

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

2021 年第 1 季度报告

2021 年 3 月 31 日

基金管理人：国联安基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年四月二十二日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

报告期内，本基金管理人对本基金进行了基金份额拆分。本基金管理人按照 1:2 的基金份额拆分比例，对 2021 年 3 月 25 日（权益登记日）登记在册的各基金份额持有人的基金份额进行了拆分，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于 2021 年 3 月 26 日完成了变更登记。自基金份额拆分日（2021 年 3 月 26 日）起，本基金最小申购、赎回单位由 100 万份调整为 200 万份。基金份额拆分后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额拆分对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额拆分后，基金份额持有人按照拆分后的基金份额享有权利并承担义务。因基金份额拆分导致基金份额净值变化，不改变基金的风险收益特征，也不降低基金投资的风险或提高基金投资的预期收益。具体可查阅本基金管理人于 2021 年 3 月 29 日发布的《关于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份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 3 月 31 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------|------------|
| 基金简称 | 国联安半导体 ETF |
| 场内简称 | 半导体 |

| | |
|------------|--|
| 基金主代码 | 512480 |
| 交易代码 | 512480 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019 年 5 月 8 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 10,683,003,600.00 份 |
| 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 | <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定量的全方面分析，评估其相对投资价值后作出相应的投资决策。</p> <p>4、中小企业私募债券投资策略</p> <p>本基金对可选的中小企业私募债券品种进行筛选，根据基金资产组合情况可适度进行投资。</p> <p>5、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</p> |

| | |
|--------|---|
| | <p>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>6、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>7、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 | 中证全指半导体产品与设备指数收益率 |
| 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。 |
| 基金管理人 | 国联安基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 国泰君安证券股份有限公司 |

注：本表所列的基金主代码512480为本基金二级市场交易代码，本基金一级市场申购赎回代码为512481。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期 (2021 年 1 月 1 日-2021 年 3 月 31 日) |
|----------------|---|
| 1.本期已实现收益 | 259,368.72 |
| 2.本期利润 | -1,533,835,181.42 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | -0.2869 |
| 4.期末基金资产净值 | 9,538,051,484.23 |

| | |
|------------|--------|
| 5.期末基金份额净值 | 0.8928 |
|------------|--------|

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交易基金的各项费用，计入费用后实际收益要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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 | 净值增长率① | 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 | -14.67% | 2.10% | -14.89% | 2.13% | 0.22% | -0.03% |
| 过去六个月 | -9.48% | 2.07% | -9.88% | 2.11% | 0.40% | -0.04% |
| 过去一年 | 12.54% | 2.40% | 12.06% | 2.44% | 0.48% | -0.04% |
| 过去三年 | - | - | - | - | - | - |
| 过去五年 | - | - | - | - | - | - |
| 自基金合同生效起至今 | 78.56% | 2.51% | 104.00% | 2.61% | -25.44% | -0.10% |

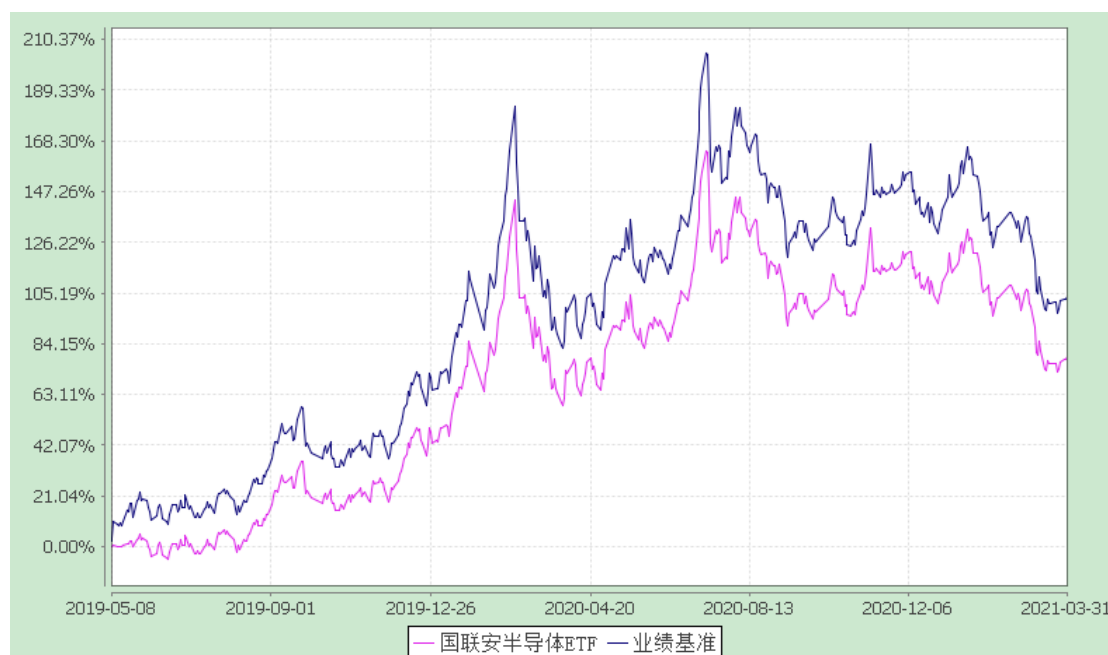
注：上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2019 年 5 月 8 日至 2021 年 3 月 31 日）



- 注：1、本基金业绩比较基准为中证全指半导体产品与设备指数收益率；
- 2、本基金基金合同于2019年5月8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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 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 | 2019-05-08 | - | 19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、总经理特别助理、债券投资助理、基金经理助理。现任量化投资部总监助理。2010年4月起担任国联安中证100指数证 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | <p>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 联安中小 企业综合 指数证券 投资基金 (LOF) (原国联 安双力中 小板综指 证券投</p> | | | | <p>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 基金和国联安中小企业综 合指数证券投资基金(LOF) (原国联安双力中小板综 指证券投资基金(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。</p> |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|--|
| | <p>资基金 (LOF)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</p> | | | | |
|--|---|--|--|--|--|

| | | | | | |
|-----|--|------------|---|--------------------|--|
| | 资基金 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 安沪深 300 交 易型开 放式指 数证券 投资基 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 | 2020-08-13 | - | 13 年（自 2008 年起） | 章榭元先生，硕士研究生。2008 年 7 月至 2011 年 5 月就职于建信基金管理有限公司任研究员；2011 年 5 月至 2015 年 5 月就职于富国基金管理有限公司任基金经理助理、基金经理；2015 年 5 月至 2019 年 5 月就职于融通基金管理有限公司，历任专户投资经理、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，任量化投资部总经理。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、国联安中证全指半导体产品与设备交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国联安沪深 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。 |

| | | | | | |
|--|---------------------------------------|--|--|--|--|
| | 资基金 基金经 理、量 化投资 部总经 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。

4.2 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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2021 年一季度，A 股市场在经历了春节前的大幅上扬之后，出现了较大的回调。受疫情的影响，2021 年春节大部分人选择“就地过年”，春节期间影院、餐饮等方面的消费数据的大幅增长显现出中国经济的韧性，零星的新冠阳性案例在有效的措施下迅速得以控制。中国崛起的道路势不可挡，A 股的资产在可预见的未来，应该还是资产配置的首选投资标的之一。

对于半导体行业来说，全球范围内的芯片荒依旧存在，整个行业的利润增长仍处于高位，全球半导体行业的代表性指数——费城半导体指数，已经不断创了新高，而 A 股相应的半导体公司的股价已经出现了较大程度的回调，更具长期投资价值。一季度大小盘股表现分化较大，大盘蓝筹股表现较好。整个一季度沪深 300 指数下跌 3.13%，创业板综指下跌 8.33%，中证半导体指数下跌 14.89%。依据基金合同的约定，本基金始终保持较高的仓位，以完全复制的方式跟踪中证半导体指数，将跟踪误差控制在合理范围。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止报告期末，本基金份额净值为 0.8928 元，本报告期份额净值增长率为-14.67%，同期业绩比较基准收益率为-14.89%。本报告期内，日均跟踪偏离度为 0.03%，年化跟踪误差为 0.52%，分别符合基金合同约定的日均跟踪偏离度绝对值不超过 0.25%，以及年化跟踪误差不得超过 3.0%的限制。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 9,409,595,906.97 | 98.53 |
| | 其中：股票 | 9,409,595,906.97 | 98.53 |
| 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 | 128,296,018.55 | 1.34 |
| 8 | 其他各项资产 | 12,040,995.90 | 0.13 |
| 9 | 合计 | 9,549,932,921.42 | 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5.2的合计项不含可退替代款估值增值；

2、报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为292,640,473.00元，占基金资产净值的比例为3.07%；

3、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 指数投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 8,823,575,773.34 | 92.51 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |

| | | | |
|---|-----------------|------------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 583,380,986.56 | 6.12 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| 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 | 9,406,956,759.90 | 98.63 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,517,645.36 | 0.03 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 24,036.12 | 0.00 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 7,674.06 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 68,780.77 | 0.00 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 16,228.30 | 0.00 |

| | | | |
|---|---------------|--------------|------|
| 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 | 2,634,364.61 | 0.03 |

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票投资。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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前十名股票投资明细

| 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 | 603986 | 兆易创新 | 5,376,665 | 918,764,515.20 | 9.63 |
| 2 | 300782 | 卓胜微 | 1,481,648 | 902,323,632.00 | 9.46 |
| 3 | 002049 | 紫光国微 | 6,931,794 | 741,632,640.06 | 7.78 |
| 4 | 600584 | 长电科技 | 18,340,350 | 627,056,566.50 | 6.57 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 4,063,085 | 583,215,220.90 | 6.11 |
| 6 | 688008 | 澜起科技 | 7,280,066 | 445,540,039.20 | 4.67 |
| 7 | 002185 | 华天科技 | 35,692,848 | 416,892,464.64 | 4.37 |
| 8 | 603160 | 汇顶科技 | 3,680,667 | 412,455,544.02 | 4.32 |
| 9 | 688012 | 中微公司 | 3,501,705 | 376,468,304.55 | 3.95 |
| 10 | 300661 | 圣邦股份 | 1,550,444 | 358,617,697.20 | 3.76 |

5.3.2 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前五名股票投资明细

| 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 | 300999 | 金龙鱼 | 12,114.00 | 912,789.90 | 0.01 |
| 2 | 688578 | 艾力斯 | 10,734.00 | 284,558.34 | 0.00 |
| 3 | 688626 | 翔宇医疗 | 3,652.00 | 145,860.88 | 0.00 |
| 4 | 688667 | 菱电电控 | 1,191.00 | 133,665.93 | 0.00 |
| 5 | 300957 | 贝泰妮 | 853.00 | 107,827.73 | 0.00 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货，没有相关投资评价。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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，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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|---------------|
| 1 | 存出保证金 | 8,756,053.87 |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,913,215.70 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 371,726.33 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 12,040,995.90 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 600584 | 长电科技 | 50,088,350.00 | 0.53 | 转融通融出股票 |

| | | | | | |
|---|--------|------|---------------|------|---------|
| 2 | 300782 | 卓胜微 | 32,277,000.00 | 0.34 | 转融通融出股票 |
| 3 | 002371 | 北方华创 | 20,813,300.00 | 0.22 | 转融通融出股票 |
| 4 | 300661 | 圣邦股份 | 18,804,690.00 | 0.20 | 转融通融出股票 |
| 5 | 002049 | 紫光国微 | 13,737,516.00 | 0.14 | 转融通融出股票 |
| 6 | 002185 | 华天科技 | 10,037,792.00 | 0.11 | 转融通融出股票 |
| 7 | 603160 | 汇顶科技 | 1,255,072.00 | 0.01 | 转融通融出股票 |
| 8 | 688008 | 澜起科技 | 1,089,360.00 | 0.01 | 转融通融出股票 |

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|----------------|--------------|----------|
| 1 | 300999 | 金龙鱼 | 912,789.90 | 0.01 | 新股锁定 |
| 2 | 688578 | 艾力斯 | 284,558.34 | 0.00 | 新股锁定 |
| 3 | 688626 | 翔宇医疗 | 145,860.88 | 0.00 | 新股锁定 |
| 4 | 688667 | 菱电电控 | 133,665.93 | 0.00 | 新股锁定 |
| 5 | 300957 | 贝泰妮 | 107,827.73 | 0.00 | 新股锁定 |

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------|-------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 5,043,501,800.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 2,484,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 2,227,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额 | 5,382,501,800.00 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 10,683,003,600.00 |

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 |
| 联接基金 | 1 | 2021年1月1日至2021年3月31日 | 2,233,990,000 | 2,354,990,000 | 367,000,000.00 | 4,221,980,000.00 | 39.52% |
| 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</p> <p>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</p> <p>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：1.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。

2.本基金本报告期内进行了拆分，本期申购份额包含了拆分增加的份额。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

报告期内，本基金管理人对本基金进行了基金份额拆分。本基金管理人按照1:2的基金份额拆分比例，对2021年3月25日（权益登记日）登记在册的各基金份额持有人的基金份额进行了拆分，并由中国证券登记结算有限责任公司上海分公司于2021年3月26日完成了变更登记。自基金份额拆分日（2021年3月26日）起，本基金最小申购、赎回单位由100万份调整为200万份。基金份额拆分后，本基金的基金份额总额与基金份额持有人持有的基金份额数额发生调整，但调整后的基金份额持有人持有的基金份额占基金份额总额的比例不发生变化。基金份额拆分对基金份额持有人的权益无实质性影响。基金份额拆分后，基金份额持有人按照拆分后的基金份额享有权利并承担义务。因基金份额拆分导致基金份额净值变化，不改变基金的风险收益特征，也不降低基金投资的风险或提高基金投资的预期收益。具体可查阅本基金管理人于2021年3月29日发布的《关于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份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准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发行及募集的文件

2、《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合同》

3、《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招募说明书》

4、《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

9.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号 9 楼

9.3 查阅方式

网址：www.cpicfunds.com

国联安基金管理有限公司

二〇二一年四月二十二日