

国寿安保沪深 300 交易型开放式指数  
证券投资基金  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
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.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
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.....	10
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	55
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.....	55
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.....	55

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.....	55
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.....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	55
7.12 投资组合报告附注.....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	57
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	57
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>58</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	58
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.....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	58
10.4 基金投资策略的改变.....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	58
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>61</b>
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>61</b>
12.1 备查文件目录.....	61
12.2 存放地点.....	62
12.3 查阅方式.....	62

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保沪深 300ETF
场内简称	国寿 300
基金主代码	510380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,230,802,400.00 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	2018 年 2 月 7 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	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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	国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95599
传真	010-50850776	010-68121816
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈	北京市西城区复兴门内大街 28

	泰商务中心 2 号楼 11 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王军辉	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 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	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	47,174,912.61
本期利润	-286,950,668.21
加权平均基金份额本期利润	-0.1362
本期加权平均净值利润率	-11.67%
本期基金份额净值增长率	-8.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	267,721,642.78
期末可供分配基金份额利润	0.2175
期末基金资产净值	1,498,524,042.78
期末基金份额净值	1.2175
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	21.75%

注：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。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

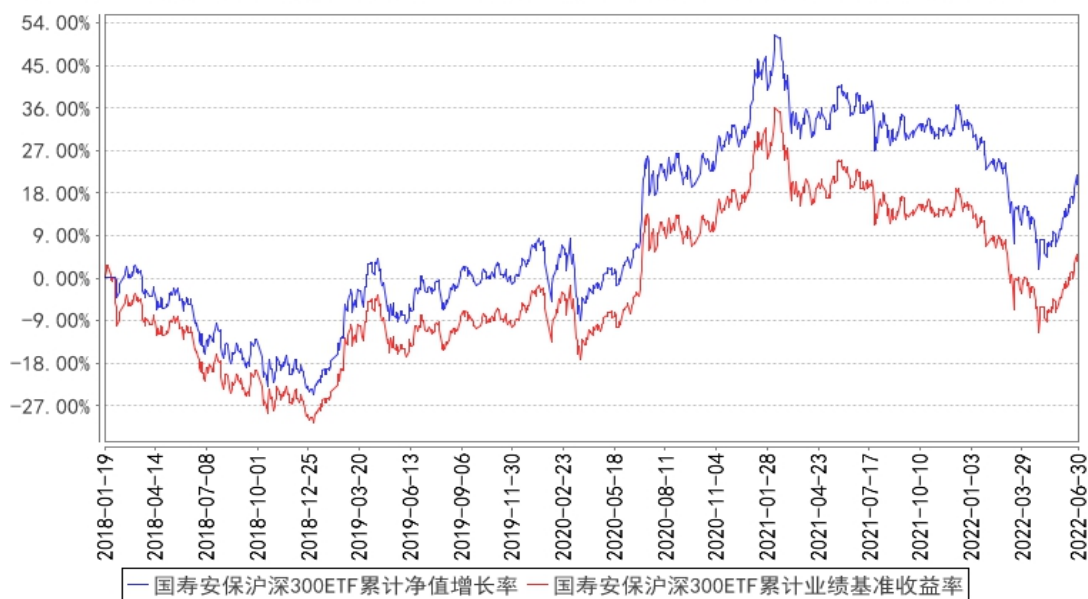
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.23%	1.06%	9.62%	1.07%	0.61%	-0.01%

过去三个月	7.03%	1.43%	6.21%	1.43%	0.82%	0.00%
过去六个月	-8.45%	1.45%	-9.22%	1.45%	0.77%	0.00%
过去一年	-12.14%	1.24%	-14.15%	1.25%	2.01%	-0.01%
过去三年	24.58%	1.25%	17.24%	1.27%	7.34%	-0.02%
自基金合同生效起至今	21.75%	1.30%	5.00%	1.33%	16.75%	-0.03%

### 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

国寿安保沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 01 月 19 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2018 年 01 月 19 日至 2022 年 06 月 30 日。

### 3.3 其他指标

无。

## § 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

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可（2013）1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 93 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 3219.57 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2387.69 亿元。

#### 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		
李康	基金经理	2018 年 1 月 19 日	-	13 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安三国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 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《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的



前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和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

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

### 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

上半年国内股票市场先抑后扬，阶段性结构分化和轮动明显，稳增长和科技是较为清晰的投资主线。一季度受欧洲地缘冲突和疫情反复影响整体表现较弱，至四月下旬 A 股触及低点，随着疫情有效控制和稳增长政策推进，投资者情绪和风险偏好修复，市场有所反弹。

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。本基金跟踪误差主要源自成分股调整、停复牌等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2175 元；本报告期基金份额净值增长率为 -8.45%，业绩比较基准收益率为 -9.22%。

### 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，国民经济韧性十足，长期向好的趋势没有发生改变。政策面和宏观流动性将保持对权益资产友好，国内通胀呈现 CPI 整体可控，PPI 逐步回落的趋势。随着经济复苏进程逐步恢复，企业盈利逐步向好，居民收入恢复增长也将带来消费逐步改善，部分低估值细分板块存在配置机会，科技成长板块也有望持续景气向好，整个

A 股的投资机会将不断涌现。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人以及各相关投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值

的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## § 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：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	18,712,014.16	24,987,335.59
结算备付金		56,537.69	-
存出保证金		91,688.88	45,055.62
交易性金融资产	6.4.7.2	1,486,524,790.87	2,901,402,176.17
其中：股票投资		1,486,202,766.87	2,896,943,176.17
基金投资		-	-
债券投资		322,024.00	4,459,000.00
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	29,191,868.29
应收股利		136,057.25	-
应收申购款		-	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	18,562.66	23,465.22
资产总计		1,505,539,651.51	2,955,649,900.89
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年6月30日</b>	<b>上年度末 2021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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,433,803.31	27,658,687.46
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		867,155.24	1,218,652.50
应付托管费		173,431.06	243,730.51
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,832.93	3,653.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	1,537,386.19	922,726.33
负债合计		7,015,608.73	30,047,450.31
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	1,230,802,400.00	2,199,802,400.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	267,721,642.78	725,800,050.58
净资产合计		1,498,524,042.78	2,925,602,450.58
负债和净资产总计		1,505,539,651.51	2,955,649,900.89

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2175 元，基金份额总额 1,230,802,400.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-279,106,317.84	117,241,291.41
1. 利息收入		703,472.96	851,465.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	64,092.52	197,183.63
债券利息收入		-	1,939.74
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		639,380.44	652,342.02
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,700,250.85	734,923,613.78
其中：股票投资收益	6.4.7.14	26,964,349.90	710,172,504.37
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	1,339,280.49	1,260,791.69
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	21,396,620.46	23,490,317.72
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）	6.4.7.20	-334,125,580.82	-621,579,957.05
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	4,615,539.17	3,046,169.29
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,844,350.37</b>	<b>15,344,309.07</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	6,133,407.01	9,421,862.81
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,226,681.49	1,884,372.56
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	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2,302.64	2,350.52
8. 其他费用	6.4.7.23	481,959.23	4,035,723.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-286,950,668.21</b>	<b>101,896,982.34</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-286,950,668.21</b>	<b>101,896,982.34</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-286,950,668.21</b>	<b>101,896,982.34</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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（基金净值）	2,199,802,400.00	-	725,800,050.58	2,925,602,450.58
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,199,802,400.00	-	725,800,050.58	2,925,602,450.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-969,000,000.00	-	-458,078,407.80	-1,427,078,407.80
（一）、综合收益总额	-	-	-286,950,668.21	-286,950,668.21
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-969,000,000.00	-	-171,127,739.59	-1,140,127,739.59
其中：1. 基金申购款	27,000,000.00	-	5,015,148.35	32,015,148.35
2. 基金赎回款	-996,000,000.00	-	-176,142,887.94	-1,172,142,887.94
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	1,230,802,400.00	-	267,721,642.78	1,498,524,042.78
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	3,672,802,400.00	-	1,334,913,683.53	5,007,716,083.53
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	3,672,802,400.00	-	1,334,913,683.53	5,007,716,083.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,524,000,000.00	-	-505,868,906.81	-2,029,868,906.81
（一）、综合收益总额	-	-	101,896,982.34	101,896,982.34
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-1,524,000,000.00	-	-607,765,889.15	-2,131,765,889.15
其中：1. 基金申购款	90,000,000.00	-	30,461,847.20	120,461,847.20
2. 基金赎回款	-1,614,000,000.00	-	-638,227,736.35	-2,252,227,736.35
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	2,148,802,400.00	-	829,044,776.72	2,977,847,176.72

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：

左季庆

王文英

韩占锋

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

国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2166 号《关于准予国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式

基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 294,788,000.00 元(含募集股票市值)，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61090605\_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 294,802,400.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 14,400.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司(以下简称“国寿安保”)，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]19 号文审核同意，本基金 294,802,400.00 份基金份额于 2018 年 2 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及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的相关规定)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，权证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。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿安保沪深 300ETF 联接基金”)。国寿安保沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国寿安保于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、



中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除金融资产和金融负债的分类、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认、收入/(损失)的确认和计量外,本报告期内所采用的会计政策、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

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

###### 6.4.5.1.1 金融资产和金融负债的分类

###### 新金融工具准则

金融工具,是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时,确认相关的金融资产或金融负债。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

###### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具,分别采用以下两种方式进行计量:

###### 以摊余成本计量:

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标,且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致,即在

特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

## (2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.5.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初

始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.5.1.3 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将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确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

##### 原金融工具准则（截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则）

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资

产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将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确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.5.1.4 会计政策变更对财务报表的影响

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计

量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 24,987,335.59 元、45,055.62 元、23,465.22 元和 29,191,868.29 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、其他资产-应收利息、其他资产-其他应收款和应收清算款，金额分别为 24,993,380.63 元、45,077.95 元、0.00 元、17,300.12 元和 29,191,868.29 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,901,402,176.17 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,901,402,273.90 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 27,658,687.46 元、1,218,652.50 元、243,730.51 元、477,516.95 元和 445,209.38 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 27,658,687.46 元、1,218,652.50 元、243,730.51 元、477,516.95 元和 445,209.38 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易



印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	18,712,014.16
等于：本金	18,707,154.71
加：应计利息	4,859.45
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
减：坏账准备	-
合计	18,712,014.16

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,353,023,741.99	-	1,486,202,766.87	133,179,024.88
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	322,000.00	24.00	322,024.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	322,000.00	24.00	322,024.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,353,345,741.99	24.00	1,486,524,790.87	133,179,024.88

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金于本报告期末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**

本基金于本报告期末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**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 债权投资**

本基金于本报告期内未进行债权投资。

**6.4.7.6 其他债权投资**

本基金于本报告期内未进行其他债权投资。

**6.4.7.7 其他权益工具投资**

本基金于本报告期内未进行其他权益工具投资。

**6.4.7.8 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	18,562.66
待摊费用	-
合计	18,562.66

**6.4.7.9 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	950,285.84
其中：交易所市场	950,285.84
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	219,095.94
应付指数使用费	368,004.41
合计	1,537,386.19

**6.4.7.10 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,199,802,400.00	2,199,802,400.00
本期申购	27,000,000.00	27,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-996,000,000.00	-996,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,230,802,400.00	1,230,802,400.00

注：本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期间无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 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
本期期初	867,206,951.54	-141,406,900.96	725,800,050.58
本期利润	47,174,912.61	-334,125,580.82	-286,950,668.21
本期基金份额交易产生的变动数	-388,647,651.53	217,519,911.94	-171,127,739.59
其中：基金申购款	10,747,596.37	-5,732,448.02	5,015,148.35
基金赎回款	-399,395,247.90	223,252,359.96	-176,142,887.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	525,734,212.62	-258,012,569.84	267,721,642.78

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	58,568.98
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	4,842.98	
其他	680.56	
合计	64,092.52	

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,009,239.95
股票投资收益——赎回差价收入	1,955,109.95
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	26,964,349.90

#### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	752,593,350.02
减：卖出股票成本总额	725,763,102.60
减：交易费用	1,821,007.47
买卖股票差价收入	25,009,239.95

#### 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,172,142,887.94
减：现金支付赎回款总额	503,051,706.94
减：赎回股票成本总额	667,136,071.05
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,955,109.95

#### 6.4.7.15 债券投资收益

##### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,870.71
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,337,409.78
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	1,339,280.49

##### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	18,590,881.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	17,034,500.00
减：应计利息总额	218,937.82

减：交易费用	33.90
买卖债券差价收入	1,337,409.78

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券产生的收益/损失。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金于本报告期间无贵金属投资产生的收益/损失。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

#### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	21,396,620.46
其中：证券出借权益补偿收入	812,218.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	21,396,620.46

#### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
1. 交易性金融资产	-334,125,580.82
股票投资	-334,125,580.82
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	-334,125,580.82

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	4,615,539.17
合计	4,615,539.17

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,858.88
指数使用费	368,004.41
合计	481,959.23

#### 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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

##### 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
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“国寿安保沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的联接基金

注：以下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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,133,407.01	9,421,862.81
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,226,681.49	1,884,372.56

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无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

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

#### 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

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间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 2022年6月30日		上年度末 2021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(%)
国寿安保沪深 300ETF 联接基 金	1,188,249,800.00	96.54	2,085,249,800.00	94.79

##### 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 2022年1月1日至2022年6月30 日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
农业银行	18,712,014.16	58,568.98	29,545,921.17	175,220.94

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行约定利率计息。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2022年6月30日，本基金持有2,261,100.00股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币7,986,728.62元，估值总额为人民币6,828,522.00元，占基金资产净值的比例为0.46%（2021年12月31日：本基金持有4,460,600.00股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币15,830,439.66元，估值总额为人民币13,114,164.00元，占基金资产净值的比例为0.45%）。

##### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

##### 6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

###### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	受限期	流通受	认购	期末估	数量	期末	期末估值总	备注



代码	名称	认购日		限类型	价格	值单价	(单 位:股)	成本总额	额	
300834	星辉环材	2022年 1月6日	6个月	新股流 通受限	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-
301103	何氏眼科	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	锁定期内 发生送股
301109	军信股份	2022年 4月6日	6个月	新股流 通受限	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	锁定期内 发生送股
301116	益客食品	2022年 1月10日	6个月	新股流 通受限	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-
301117	佳缘科技	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-
301120	新特电气	2022年 4月11日	6个月	新股流 通受限	13.73	15.49	1,032	14,169.36	15,985.68	-
301122	采纳股份	2022年 1月19日	6个月	新股流 通受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301130	西点药业	2022年 2月16日	6个月	新股流 通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301137	哈焊华通	2022年 3月14日	6个月	新股流 通受限	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-
301151	冠龙节能	2022年 3月30日	6个月	新股流 通受限	30.82	21.46	703	21,666.46	15,086.38	-
301158	德石股份	2022年 1月7日	6个月	新股流 通受限	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-
301181	标榜股份	2022年 2月11日	6个月	新股流 通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301196	唯科科技	2022年 1月4日	6个月	新股流 通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301206	三元生物	2022年 1月26日	6个月	新股流 通受限	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	锁定期内 发生送股

301212	联盛化学	2022年4月7日	6个月	新股流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301215	中汽股份	2022年2月28日	6个月	新股流通受限	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77	-
301216	万凯新材	2022年3月21日	6个月	新股流通受限	35.68	29.84	1,120	39,961.60	33,420.80	-
301219	腾远钴业	2022年3月10日	6个月	新股流通受限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	锁定期内发生送股
301236	软通动力	2022年3月8日	6个月	新股流通受限	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	锁定期内发生送股
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股流通受限	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301268	铭利达	2022年3月29日	6个月	新股流通受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
688197	首药控股	2022年3月16日	6个月	新股流通受限	39.90	23.20	24,261	968,013.90	562,855.20	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙22转债	2022年6月14日	18日	新债未上市	100.00	100.00	3,220	322,000.00	322,024.00	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，

在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、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。

4、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。

5、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。

#### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金于本报告期末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**

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

## 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000066	中国长城	2022年7月4日	10.82	25,600	276,992.00
2	000157	中联重科	2022年7月4日 -2022年7月4日	6.16	65,000	400,400.00
3	000301	东方盛虹	2022年7月7日	16.91	26,000	439,660.00
4	000425	徐工机械	2022年7月12日	5.39	50,000	269,500.00
5	000568	泸州老窖	2022年7月14日	246.54	8,000	1,972,320.00
6	000625	长安汽车	2022年7月8日	17.32	96,200	1,666,184.00
7	000651	格力电器	2022年7月5日	33.72	70,000	2,360,400.00
8	000703	恒逸石化	2022年7月4日 -2022年7月13日	10.51	26,200	275,362.00
9	000708	中信特钢	2022年7月7日	20.15	15,000	302,250.00
10	000768	中航西飞	2022年7月14日	30.29	10,000	302,900.00
11	000776	广发证券	2022年7月7日 -2022年7月14日	18.70	33,000	617,100.00
12	000786	北新建材	2022年7月4日	34.62	13,400	463,908.00
13	000792	盐湖股份	2022年7月12日	29.96	62,400	1,869,504.00
14	000800	一汽解放	2022年7月11日	9.34	13,000	121,420.00
15	000895	双汇发展	2022年7月11日	29.30	10,000	293,000.00
16	000938	紫光股份	2022年7月4日	19.40	18,900	366,660.00
17	001979	招商蛇口	2022年7月7日	13.43	41,000	550,630.00
18	002007	华兰生物	2022年7月13日	22.80	11,000	250,800.00
19	002008	大族激光	2022年7月12日	33.13	10,000	331,300.00
20	002050	三花智控	2022年7月12日	27.48	20,000	549,600.00
21	002074	国轩高科	2022年7月6日	45.60	14,000	638,400.00
22	002120	韵达股份	2022年7月8日	17.06	20,000	341,200.00
23	002129	TCL 中环	2022年7月11日	58.89	31,000	1,825,590.00
24	002179	中航光电	2022年7月8日	63.32	7,000	443,240.00
25	002202	金风科技	2022年7月14日	14.80	31,000	458,800.00
26	002241	歌尔股份	2022年7月7日	33.60	30,000	1,008,000.00
27	002252	上海莱士	2022年7月4日	5.93	20,000	118,600.00
28	002271	东方雨虹	2022年7月14日	51.47	10,000	514,700.00
29	002304	洋河股份	2022年7月4日	183.15	8,000	1,465,200.00
30	002352	顺丰控股	2022年7月11日	55.81	14,000	781,340.00
31	002410	广联达	2022年7月4日	54.44	12,500	680,500.00
32	002414	高德红外	2022年7月6日	12.87	18,200	234,234.00
33	002460	赣锋锂业	2022年7月14日	148.70	9,000	1,338,300.00
34	002466	天齐锂业	2022年7月4日	124.80	10,400	1,297,920.00
35	002475	立讯精密	2022年7月4日	33.79	20,600	696,074.00
36	002493	荣盛石化	2022年7月4日	15.39	48,000	738,720.00

37	002555	三七互娱	2022 年 7 月 8 日	21.23	20,000	424,600.00
38	002600	领益智造	2022 年 7 月 14 日	5.02	30,100	151,102.00
39	002601	龙佰集团	2022 年 7 月 14 日	20.05	16,000	320,800.00
40	002602	世纪华通	2022 年 7 月 7 日	4.82	66,000	318,120.00
41	002607	中公教育	2022 年 7 月 8 日 -2022 年 7 月 14 日	5.79	21,000	121,590.00
42	002709	天赐材料	2022 年 7 月 5 日	62.06	21,000	1,303,260.00
43	002714	牧原股份	2022 年 7 月 14 日	55.27	13,200	729,564.00
44	600009	上海机场	2022 年 7 月 7 日	56.70	12,600	714,420.00
45	600010	宝钢股份	2022 年 7 月 4 日	2.35	300,000	705,000.00
46	600011	华能国际	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 4 日	7.04	55,000	387,200.00
47	600015	华夏银行	2022 年 7 月 13 日	5.21	64,000	333,440.00
48	600025	华能水电	2022 年 7 月 7 日	6.99	27,000	188,730.00
49	600031	三一重工	2022 年 7 月 8 日	19.06	61,000	1,162,660.00
50	600048	保利发展	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 12 日	17.46	91,400	1,595,844.00
51	600050	中国联通	2022 年 7 月 14 日 -2022 年 7 月 14 日	3.46	200,000	692,000.00
52	600085	同仁堂	2022 年 7 月 7 日	52.88	10,000	528,800.00
53	600089	特变电工	2022 年 7 月 5 日	27.39	50,000	1,369,500.00
54	600104	上汽集团	2022 年 7 月 4 日	17.81	24,300	432,783.00
55	600111	北方稀土	2022 年 7 月 7 日	35.16	20,000	703,200.00
56	600115	中国东航	2022 年 7 月 8 日	5.49	25,000	137,250.00
57	600150	中国船舶	2022 年 7 月 7 日	18.98	16,000	303,680.00
58	600183	生益科技	2022 年 7 月 14 日	16.99	10,000	169,900.00
59	600196	复星医药	2022 年 7 月 7 日	44.09	8,000	352,720.00
60	600346	恒力石化	2022 年 7 月 5 日	22.24	30,000	667,200.00
61	600383	金地集团	2022 年 7 月 14 日	13.44	20,000	268,800.00
62	600438	通威股份	2022 年 7 月 6 日	59.86	42,000	2,514,120.00
63	600460	士兰微	2022 年 7 月 6 日	52.00	10,000	520,000.00
64	600489	中金黄金	2022 年 7 月 4 日	7.39	40,000	295,600.00
65	600570	恒生电子	2022 年 7 月 6 日	43.54	16,000	696,640.00
66	600588	用友网络	2022 年 7 月 8 日	21.71	25,000	542,750.00
67	600606	绿地控股	2022 年 7 月 6 日	3.96	54,300	215,028.00
68	600660	福耀玻璃	2022 年 7 月 6 日	41.81	19,000	794,390.00
69	600886	国投电力	2022 年 7 月 4 日	10.50	15,800	165,900.00
70	600893	航发动力	2022 年 7 月 14 日	45.51	15,000	682,650.00
71	600905	三峡能源	2022 年 7 月 4 日	6.29	113,000	710,770.00
72	600958	东方证券	2022 年 7 月 4 日	10.21	50,000	510,500.00
73	600989	宝丰能源	2022 年 7 月 14 日	14.65	20,000	293,000.00
74	601006	大秦铁路	2022 年 7 月 7 日	6.59	89,000	586,510.00
75	601012	隆基绿能	2022 年 7 月 5 日	66.63	20,300	1,352,589.00
76	601066	中信建投	2022 年 7 月 1 日	28.91	20,900	604,219.00

77	601088	中国神华	2022 年 7 月 8 日 -2022 年 7 月 11 日	33.30	39,500	1,315,350.00
78	601111	中国国航	2022 年 7 月 12 日 -2022 年 7 月 14 日	11.61	38,000	441,180.00
79	601117	中国化学	2022 年 7 月 12 日	9.41	47,000	442,270.00
80	601155	新城控股	2022 年 7 月 14 日	25.43	10,000	254,300.00
81	601186	中国铁建	2022 年 7 月 5 日	7.90	60,000	474,000.00
82	601216	君正集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 7 日	4.88	43,500	212,280.00
83	601225	陕西煤业	2022 年 7 月 5 日	21.18	50,000	1,059,000.00
84	601236	红塔证券	2022 年 7 月 7 日	9.13	13,000	118,690.00
85	601238	广汽集团	2022 年 7 月 7 日	15.24	33,000	502,920.00
86	601360	三六零	2022 年 7 月 14 日	8.52	32,000	272,640.00
87	601377	兴业证券	2022 年 7 月 14 日	7.05	60,000	423,000.00
88	601600	中国铝业	2022 年 7 月 8 日 -2022 年 7 月 14 日	4.75	80,000	380,000.00
89	601628	中国人寿	2022 年 7 月 8 日	31.08	25,000	777,000.00
90	601633	长城汽车	2022 年 7 月 7 日	37.04	18,000	666,720.00
91	601668	中国建筑	2022 年 7 月 4 日	5.32	127,000	675,640.00
92	601669	中国电建	2022 年 7 月 4 日	7.87	14,500	114,115.00
93	601788	光大证券	2022 年 7 月 4 日	15.76	25,700	405,032.00
94	601800	中国交建	2022 年 7 月 6 日	9.28	35,000	324,800.00
95	601808	中海油服	2022 年 7 月 12 日	13.95	7,000	97,650.00
96	601857	中国石油	2022 年 7 月 4 日	5.30	128,200	679,460.00
97	601878	浙商证券	2022 年 7 月 4 日	11.38	26,200	298,156.00
98	601888	中国中免	2022 年 7 月 6 日	232.93	10,000	2,329,300.00
99	601919	中远海控	2022 年 7 月 14 日	13.90	39,000	542,100.00
100	601985	中国核电	2022 年 7 月 4 日	6.86	73,000	500,780.00
101	601988	中国银行	2022 年 7 月 12 日 -2022 年 7 月 12 日	3.26	182,700	595,602.00
102	603369	今世缘	2022 年 7 月 4 日	51.00	10,000	510,000.00
103	603799	华友钴业	2022 年 7 月 14 日	95.62	10,000	956,200.00
104	603993	洛阳钼业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 12 日	5.73	90,000	515,700.00
合计	-	-	-	-	4,017,600	66,711,422.00

#### 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

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。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。

本基金管理人建立了以董事会风险管理委员会为核心的，由董事会风险管理委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的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。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的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，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

同时，本基金的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，本基金的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。

#### 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。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。



本基金的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 2022年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	18,712,014.16	-	-	-	18,712,014.16
结算备付金	56,537.69	-	-	-	56,537.69
存出保证金	91,688.88	-	-	-	91,688.88
交易性金融资产	-	-	322,024.00	1,486,202,766.87	1,486,524,790.87
应收股利	-	-	-	136,057.25	136,057.25
其他资产	-	-	-	18,562.66	18,562.66
资产总计	18,860,240.73	-	322,024.00	1,486,357,386.78	1,505,539,651.51
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	867,155.24	867,155.24
应付托管费	-	-	-	173,431.06	173,431.06
应付清算款	-	-	-	4,433,803.31	4,433,803.31
应交税费	-	-	-	3,832.93	3,832.93
其他负债	-	-	-	1,537,386.19	1,537,386.19
负债总计	-	-	-	7,015,608.73	7,015,608.73
利率敏感度缺口	18,860,240.73	-	322,024.00	1,479,341,778.05	1,498,524,042.78
上年度末 2021年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,987,335.59	-	-	-	24,987,335.59
存出保证金	45,055.62	-	-	-	45,055.62
交易性金融资产	-	-	4,459,000.00	2,896,943,176.17	2,901,402,176.17
应收利息	-	-	-	23,465.22	23,465.22
应收证券清算款	-	-	-	29,191,868.29	29,191,868.29
资产总计	25,032,391.21	-	4,459,000.00	2,926,158,509.68	2,955,649,900.89
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,218,652.50	1,218,652.50
应付托管费	-	-	-	243,730.51	243,730.51
应付证券清算款	-	-	-	27,658,687.46	27,658,687.46
应付交易费用	-	-	-	477,516.95	477,516.95
应交税费	-	-	-	3,653.51	3,653.51
其他负债	-	-	-	445,209.38	445,209.38
负债总计	-	-	-	30,047,450.31	30,047,450.31
利率敏感度缺口	25,032,391.21	-	4,459,000.00	2,896,111,059.37	2,925,602,450.58

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 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.02%(2021 年 12 月 31 日：0.15%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

基金管理人通过对宏观经济和资本市场的深入分析，采用主动的投资管理策略，把握不同时期各金融市场的收益水平，在约定的投资比例下，合理配置股票、债券、货币市场工具等各类资产，在严格控制下行风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	1,486,202,766.87	99.18	2,896,943,176.17	99.02
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	322,024.00	0.02	4,459,000.00	0.15
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	1,486,524,790.87	99.20	2,901,402,176.17	99.17

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是报告期内所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）	
分析	+5%	74,646,128.00	144,817,321.30
	-5%	-74,646,128.00	-144,817,321.30

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,485,156,494.69	2,893,495,981.05

第二层次	322,024.00	4,839,229.35
第三层次	1,046,272.18	3,066,965.77
合计	1,486,524,790.87	2,901,402,176.17

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(2021 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,486,202,766.87	98.72
	其中：股票	1,486,202,766.87	98.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	322,024.00	0.02
	其中：债券	322,024.00	0.02
	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	-	-

	产		
7	银行存款和结算备付金合计	18,768,551.85	1.25
8	其他各项资产	246,308.79	0.02
9	合计	1,505,539,651.51	100.00

## 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	18,060,543.30	1.21
B	采矿业	41,853,611.64	2.79
C	制造业	884,543,178.04	59.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,346,337.08	2.49
E	建筑业	28,970,019.48	1.93
F	批发和零售业	3,841,188.44	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	39,405,208.69	2.63
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,707,286.17	3.05
J	金融业	299,404,105.28	19.98
K	房地产业	27,858,421.80	1.86
L	租赁和商务服务业	20,902,325.63	1.39
M	科学研究和技术服务业	22,718,170.90	1.52
N	水利、环境和公共设施管理业	48,419.37	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	761,964.00	0.05
Q	卫生和社会工作	13,013,506.73	0.87
R	文化、体育和娱乐业	1,768,480.32	0.12
S	综合	-	-
	合计	1,486,202,766.87	99.18

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

## 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	600519	贵州茅台	44,418	90,834,810.00	6.06
2	300750	宁德时代	99,000	52,866,000.00	3.53
3	600036	招商银行	875,876	36,961,967.20	2.47
4	601318	中国平安	766,407	35,783,542.83	2.39
5	601012	隆基绿能	428,868	28,575,474.84	1.91
6	000858	五粮液	137,301	27,725,190.93	1.85
7	002594	比亚迪	64,126	21,385,379.74	1.43

8	000333	美的集团	346,500	20,925,135.00	1.40
9	601166	兴业银行	1,028,825	20,473,617.50	1.37
10	300059	东方财富	748,192	19,004,076.80	1.27
11	600900	长江电力	804,440	18,598,652.80	1.24
12	601888	中国中免	69,051	16,084,049.43	1.07
13	603259	药明康德	145,192	15,098,516.08	1.01
14	600030	中信证券	690,745	14,961,536.70	1.00
15	600887	伊利股份	362,301	14,111,623.95	0.94
16	000568	泸州老窖	52,000	12,820,080.00	0.86
17	002415	海康威视	333,900	12,087,180.00	0.81
18	002475	立讯精密	350,805	11,853,700.95	0.79
19	601398	工商银行	2,478,800	11,823,876.00	0.79
20	600276	恒瑞医药	315,828	11,714,060.52	0.78
21	600438	通威股份	191,100	11,439,246.00	0.76
22	000651	格力电器	334,914	11,293,300.08	0.75
23	600809	山西汾酒	34,498	11,204,950.40	0.75
24	600309	万华化学	111,098	10,775,395.02	0.72
25	300760	迈瑞医疗	34,300	10,742,760.00	0.72
26	000725	京东方 A	2,655,400	10,462,276.00	0.70
27	002714	牧原股份	188,290	10,406,788.30	0.69
28	000001	平安银行	686,600	10,285,268.00	0.69
29	002142	宁波银行	280,250	10,035,752.50	0.67
30	000002	万 科 A	481,600	9,872,800.00	0.66
31	601328	交通银行	1,943,500	9,678,630.00	0.65
32	601899	紫金矿业	1,019,286	9,509,938.38	0.63
33	002812	恩捷股份	37,882	9,487,546.90	0.63
34	002129	TCL 中环	160,100	9,428,289.00	0.63
35	000792	盐湖股份	307,300	9,206,708.00	0.61
36	002466	天齐锂业	73,100	9,122,880.00	0.61
37	603288	海天味业	98,313	8,883,562.68	0.59
38	600048	保利发展	508,500	8,878,410.00	0.59
39	300124	汇川技术	130,550	8,599,328.50	0.57
40	603799	华友钴业	89,826	8,589,162.12	0.57
41	300015	爱尔眼科	191,667	8,580,931.59	0.57
42	002460	赣锋锂业	56,950	8,468,465.00	0.57
43	600031	三一重工	420,400	8,012,824.00	0.53
44	601668	中国建筑	1,483,300	7,891,156.00	0.53
45	002304	洋河股份	42,700	7,820,505.00	0.52
46	300014	亿纬锂能	80,200	7,819,500.00	0.52
47	601088	中国神华	233,462	7,774,284.60	0.52
48	002352	顺丰控股	138,700	7,740,847.00	0.52
49	300498	温氏股份	359,500	7,653,755.00	0.51

50	600436	片仔癀	21,300	7,598,349.00	0.51
51	600690	海尔智家	267,912	7,356,863.52	0.49
52	002271	东方雨虹	142,750	7,347,342.50	0.49
53	600089	特变电工	268,100	7,343,259.00	0.49
54	300274	阳光电源	73,600	7,231,200.00	0.48
55	601816	京沪高铁	1,389,300	6,974,286.00	0.47
56	601288	农业银行	2,261,100	6,828,522.00	0.46
57	603986	兆易创新	47,289	6,724,968.69	0.45
58	600837	海通证券	683,400	6,704,154.00	0.45
59	600000	浦发银行	829,898	6,647,482.98	0.44
60	600016	民生银行	1,755,100	6,528,972.00	0.44
61	603501	韦尔股份	37,243	6,444,156.29	0.43
62	600406	国电南瑞	236,845	6,394,815.00	0.43
63	300122	智飞生物	56,600	6,283,166.00	0.42
64	601919	中远海控	448,280	6,231,092.00	0.42
65	688981	中芯国际	137,100	6,192,807.00	0.41
66	000625	长安汽车	351,210	6,082,957.20	0.41
67	600585	海螺水泥	169,754	5,988,921.12	0.40
68	600919	江苏银行	835,200	5,946,624.00	0.40
69	002709	天赐材料	95,300	5,914,318.00	0.39
70	601688	华泰证券	416,160	5,909,472.00	0.39
71	600104	上汽集团	330,637	5,888,644.97	0.39
72	601225	陕西煤业	274,300	5,809,674.00	0.39
73	000063	中兴通讯	224,900	5,741,697.00	0.38
74	002049	紫光国微	30,040	5,699,188.80	0.38
75	601601	中国太保	242,109	5,696,824.77	0.38
76	002241	歌尔股份	169,300	5,688,480.00	0.38
77	300142	沃森生物	113,227	5,479,054.53	0.37
78	002230	科大讯飞	131,600	5,424,552.00	0.36
79	600111	北方稀土	154,100	5,418,156.00	0.36
80	000661	长春高新	22,900	5,345,318.00	0.36
81	002459	晶澳科技	66,320	5,232,648.00	0.35
82	002371	北方华创	18,700	5,182,144.00	0.35
83	688599	天合光能	76,777	5,009,699.25	0.33
84	300450	先导智能	77,560	4,900,240.80	0.33
85	601988	中国银行	1,490,600	4,859,356.00	0.32
86	601211	国泰君安	319,449	4,855,624.80	0.32
87	002027	分众传媒	715,940	4,818,276.20	0.32
88	000338	潍柴动力	384,400	4,793,468.00	0.32
89	000100	TCL 科技	992,700	4,755,033.00	0.32
90	601169	北京银行	1,046,424	4,750,764.96	0.32
91	600660	福耀玻璃	113,300	4,737,073.00	0.32

92	601229	上海银行	703,335	4,606,844.25	0.31
93	601985	中国核电	667,400	4,578,364.00	0.31
94	600050	中国联通	1,313,700	4,545,402.00	0.30
95	600745	闻泰科技	52,910	4,503,170.10	0.30
96	601766	中国中车	859,300	4,468,360.00	0.30
97	601390	中国中铁	727,000	4,463,780.00	0.30
98	600893	航发动力	94,300	4,291,593.00	0.29
99	601669	中国电建	541,424	4,261,006.88	0.28
100	300347	泰格医药	37,109	4,247,125.05	0.28
101	601658	邮储银行	771,100	4,156,229.00	0.28
102	603659	璞泰来	49,240	4,155,856.00	0.28
103	000776	广发证券	209,700	3,921,390.00	0.26
104	600028	中国石化	946,000	3,859,680.00	0.26
105	600009	上海机场	68,063	3,859,172.10	0.26
106	600905	三峡能源	607,300	3,819,917.00	0.25
107	601009	南京银行	364,401	3,797,058.42	0.25
108	600019	宝钢股份	630,096	3,793,177.92	0.25
109	600010	包钢股份	1,611,340	3,786,649.00	0.25
110	600999	招商证券	262,450	3,781,904.50	0.25
111	600958	东方证券	370,056	3,778,271.76	0.25
112	600196	复星医药	85,300	3,760,877.00	0.25
113	002410	广联达	67,300	3,663,812.00	0.24
114	300896	爱美客	6,100	3,660,061.00	0.24
115	601628	中国人寿	117,700	3,658,116.00	0.24
116	601857	中国石油	687,600	3,644,280.00	0.24
117	600570	恒生电子	82,596	3,596,229.84	0.24
118	000895	双汇发展	122,400	3,586,320.00	0.24
119	002179	中航光电	56,134	3,554,404.88	0.24
120	002311	海大集团	58,700	3,522,587.00	0.24
121	601818	光大银行	1,167,900	3,515,379.00	0.23
122	002050	三花智控	126,838	3,485,508.24	0.23
123	600760	中航沈飞	55,483	3,353,947.35	0.22
124	300759	康龙化成	35,100	3,342,222.00	0.22
125	600346	恒力石化	149,120	3,316,428.80	0.22
126	002493	荣盛石化	214,650	3,303,463.50	0.22
127	002074	国轩高科	70,700	3,223,920.00	0.22
128	601633	长城汽车	87,000	3,222,480.00	0.22
129	300661	圣邦股份	17,650	3,212,653.00	0.21
130	600926	杭州银行	209,966	3,145,290.68	0.21
131	300496	中科创达	24,100	3,144,568.00	0.21
132	600460	士兰微	60,200	3,130,400.00	0.21
133	300316	晶盛机电	45,600	3,082,104.00	0.21



134	600426	华鲁恒升	105,200	3,071,840.00	0.20
135	300782	卓胜微	22,741	3,070,035.00	0.20
136	000538	云南白药	50,780	3,066,604.20	0.20
137	688012	中微公司	26,100	3,047,175.00	0.20
138	001979	招商蛇口	224,600	3,016,378.00	0.20
139	002821	凯莱英	10,400	3,005,600.00	0.20
140	601989	中国重工	808,000	2,997,680.00	0.20
141	002001	新和成	131,100	2,990,391.00	0.20
142	000768	中航西飞	97,900	2,965,391.00	0.20
143	600176	中国巨石	169,623	2,953,136.43	0.20
144	002920	德赛西威	19,700	2,915,600.00	0.19
145	000596	古井贡酒	11,600	2,896,056.00	0.19
146	002202	金风科技	195,306	2,890,528.80	0.19
147	603993	洛阳钼业	501,200	2,871,876.00	0.19
148	601939	建设银行	473,900	2,871,834.00	0.19
149	000963	华东医药	61,959	2,798,068.44	0.19
150	601006	大秦铁路	421,300	2,776,367.00	0.19
151	600763	通策医疗	15,900	2,773,596.00	0.19
152	601138	工业富联	280,700	2,762,088.00	0.18
153	000166	申万宏源	637,800	2,736,162.00	0.18
154	601877	正泰电器	76,100	2,722,858.00	0.18
155	600584	长电科技	100,700	2,718,900.00	0.18
156	300207	欣旺达	85,400	2,698,640.00	0.18
157	601377	兴业证券	379,300	2,674,065.00	0.18
158	601066	中信建投	91,900	2,656,829.00	0.18
159	600588	用友网络	121,851	2,645,385.21	0.18
160	601600	中国铝业	555,400	2,638,150.00	0.18
161	600029	南方航空	358,318	2,619,304.58	0.17
162	600600	青岛啤酒	25,100	2,608,392.00	0.17
163	600383	金地集团	192,095	2,581,756.80	0.17
164	601186	中国铁建	326,400	2,578,560.00	0.17
165	600085	同仁堂	48,700	2,575,256.00	0.17
166	688111	金山办公	13,057	2,573,795.84	0.17
167	600741	华域汽车	111,500	2,564,500.00	0.17
168	600188	兖矿能源	64,800	2,558,304.00	0.17
169	601838	成都银行	153,400	2,543,372.00	0.17
170	600132	重庆啤酒	17,200	2,521,520.00	0.17
171	000786	北新建材	71,600	2,478,792.00	0.17
172	600795	国电电力	630,700	2,466,037.00	0.16
173	603806	福斯特	37,620	2,464,862.40	0.16
174	688005	容百科技	19,000	2,459,360.00	0.16
175	601111	中国国航	211,700	2,457,837.00	0.16

176	300408	三环集团	81,500	2,453,150.00	0.16
177	601117	中国化学	259,900	2,445,659.00	0.16
178	000876	新希望	159,000	2,432,700.00	0.16
179	603019	中科曙光	83,040	2,409,820.80	0.16
180	600150	中国船舶	126,800	2,406,664.00	0.16
181	300751	迈为股份	4,900	2,405,410.00	0.16
182	601238	广汽集团	156,000	2,377,440.00	0.16
183	600547	山东黄金	127,832	2,372,561.92	0.16
184	003816	中国广核	835,500	2,339,400.00	0.16
185	601800	中国交建	249,600	2,316,288.00	0.15
186	600989	宝丰能源	155,600	2,279,540.00	0.15
187	601100	恒立液压	36,918	2,278,578.96	0.15
188	600015	华夏银行	436,933	2,276,420.93	0.15
189	300999	金龙鱼	42,104	2,274,458.08	0.15
190	603369	今世缘	44,300	2,259,300.00	0.15
191	300763	锦浪科技	10,500	2,236,500.00	0.15
192	600886	国投电力	211,500	2,220,750.00	0.15
193	002648	卫星化学	85,300	2,205,005.00	0.15
194	688396	华润微	37,324	2,204,728.68	0.15
195	600011	华能国际	312,182	2,197,761.28	0.15
196	601868	中国能建	917,800	2,175,186.00	0.15
197	601788	光大证券	137,800	2,171,728.00	0.14
198	000157	中联重科	352,200	2,169,552.00	0.14
199	300601	康泰生物	47,468	2,144,604.24	0.14
200	000301	东方盛虹	126,600	2,140,806.00	0.14
201	600115	中国东航	388,900	2,135,061.00	0.14
202	603185	上机数控	13,560	2,115,224.40	0.14
203	000425	徐工机械	387,200	2,087,008.00	0.14
204	002236	大华股份	126,800	2,082,056.00	0.14
205	002601	龙佰集团	101,100	2,027,055.00	0.14
206	002555	三七互娱	94,200	1,999,866.00	0.13
207	603486	科沃斯	16,200	1,974,618.00	0.13
208	002008	大族激光	59,500	1,971,235.00	0.13
209	601916	浙商银行	593,500	1,970,420.00	0.13
210	000938	紫光股份	101,218	1,963,629.20	0.13
211	601901	方正证券	290,694	1,950,556.74	0.13
212	002736	国信证券	203,600	1,948,452.00	0.13
213	603833	欧派家居	12,897	1,943,319.96	0.13
214	300628	亿联网络	25,500	1,941,825.00	0.13
215	688008	澜起科技	32,000	1,938,560.00	0.13
216	603392	万泰生物	12,423	1,929,291.90	0.13
217	600941	中国移动	31,867	1,927,953.50	0.13

218	000977	浪潮信息	72,141	1,910,293.68	0.13
219	601336	新华保险	59,200	1,905,648.00	0.13
220	000069	华侨城 A	290,700	1,886,643.00	0.13
221	600352	浙江龙盛	184,000	1,873,120.00	0.12
222	600219	南山铝业	507,000	1,870,830.00	0.12
223	603290	斯达半导	4,800	1,852,320.00	0.12
224	300454	深信服	17,700	1,836,906.00	0.12
225	601995	中金公司	41,200	1,832,988.00	0.12
226	300595	欧普康视	31,574	1,805,717.06	0.12
227	603260	合盛硅业	15,200	1,792,992.00	0.12
228	002841	视源股份	23,700	1,785,084.00	0.12
229	688126	沪硅产业	77,100	1,771,758.00	0.12
230	601618	中国中冶	505,300	1,768,550.00	0.12
231	300413	芒果超媒	53,012	1,768,480.32	0.12
232	002007	华兰生物	77,545	1,768,026.00	0.12
233	600845	宝信软件	32,199	1,758,065.40	0.12
234	002120	韵达股份	102,691	1,751,908.46	0.12
235	300529	健帆生物	34,131	1,736,926.59	0.12
236	601799	星宇股份	10,100	1,727,100.00	0.12
237	601360	三六零	201,500	1,716,780.00	0.11
238	002252	上海莱士	286,300	1,697,759.00	0.11
239	300003	乐普医疗	89,000	1,652,730.00	0.11
240	603882	金域医学	19,900	1,642,745.00	0.11
241	000703	恒逸石化	155,210	1,631,257.10	0.11
242	601155	新城控股	63,800	1,622,434.00	0.11
243	300919	中伟股份	13,000	1,610,700.00	0.11
244	600332	白云山	50,000	1,579,500.00	0.11
245	601878	浙商证券	137,200	1,561,336.00	0.10
246	300433	蓝思科技	140,499	1,555,323.93	0.10
247	688169	石头科技	2,497	1,539,899.90	0.10
248	002602	世纪华通	317,801	1,531,800.82	0.10
249	688036	传音控股	17,072	1,523,334.56	0.10
250	600489	中金黄金	205,466	1,518,393.74	0.10
251	601021	春秋航空	25,853	1,508,522.55	0.10
252	600918	中泰证券	196,500	1,503,225.00	0.10
253	002938	鹏鼎控股	49,100	1,483,311.00	0.10
254	000066	中国长城	136,700	1,479,094.00	0.10
255	603899	晨光股份	26,093	1,463,295.44	0.10
256	300223	北京君正	13,700	1,455,625.00	0.10
257	300033	同花顺	15,118	1,453,595.70	0.10
258	000708	中信特钢	71,400	1,438,710.00	0.10
259	601728	中国电信	384,400	1,433,812.00	0.10

260	600183	生益科技	82,200	1,396,578.00	0.09
261	601865	福莱特	36,000	1,371,600.00	0.09
262	002916	深南电路	14,500	1,358,795.00	0.09
263	600018	上港集团	231,700	1,350,811.00	0.09
264	601898	中煤能源	129,800	1,347,324.00	0.09
265	600362	江西铜业	73,800	1,315,854.00	0.09
266	300957	贝泰妮	6,000	1,305,180.00	0.09
267	002414	高德红外	93,152	1,198,866.24	0.08
268	002791	坚朗五金	9,200	1,193,424.00	0.08
269	600161	天坛生物	48,780	1,184,378.40	0.08
270	601216	君正集团	238,800	1,165,344.00	0.08
271	600061	国投资本	182,016	1,157,621.76	0.08
272	601319	中国人保	227,300	1,150,138.00	0.08
273	002568	百润股份	37,280	1,119,891.20	0.07
274	000408	藏格矿业	33,600	1,106,784.00	0.07
275	688561	奇安信	19,418	1,083,524.40	0.07
276	601966	玲珑轮胎	42,300	1,073,151.00	0.07
277	600606	绿地控股	270,160	1,069,833.60	0.07
278	600655	豫园股份	110,500	1,043,120.00	0.07
279	601998	中信银行	216,300	1,027,425.00	0.07
280	002600	领益智造	200,700	1,007,514.00	0.07
281	603160	汇顶科技	16,182	1,002,151.26	0.07
282	688065	凯赛生物	8,800	983,840.00	0.07
283	688363	华熙生物	6,800	966,824.00	0.06
284	600025	华能水电	127,700	892,623.00	0.06
285	002064	华峰化学	105,200	887,888.00	0.06
286	601881	中国银河	91,700	886,739.00	0.06
287	603195	公牛集团	5,500	841,005.00	0.06
288	603087	甘李药业	15,920	763,682.40	0.05
289	300866	安克创新	11,500	762,680.00	0.05
290	002607	中公教育	131,600	761,964.00	0.05
291	002032	苏泊尔	11,413	643,008.42	0.04
292	000800	一汽解放	65,900	615,506.00	0.04
293	601236	红塔证券	66,350	605,775.50	0.04
294	601808	中海油服	42,100	587,295.00	0.04
295	688197	首药控股	24,261	562,855.20	0.04
296	605499	东鹏饮料	3,200	546,752.00	0.04
297	000877	天山股份	42,500	522,750.00	0.03
298	300979	华利集团	6,600	482,328.00	0.03
299	601825	沪农商行	67,500	423,225.00	0.03
300	601698	中国卫通	31,000	350,610.00	0.02
301	001289	龙源电力	10,700	232,832.00	0.02

302	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
303	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
304	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
305	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
306	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
307	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
308	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
309	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
310	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
311	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
312	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
313	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
314	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
315	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
316	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
317	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
318	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
319	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
320	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
321	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
322	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
323	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
324	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
325	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
326	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
327	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000792	盐湖股份	16,076,120.04	0.55
2	600089	特变电工	11,756,856.00	0.40
3	688005	容百科技	8,099,320.60	0.28
4	002920	德赛西威	6,626,140.13	0.23
5	300763	锦浪科技	6,284,305.00	0.21
6	300496	中科创达	6,127,421.33	0.21
7	002074	国轩高科	5,441,991.20	0.19
8	688012	中微公司	5,434,058.85	0.19
9	603185	上机数控	5,126,821.04	0.18
10	300919	中伟股份	4,873,044.00	0.17
11	000596	古井贡酒	4,831,963.00	0.17

12	600188	兖矿能源	4,790,575.00	0.16
13	300661	圣邦股份	4,516,168.48	0.15
14	300454	深信服	4,386,706.00	0.15
15	600460	士兰微	4,273,950.00	0.15
16	601117	中国化学	4,198,125.00	0.14
17	300207	欣旺达	4,170,831.00	0.14
18	002594	比亚迪	3,977,446.00	0.14
19	002648	卫星化学	3,724,314.00	0.13
20	600941	中国移动	3,671,248.18	0.13

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600519	贵州茅台	60,013,776.00	2.05
2	300750	宁德时代	43,415,915.00	1.48
3	002594	比亚迪	22,574,874.00	0.77
4	000858	五粮液	21,907,279.90	0.75
5	000333	美的集团	17,750,895.15	0.61
6	300059	东方财富	16,150,327.80	0.55
7	300760	迈瑞医疗	10,741,870.00	0.37
8	002475	立讯精密	10,654,383.00	0.36
9	002415	海康威视	10,323,765.00	0.35
10	000568	泸州老窖	10,139,208.68	0.35
11	000651	格力电器	9,665,962.00	0.33
12	002714	牧原股份	9,522,017.60	0.33
13	000001	平安银行	8,731,324.00	0.30
14	002812	恩捷股份	8,595,670.00	0.29
15	002142	宁波银行	8,515,652.90	0.29
16	000725	京东方 A	8,061,154.00	0.28
17	002466	天齐锂业	8,028,470.00	0.27
18	000002	万科 A	7,838,095.00	0.27
19	300124	汇川技术	7,508,484.96	0.26
20	300014	亿纬锂能	7,235,623.00	0.25

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 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	297,105,190.17
--------------	----------------

卖出股票收入（成交）总额	752,593,350.02
--------------	----------------

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	322,024.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	322,024.00	0.02

## 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙 22 转债	3,220	322,024.00	0.02

## 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 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

本基金本报告期末未持有权证。

## 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 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，贵州茅台酒股份有限公司、隆基绿能科

技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到生态环境部的处罚；招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局、中国人民银行或其分支行、中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚；浙商证券股份有限公司、兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚；东方财富信息股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到工信部的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局、地方应急管理厅的处罚；兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	91,688.88
2	应收清算款	-
3	应收股利	136,057.25
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	18,562.66
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	246,308.79

#### 7.12.4 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。

#### 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

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	601012	隆基绿能	1,352,589.00	0.09	转融通流通受限



## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

#### 8.1.1 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 (%)
259	4,752,132.82	1,229,146,400.00	99.87	1,656,000.00	0.13

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	友邦保险有限公司江苏分公司—传统—普通保险产品	30,226,200.00	2.46
2	中国中金财富证券有限公司 转融通担保证券明细账户	9,715,000.00	0.79
3	龚晓霞	550,000.00	0.04
4	海通证券股份有限公司	507,300.00	0.04
5	中信证券股份有限公司	448,000.00	0.04
6	赵华伟	116,800.00	0.01
7	王新红	115,000.00	0.01
8	张志义	100,000.00	0.01
9	吴思昆	100,000.00	0.01
10	黄庭兰	100,000.00	0.01
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保沪深 300 交易型 开放式指数证券投资基金联 接基金	1,188,249,800.00	96.54

### 8.3 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	500.00	0.00

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年1月19日） 基金份额总额	294,802,400.00
本报告期期初基金份额总额	2,199,802,400.00
本报告期基金总申购份额	27,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	996,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,230,802,400.00

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金于2018年12月28日发布公告，聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对其采取责令改正的监管措施，公司高度重视，已制定并实施相关整改措施。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
国泰君安	2	475,761,595.14	46.08	443,078.95	46.63	-
中信证券	2	267,975,752.15	25.95	249,563.30	26.26	-
海通证券	2	251,132,596.23	24.32	233,883.48	24.61	-
中银国际	2	37,636,638.78	3.65	23,760.11	2.50	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供

全面的交易信息服务；

(7)从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中信证券	20,197,451.30	71.14	-	-	-	-
海通证券	8,192,420.60	28.86	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

### 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	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 1 月 24 日
2	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 3 月 31 日
3	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 1 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
4	国寿安保沪深 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	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
5	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 22 日
6	国寿安保沪深 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	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日

7	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 2 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 20 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20220101~ 20220630	2,085,249,800.00	27,000,000.00	924,000,000.00	1,188,249,800.00	96.54
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。</p> <p>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,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

注：上述申购份额含交易所二级市场买入，赎回份额含交易所二级市场卖出。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

## 12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址: 北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

## 12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfoods.com.cn](http://www.gsfoods.com.cn)

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日