证券有限公司	1	250,941,428.98	15.42%	234,856.90	15.52%	-
国泰君安证券股份有限公司	1	229,366,794.80	14.10%	215,423.85	14.24%	-
东方证券股份有限公司	1	219,429,741.98	13.49%	205,364.83	13.57%	-
浙商证券股份有限公司	1	192,891,555.33	11.86%	178,873.80	11.82%	-
招商证券股份有限公司	1	157,661,273.41	9.69%	145,253.16	9.60%	-
国信证券股份有限公司	1	73,864,170.85	4.54%	69,041.10	4.56%	-
兴业证券股份有限公司	1	2,993,885.59	0.18%	2,814.98	0.19%	-
华安证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	3	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	1	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序

(1) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的选择标准

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其专用交易单元供本基金买卖证券专用，选用标准为：

- A 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- B 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- C 经营行为规范，近一年未发生重大违规行为而受到证监会处罚。
- D 内部管理规范、严格，具备健全的内部控制制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- E 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设备符合代理本基金进行证券交易的要求，并能为本基金提供全面的信息服务。
- F 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供周到的咨询服务。

(2) 选择使用基金专用交易单元的证券经营机构的程序

基金管理人根据上述标准考察证券经营机构后，与被选中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，基金管理人将根据各证券经营机构的研究报告、信息服务质量等情况，根据如下选择标准细化的评价体系进行评比排名：

- A 提供的研究报告质量和数量；
- B 研究报告被基金采纳的情况；
- C 因采纳其报告而为基金运作带来的直接效益和间接效益；
- D 因采纳其报告而为基金运作避免或减少的损失；
- E 由基金管理人提出课题，证券经营机构提供的研究论文质量；
- F 证券经营机构协助我公司研究员调研情况；
- G 与证券经营机构研究员交流和共享研究资料情况；
- H 其他可评价的量化标准。

基金管理人不但对已使用交易单元的证券经营机构进行排名，同时亦关注并接受其他证券经营机构的研究报告和信息资讯。对于达到有关标准的证券经营机构将继续保留，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。对于不能达到有关标准的证券经营机构则将退出基金管理人的选择名单，基金管理人将重新选择其它经营稳健、研究能力强、信息服务质量高的证券经营机构，租用其交易单元。若证券经营机构所提供的研究报告及其他信息服务不符合要求，基金管理人有权提前中止租用其交易单元。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况

华西证券深圳席位（013235）、华安证券深圳席位（011661）为本年度新增席位；平安证券上海席位（61234）为本年度退租席位。

**11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
光大证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券有限公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
浙商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
招商证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国信证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
兴业证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华安证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华西证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
国金证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
中国国际金融股份有限公司	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资	规定网站、上海证券交	2023-01-20

	基金 2022 年第 4 季度报告	易所	
2	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
3	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-03-31
4	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年年度报告提示性公告	规定报刊	2023-03-31
5	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-22
6	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 1 季度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-04-22
7	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-22
8	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新（2023 年第 1 号）	规定网站、上海证券交易所	2023-05-18
9	国联安沪深 300 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、上海证券交易所	2023-05-18
10	国联安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加伯嘉基金为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2023-05-26
11	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年 2 季度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-07-21
12	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-07-21
13	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告	规定网站、上海证券交易所	2023-08-31
14	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年中期报告提示性公告	规定报刊	2023-08-31
15	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	规定报刊、规定网站	2023-09-07
16	国联安基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2023-10-25
17	国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 3 季度报告	规定网站、上海证券交易所	2023-10-25
18	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	规定报刊、规定网站、深圳证券交易所、上海证券交易所	2023-12-19

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	期初份	申购份	赎回份额	持有份额	份额占比

		例达到或者超过 20%的时间区间	额	额			
联接基金	1	2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	453,739,300.00	427,883,000.00	461,127,600.00	420,494,700.00	98.41%
产品特有风险							
<p>(1) 持有份额比例较高的投资者（“高比例投资者”）大额赎回时易使本基金发生巨额赎回或连续巨额赎回，中小投资者可能面临赎回申请需要与高比例投资者按同比例部分延期办理的风险，赎回款项延期获得。</p> <p>(2) 基金净值大幅波动的风险 高比例投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动；若高比例投资者赎回的基金份额收取赎回费，相应的赎回费用按约定将部分或全部归入基金资产，可能对基金资产净值造成较大波动。</p> <p>(3) 基金规模较小导致的风险 高比例投资者赎回后，可能导致基金规模较小，从而使得基金投资及运作管理的难度增加。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p>							

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。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金发行及募集的文件
- 2、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 3、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》
- 4、《国联安沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 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

### 13.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

### 13.3 查阅方式

网址：[www.cpicfunds.com](http://www.cpicfunds.com)

国联安基金管理有限公司

二〇二四年三月二十九日