

国寿安保中证沪港深 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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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	6
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	7
3.3 其他指标	8
<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合规守信情况的说明	9
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	10
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	11
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	11
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
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	13
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	44
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>57</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 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证沪港深 300ETF
场内简称	AH300ETF
基金主代码	517300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,030,434,450.00 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	2021 年 2 月 24 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>1、组合复制策略</p> <p>本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和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偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，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，从而使投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>
业绩比较基准	中证沪港深 300 指数。
风险收益特征	<p>本基金为股票型指数基金，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。</p> <p>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、标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资标的包括港股通投资标的的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

## 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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	张燕
	联系电话	010-50850744	0755-83199084
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95555
传真		010-50850776	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		王军辉	缪建民

## 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	-53,420,928.20
本期利润	-171,779,599.06
加权平均基金份额本期利润	-0.0574
本期加权平均净值利润率	-7.58%
本期基金份额净值增长率	-7.12%
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	-641,499,648.20
期末可供分配基金份额利润	-0.2117
期末基金资产净值	2,388,934,801.80
期末基金份额净值	0.7883
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	-21.17%

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。

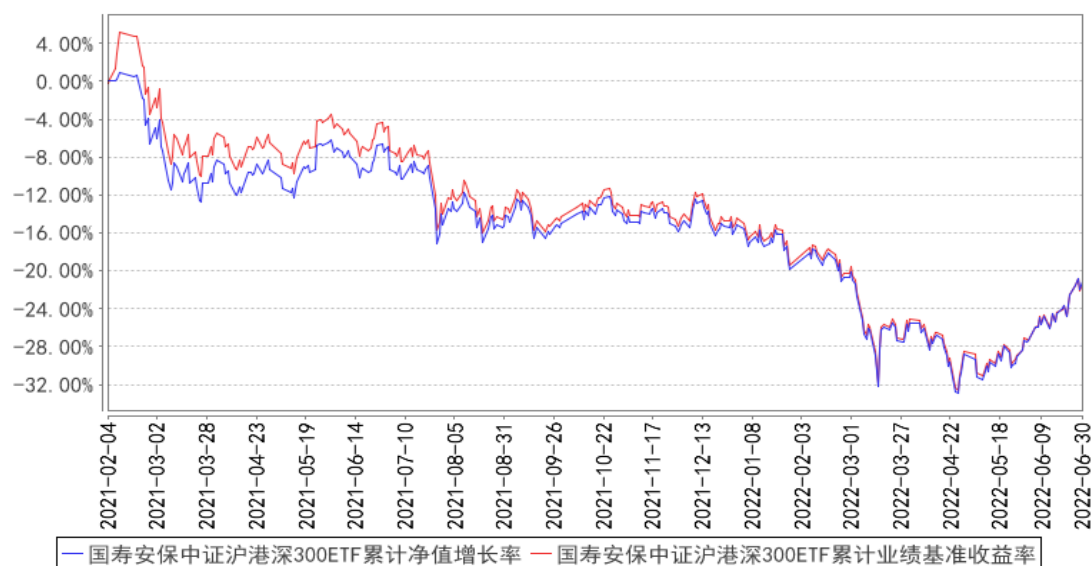
## 3.2 基金净值表现

### 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	8.54%	1.11%	7.89%	1.12%	0.65%	-0.01%
过去三个月	6.99%	1.42%	6.16%	1.38%	0.83%	0.04%
过去六个月	-7.12%	1.51%	-8.08%	1.50%	0.96%	0.01%
过去一年	-15.13%	1.30%	-17.30%	1.29%	2.17%	0.01%
自基金合同生效起至今	-21.17%	1.26%	-21.40%	1.28%	0.23%	-0.02%

### 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

国寿安保中证沪港深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 2021 年 02 月 04 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 2021 年 02 月 04 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	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 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、国寿安保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。
苏天醒	本基金的基金经理	2021 年 3 月 1 日	-	12 年	硕士，2010 年 3 月至 2012 年 11 月任中国国际金融有限公司研究员；2013 年 2 月至 2014 年 6 月任新华资产管理股份有限公司交易员；2014 年 6 月至 2015 年 5 月任宁波灵均投资管理合伙企业（有限合伙）投资交



					易总监；2015 年 5 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国寿安保国证创业板中盘精选 88 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或本基金管理人对外披露的任职日期。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来自成分股调整、股票停牌等因素引起的成份股权重偏离、以及汇率波动等因素。日常申赎、市场波动和港股交易备付金等，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 0.7883 元；本报告期基金份额净值增长率为 -7.12%，业绩比较基准收益率为 -8.08%。

#### 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。港股方面，互联网平台整改初见成效，随着监管常态化的推进，上市公司更加注重公平和效率的平衡，业绩也有望逐步回升，目前极低的估值是很好的配置时点。整体上看，沪港深 300 指数将具有较好的投资机会。

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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证沪港深 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	上年度末
-----	-----	-----	------

		2022 年 6 月 30 日	2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	34,654,101.87	28,737,679.02
结算备付金		77,221.48	403,278.51
存出保证金		89,758.14	86,632.04
交易性金融资产	6.4.7.2	2,353,508,275.73	2,486,626,632.36
其中：股票投资		2,353,508,275.73	2,483,293,632.36
基金投资		-	-
债券投资		-	3,333,000.00
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		1,251,281.37	105,782.15
应收股利		3,303,996.49	30,832.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	3,628.19	12,180.13
资产总计		2,392,888,263.27	2,516,003,016.21
<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		2,084,481.73	597,595.93
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		943,498.63	1,086,807.22
应付托管费		188,699.72	217,361.43
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		733.90	215.34
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	736,047.49	673,518.72

负债合计		3,953,461.47	2,575,498.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	3,030,434,450.00	2,961,434,450.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-641,499,648.20	-448,006,932.43
净资产合计		2,388,934,801.80	2,513,427,517.57
负债和净资产总计		2,392,888,263.27	2,516,003,016.21

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.7883 元，基金份额总额 3,030,434,450.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证沪港深 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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-164,546,795.35	-277,491,167.02
1. 利息收入		193,788.55	1,579,620.28
其中：存款利息收入	6.4.7.13	125,918.33	1,396,867.11
债券利息收入		-	596.05
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	135,081.12
证券出借利息收入		67,870.22	47,076.00
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-46,571,229.71	-59,933,795.71
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-75,775,500.65	-86,084,645.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	914,927.57	715,372.48
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
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	28,289,343.37	25,435,477.14
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	-118,358,670.86	-220,508,678.83
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	189,316.67	1,371,687.24

<b>减：二、营业总支出</b>		7,232,803.71	13,923,740.11
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	5,631,283.45	6,867,434.95
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,126,256.64	1,373,486.99
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		244.94	170.84
8. 其他费用	6.4.7.23	475,018.68	5,682,647.33
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-171,779,599.06	-291,414,907.13
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-171,779,599.06	-291,414,907.13
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-171,779,599.06	-291,414,907.13

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证沪港深 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）	2,961,434,450.00	-	-448,006,932.43	2,513,427,517.57
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）	2,961,434,450.00	-	-448,006,932.43	2,513,427,517.57
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	69,000,000.00	-	-193,492,715.77	-124,492,715.77
（一）、综合收益总额	-	-	-171,779,599.06	-171,779,599.06
（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）	69,000,000.00	-	-21,713,116.71	47,286,883.29
其中：1. 基金申购款	180,000,000.00	-	-48,407,270.47	131,592,729.53
2. 基金赎回款	-111,000,000.00	-	26,694,153.76	-84,305,846.24
（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）	3,030,434,450.00	-	-641,499,648.20	2,388,934,801.80
项目	上年度可比期间 2021年2月4日（基金合同生效日）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）	3,936,434,450.00	-	-	3,936,434,450.00
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）	3,936,434,450.00	-	-	3,936,434,450.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-651,000,000.00	-	-234,063,664.48	-885,063,664.48
（一）、综合收益总额	-	-	-291,414,907.13	-291,414,907.13
（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）	-651,000,000.00	-	57,351,242.65	-593,648,757.35
其中：1. 基金申购款	3,000,000.00	-	-136,991.10	2,863,008.90
2. 基金赎回款	-654,000,000.00	-	57,488,233.75	-596,511,766.25
（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）	3,285,434,450.00	-	-234,063,664.48	3,051,370,785.52

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

国寿安保中证沪港深 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[2020]3525 号《关于准予国寿安保中证沪港深 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《国寿安保中证沪港深 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。本基金为交易型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 3,936,141,500.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天

验字(2021)第 0157 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 02 月 04 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,936,434,450.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 292,950.00 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”),基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]65 号核准,本基金 3,936,434,450.00 份基金份额于 2021 年 2 月 24 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《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于其他股票(包含港股通标的股票、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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(含超短期融资券)、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货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的相关规定)。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%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债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,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股,未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式,基金管理人可在履行适当程序后相应调整。本基金将根据法律法规参与转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。本基金的业绩比较基准为:中证沪港深 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中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿安保沪港深 300ETF 联接基金”)。国寿安保沪港深 300ETF 联接基金为交易型开放式基金,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。

#### 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》、《国寿安保中证沪港深 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于 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

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商业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 and 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、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 28,737,679.02 元、403,278.51 元、86,632.04 元、12,180.13 元、105,782.15 元和 30,832.00 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、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、其他资产-其他应收款、应收清算款和应收股利，金额分别为 28,747,126.85 元、405,221.62 元、86,673.95 元、0.00 元、674.23 元、105,782.15 元和 30,832.00 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 2,486,626,632.36 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 2,486,626,705.41 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 597,595.93 元、1,086,807.22 元、217,361.43 元、256,167.87 元和 417,350.85 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 597,595.93 元、1,086,807.22 元、217,361.43 元、256,167.87 元和 417,350.85 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

本基金本报告期无需要说明的会计估值变更。

#### 6.4.5.3 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。

#### 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[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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。对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(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	34,654,101.87
等于：本金	34,647,684.68
加：应计利息	6,417.19
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	34,654,101.87

#### 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	2,889,137,094.61	-	2,353,508,275.73	-535,628,818.88
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	2,889,137,094.61	-	2,353,508,275.73	-535,628,818.88

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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

本基金本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 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	3,628.19
待摊费用	-
合计	3,628.19

#### 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	169,074.45
其中：交易所市场	169,074.45
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	229,095.94
应付指数使用费	337,877.10
合计	736,047.49

#### 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	2,961,434,450.00	2,961,434,450.00
本期申购	180,000,000.00	180,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-111,000,000.00	-111,000,000.00
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	3,030,434,450.00	3,030,434,450.00

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	-115,130,399.04	-332,876,533.39	-448,006,932.43
本期利润	-53,420,928.20	-118,358,670.86	-171,779,599.06
本期基金份额交易产生的变动数	-2,590,332.21	-19,122,784.50	-21,713,116.71
其中：基金申购款	-7,633,112.86	-40,774,157.61	-48,407,270.47
基金赎回款	5,042,780.65	21,651,373.11	26,694,153.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-171,141,659.45	-470,357,988.75	-641,499,648.20

#### 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	120,697.87
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	4,606.33
其他	614.13
合计	125,918.33

#### 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	-67,600,633.66
股票投资收益——赎回差价收入	-8,174,866.99
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	-75,775,500.65

##### 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	186,401,900.41

减：卖出股票成本总额	253,468,724.57
减：交易费用	533,809.50
买卖股票差价收入	-67,600,633.66

#### 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	84,305,846.24
减：现金支付赎回款总额	49,325,549.24
减：赎回股票成本总额	43,155,163.99
减：交易费用	-
赎回差价收入	-8,174,866.99

#### 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	772.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	914,155.38
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	914,927.57

##### 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	5,742,015.50
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,827,000.00
减：应计利息总额	850.25
减：交易费用	9.87
买卖债券差价收入	914,155.38

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资收益。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金于本报告期无买卖衍生工具差价收入。

## 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	28,289,343.37
其中：证券出借权益补偿收入	88,220.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	28,289,343.37

## 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	-118,358,670.86
股票投资	-118,358,670.86
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	-118,358,670.86

## 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	189,316.67
合计	189,316.67

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金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	5,872.16
指数使用费	337,877.10
证券组合费	22,173.48
合计	475,018.68

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）	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”）	国寿安保的最终控制人
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
广发银行股份有限公司（简称“广发银行”）	基金管理人股东之股东的联营企业

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期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2月4日（基金合同生 效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	5,631,283.45	6,867,434.95
其中：支付销售机构的客户维护费	5,116.15	5,466.42

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2月4日（基金合同生 效日）至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,126,256.64	1,373,486.99

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

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 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自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期末未运用自有资金投资本基金。

##### 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 (%)
国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	173,000,000.00	5.71	-	-
中国人寿	1,820,000,000.00	60.06	1,820,000,000.00	61.46

#### 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2月4日（基金合同生效日）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
招商银行	34,654,101.87	120,697.87	44,196,136.63	1,241,365.63

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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 1,150,900.00 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 62,423,703.00 元，估值总额为人民币 48,567,980.00 元，占基金资产净值的比例为 2.03%；本基金持有 212,500.00 股招商银行的 H 股，成本总额为人民币 11,299,697.27 元，估值总额为人民币 9,540,713.44 元，占基金资产净值的比例为 0.40%。

本基金持有 154,200.00 股中国人寿的 A 股普通股，成本总额为人民币 5,137,486.84 元，估值总额为人民币 4,792,536.00 元，占基金资产净值的比例为 0.20%；本基金持有 345,000.00 股中国人寿的 H 股，成本总额为人民币 4,706,302.83 元，估值总额为人民币 4,030,253.91 元，占基金资产净值的比例为 0.17%。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 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
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	1,837	42,642.25	29,649.18	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	-
301136	招标股份	2021 年 12 月 31 日	6 个月	新股流通受限	10.52	19.74	7,172	75,449.44	141,575.28	-
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	556	53,759.82	48,827.92	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	-
688062	迈威生物	2022 年 1 月 6 日	6 个月	新股流通受限	34.80	16.78	27,002	939,669.60	453,093.56	-
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	-

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票数量的 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票，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票不适用《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。

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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
01918	融创中国	2022年4月7日	重大事项停牌	3.92	-	-	141,000	3,422,802.48	552,264.60	-

#### 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	000625	长安汽车	2022年7月8日-2022年7月14日	17.32	76,000	1,316,320.00
2	000651	格力电器	2022年7月5日	33.72	80,000	2,697,600.00
3	000792	盐湖股份	2022年7月12日	29.96	80,000	2,396,800.00
4	002607	中公教育	2022年7月6日	5.79	30,000	173,700.00
5	002709	天赐材料	2022年7月5日	62.06	20,000	1,241,200.00
6	600010	包钢股份	2022年7月7日-2022年7月14日	2.35	420,000	987,000.00
7	600111	北方稀土	2022年7月4日-2022	35.16	37,400	1,314,984.00

			年 7 月 7 日			
8	600196	复星医药	2022 年 7 月 13 日	44.09	20,000	881,800.00
9	600438	通威股份	2022 年 7 月 14 日	59.86	50,000	2,993,000.00
10	600588	用友网络	2022 年 7 月 14 日	21.71	30,000	651,300.00
11	601066	中信建投	2022 年 7 月 8 日	28.91	23,000	664,930.00
12	601238	广汽集团	2022 年 7 月 7 日	15.24	40,000	609,600.00
13	601600	中国铝业	2022 年 7 月 12 日	4.75	140,000	665,000.00
14	601633	长城汽车	2022 年 7 月 11 日	37.04	17,000	629,680.00
15	603806	福斯特	2022 年 7 月 8 日	65.52	10,000	655,200.00
合计	-	-	-	-	1,073,400	17,878,114.00

#### 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	34,654,101.87	-	-	-	34,654,101.87
结算备付金	77,221.48	-	-	-	77,221.48
存出保证金	89,758.14	-	-	-	89,758.14
交易性金融资产	-	-	-2,353,508,275.73	-	2,353,508,275.73
应收股利	-	-	-	3,303,996.49	3,303,996.49
应收清算款	-	-	-	1,251,281.37	1,251,281.37
其他资产	-	-	-	3,628.19	3,628.19
资产总计	34,821,081.49	-	-2,358,067,181.78	-	2,392,888,263.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	943,498.63	943,498.63
应付托管费	-	-	-	188,699.72	188,699.72
应付清算款	-	-	-	2,084,481.73	2,084,481.73
应交税费	-	-	-	733.90	733.90

其他负债	-	-	-	736,047.49	736,047.49
负债总计	-	-	-	3,953,461.47	3,953,461.47
利率敏感度缺口	34,821,081.49	-	-	-2,354,113,720.31	2,388,934,801.80
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	28,737,679.02	-	-	-	28,737,679.02
结算备付金	403,278.51	-	-	-	403,278.51
存出保证金	86,632.04	-	-	-	86,632.04
交易性金融资产	-	-	3,333,000.00	2,483,293,632.36	2,486,626,632.36
应收利息	-	-	-	12,180.13	12,180.13
应收股利	-	-	-	30,832.00	30,832.00
应收证券清算款	-	-	-	105,782.15	105,782.15
资产总计	29,227,589.57	-	3,333,000.00	2,483,442,426.64	2,516,003,016.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,086,807.22	1,086,807.22
应付托管费	-	-	-	217,361.43	217,361.43
应付证券清算款	-	-	-	597,595.93	597,595.93
应付交易费用	-	-	-	256,167.87	256,167.87
应交税费	-	-	-	215.34	215.34
其他负债	-	-	-	417,350.85	417,350.85
负债总计	-	-	-	2,575,498.64	2,575,498.64
利率敏感度缺口	29,227,589.57	-	3,333,000.00	2,480,866,928.00	2,513,427,517.57

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 0.00%（2021 年 12 月 31 日：0.13%），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发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日



	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	586,058,373.07	-	586,058,373.07
应收股利	-	3,280,413.49	-	3,280,413.49
资产合计	-	589,338,786.56	-	589,338,786.56
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	589,338,786.56	-	589,338,786.56
项目	上年度末 2021年12月31日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	585,732,449.22	-	585,732,449.22
资产合计	-	585,732,449.22	-	585,732,449.22
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	585,732,449.22	-	585,732,449.22

#### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变； 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。		
	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个基准点	29,466,939.33	29,286,622.46
	-5个基准点	-29,466,939.33	-29,286,622.46

注：此表为外汇风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的股票公允价值的变动对基金净值产生的影响。

#### 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	2,353,508,275.73	98.52	2,483,293,632.36	98.80
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	3,333,000.00	0.13
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	2,353,508,275.73	98.52	2,486,626,632.36	98.93

#### 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 系数是根据组合的净值数据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 个基准点	119,446,740.09	124,414,662.12
	-5 个基准点	-119,446,740.09	-124,414,662.12

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。此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	2,351,317,018.29	2,479,778,613.23
第二层次	552,264.60	3,713,229.35
第三层次	1,638,992.84	3,134,789.78
合计	2,353,508,275.73	2,486,626,632.36

##### 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	2,353,508,275.73	98.35
	其中：股票	2,353,508,275.73	98.35
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	34,731,323.35	1.45
8	其他各项资产	4,648,664.19	0.19
9	合计	2,392,888,263.27	100.00

注：1. 上述表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额为人民币 586,058,373.07 元，占基金净资产的比例为 24.53%。

2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 17,878,114.00 元，占基金资产净值的比例为 0.75%。

### 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	23,736,939.87	0.99
B	采矿业	52,225,969.99	2.19
C	制造业	1,047,726,785.51	43.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	42,946,954.00	1.80
E	建筑业	33,442,965.00	1.40
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	44,667,337.60	1.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,515,215.89	1.86
J	金融业	371,778,043.30	15.56
K	房地产业	30,743,943.00	1.29
L	租赁和商务服务业	27,456,989.00	1.15
M	科学研究和技术服务业	29,884,789.45	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	48,403.23	0.00

0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	998,775.00	0.04
Q	卫生和社会工作	14,961,607.82	0.63
R	文化、体育和娱乐业	2,315,184.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	1,767,449,902.66	73.98

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	1,289,541.00	0.05
消费者非必需品	98,513,109.19	4.12
消费者常用品	25,099,599.87	1.05
能源	10,898,096.67	0.46
金融	201,330,001.42	8.43
医疗保健	25,826,797.86	1.08
工业	21,906,401.66	0.92
信息技术	24,314,426.85	1.02
电信服务	115,213,522.92	4.82
公用事业	19,797,114.43	0.83
地产建筑业	41,869,761.20	1.75
合计	586,058,373.07	24.53

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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	59,000	120,655,000.00	5.05
2	00700	腾讯控股	309,400	93,772,746.56	3.93
3	300750	宁德时代	130,402	69,634,668.00	2.91
4	601318	中国平安	1,007,700	47,049,513.00	1.97
4	02318	中国平安	345,000	15,740,413.34	0.66
5	600036	招商银行	1,150,900	48,567,980.00	2.03
5	03968	招商银行	212,500	9,540,713.44	0.40
6	00005	汇丰控股	940,000	41,520,329.69	1.74
7	01299	友邦保险	554,800	40,352,772.99	1.69
8	002594	比亚迪	84,200	28,079,858.00	1.18
8	01211	比亚迪股份	40,500	10,875,451.23	0.46
9	03690	美团-W	227,600	37,799,329.58	1.58
10	601012	隆基绿能	563,400	37,539,342.00	1.57
11	000858	五粮液	180,359	36,419,892.87	1.52

12	01398	工商银行	3,990,000	15,900,889.75	0.67
12	601398	工商银行	3,259,300	15,546,861.00	0.65
13	000333	美的集团	455,175	27,488,018.25	1.15
14	601166	兴业银行	1,351,800	26,900,820.00	1.13
15	300059	东方财富	983,244	24,974,397.60	1.05
16	00939	建设银行	5,529,000	24,918,380.84	1.04
17	600900	长江电力	1,056,800	24,433,216.00	1.02
18	601888	中国中免	90,700	21,126,751.00	0.88
19	603259	药明康德	190,660	19,826,733.40	0.83
20	600030	中信证券	908,015	19,667,604.90	0.82
21	00388	香港交易所	58,700	19,377,066.06	0.81
22	600887	伊利股份	476,000	18,540,200.00	0.78
23	000568	泸州老窖	68,100	16,789,374.00	0.70
24	03988	中国银行	3,847,000	10,297,436.86	0.43
24	601988	中国银行	1,961,200	6,393,512.00	0.27
25	601328	交通银行	2,555,400	12,725,892.00	0.53
25	03328	交通银行	810,000	3,754,455.14	0.16
26	002415	海康威视	439,200	15,899,040.00	0.67
27	002475	立讯精密	460,706	15,567,255.74	0.65
28	600276	恒瑞医药	415,158	15,398,210.22	0.64
29	600438	通威股份	250,620	15,002,113.20	0.63
30	000651	格力电器	440,592	14,856,762.24	0.62
31	600809	山西汾酒	44,940	14,596,512.00	0.61
32	300760	迈瑞医疗	45,500	14,250,600.00	0.60
33	600309	万华化学	146,500	14,209,035.00	0.59
34	000725	京东方 A	3,489,000	13,746,660.00	0.58
35	002714	牧原股份	247,581	13,683,801.87	0.57
36	000001	平安银行	902,200	13,514,956.00	0.57
37	002142	宁波银行	368,452	13,194,266.12	0.55
38	000002	万 科 A	633,900	12,994,950.00	0.54
39	002812	恩捷股份	50,300	12,597,635.00	0.53
40	601288	农业银行	2,967,600	8,962,152.00	0.38
40	01288	农业银行	1,414,000	3,579,346.43	0.15
41	601899	紫金矿业	1,340,603	12,507,825.99	0.52
42	688981	中芯国际	180,000	8,130,600.00	0.34
42	00981	中芯国际	276,500	4,298,843.44	0.18
43	002129	TCL 中环	210,700	12,408,123.00	0.52
44	000792	盐湖股份	404,000	12,103,840.00	0.51
45	002466	天齐锂业	96,100	11,993,280.00	0.50
46	02269	药明生物	195,000	11,973,515.19	0.50
47	00941	中国移动	284,500	11,921,776.20	0.50
48	603288	海天味业	129,693	11,719,059.48	0.49

49	600048	保利发展	667,100	11,647,566.00	0.49
50	603799	华友钴业	118,390	11,320,451.80	0.47
51	300124	汇川技术	171,200	11,276,944.00	0.47
52	300015	爱尔眼科	251,780	11,272,190.60	0.47
53	002460	赣锋锂业	74,565	11,087,815.50	0.46
54	600031	三一重工	552,500	10,530,650.00	0.44
55	601668	中国建筑	1,951,400	10,381,448.00	0.43
56	300014	亿纬锂能	105,438	10,280,205.00	0.43
57	601088	中国神华	306,600	10,209,780.00	0.43
58	002304	洋河股份	55,600	10,183,140.00	0.43
59	002352	顺丰控股	181,790	10,145,699.90	0.42
60	600436	片仔癀	28,400	10,131,132.00	0.42
61	300498	温氏股份	472,200	10,053,138.00	0.42
62	600690	海尔智家	351,500	9,652,190.00	0.40
63	002271	东方雨虹	187,500	9,650,625.00	0.40
64	600089	特变电工	352,200	9,646,758.00	0.40
65	300274	阳光电源	96,600	9,490,950.00	0.40
66	01810	小米集团-W	806,200	9,404,154.99	0.39
67	601816	京沪高铁	1,827,100	9,172,042.00	0.38
68	601628	中国人寿	154,200	4,792,536.00	0.20
68	02628	中国人寿	345,000	4,030,253.91	0.17
69	600837	海通证券	898,200	8,811,342.00	0.37
70	603986	兆易创新	61,846	8,795,119.66	0.37
71	600000	浦发银行	1,091,800	8,745,318.00	0.37
72	600028	中国石化	1,244,600	5,077,968.00	0.21
72	00386	中国石油化工股份	1,180,000	3,562,208.43	0.15
73	01024	快手-W	115,300	8,617,937.77	0.36
74	600016	民生银行	2,307,349	8,583,338.28	0.36
75	600406	国电南瑞	310,980	8,396,460.00	0.35
76	601658	邮储银行	1,012,200	5,455,758.00	0.23
76	01658	邮储银行	550,000	2,930,308.54	0.12
77	603501	韦尔股份	48,400	8,374,652.00	0.35
78	300122	智飞生物	74,200	8,236,942.00	0.34
79	601919	中远海控	588,870	8,185,293.00	0.34
80	000625	长安汽车	461,018	7,984,831.76	0.33
81	600585	海螺水泥	223,600	7,888,608.00	0.33
82	600919	江苏银行	1,098,000	7,817,760.00	0.33
83	002709	天赐材料	125,700	7,800,942.00	0.33
84	601688	华泰证券	546,700	7,763,140.00	0.32
85	600104	上汽集团	435,200	7,750,912.00	0.32
86	601225	陕西煤业	360,800	7,641,744.00	0.32

87	002049	紫光国微	39,900	7,569,828.00	0.32
88	000063	中兴通讯	296,000	7,556,880.00	0.32
89	02331	李宁	121,500	7,553,936.03	0.32
90	02015	理想汽车-W	57,400	7,505,540.83	0.31
91	601601	中国太保	318,800	7,501,364.00	0.31
92	002241	歌尔股份	222,690	7,482,384.00	0.31
93	00883	中国海洋石油	828,000	7,335,888.24	0.31
94	300142	沃森生物	148,500	7,185,915.00	0.30
95	600111	北方稀土	202,900	7,133,964.00	0.30
96	002230	科大讯飞	172,896	7,126,773.12	0.30
97	000661	长春高新	30,400	7,095,968.00	0.30
98	002459	晶澳科技	87,120	6,873,768.00	0.29
99	002371	北方华创	24,800	6,872,576.00	0.29
100	688599	天合光能	99,976	6,523,434.00	0.27
101	300450	先导智能	101,800	6,431,724.00	0.27
102	601211	国泰君安	420,300	6,388,560.00	0.27
103	00016	新鸿基地产	80,500	6,381,727.10	0.27
104	002027	分众传媒	940,600	6,330,238.00	0.26
105	000338	潍柴动力	504,833	6,295,267.51	0.26
106	09633	农夫山泉	163,200	6,287,493.71	0.26
107	601169	北京银行	1,378,800	6,259,752.00	0.26
108	000100	TCL 科技	1,305,800	6,254,782.00	0.26
109	600660	福耀玻璃	148,644	6,214,805.64	0.26
110	600703	三安光电	249,300	6,127,794.00	0.26
111	601229	上海银行	924,452	6,055,160.60	0.25
112	601985	中国核电	877,700	6,021,022.00	0.25
113	09868	小鹏汽车-W	55,500	5,999,328.89	0.25
114	600050	中国联通	1,730,800	5,988,568.00	0.25
115	00669	创科实业	85,000	5,949,770.63	0.25
116	600745	闻泰科技	69,400	5,906,634.00	0.25
117	601766	中国中车	1,131,300	5,882,760.00	0.25
118	601390	中国中铁	955,800	5,868,612.00	0.25
119	00001	长和	125,000	5,670,978.69	0.24
120	600893	航发动力	124,255	5,654,845.05	0.24
121	601669	中国电建	711,000	5,595,570.00	0.23
122	300347	泰格医药	48,400	5,539,380.00	0.23
123	603659	璞泰来	64,500	5,443,800.00	0.23
124	00002	中电控股	94,000	5,233,249.69	0.22
125	01109	华润置地	166,000	5,195,792.36	0.22
126	02020	安踏体育	63,000	5,193,739.91	0.22
127	02388	中银香港	195,500	5,182,879.00	0.22
128	000776	广发证券	275,000	5,142,500.00	0.22



129	600009	上海机场	89,641	5,082,644.70	0.21
130	600905	三峡能源	799,900	5,031,371.00	0.21
131	600999	招商证券	346,400	4,991,624.00	0.21
132	601009	南京银行	478,800	4,989,096.00	0.21
133	600019	宝钢股份	827,100	4,979,142.00	0.21
134	600010	包钢股份	2,117,500	4,976,125.00	0.21
135	600958	东方证券	485,476	4,956,709.96	0.21
136	600196	复星医药	112,100	4,942,489.00	0.21
137	02319	蒙牛乳业	147,000	4,921,661.21	0.21
138	00027	银河娱乐	122,000	4,882,792.82	0.20
139	300896	爱美客	8,100	4,860,081.00	0.20
140	01113	长实集团	101,500	4,817,499.07	0.20
141	002410	广联达	88,292	4,806,616.48	0.20
142	601857	中国石油	904,000	4,791,200.00	0.20
143	06160	百济神州	56,800	4,784,617.01	0.20
144	600570	恒生电子	108,940	4,743,247.60	0.20
145	000895	双汇发展	161,100	4,720,230.00	0.20
146	002179	中航光电	73,560	4,657,819.20	0.19
147	601818	光大银行	1,539,000	4,632,390.00	0.19
148	002311	海大集团	77,185	4,631,871.85	0.19
149	002050	三花智控	166,400	4,572,672.00	0.19
150	600760	中航沈飞	72,620	4,389,879.00	0.18
151	600346	恒力石化	196,800	4,376,832.00	0.18
152	300759	康龙化成	45,650	4,346,793.00	0.18
153	002493	荣盛石化	282,150	4,342,288.50	0.18
154	00688	中国海外发展	202,500	4,294,764.18	0.18
155	300661	圣邦股份	23,400	4,259,268.00	0.18
156	00175	吉利汽车	279,000	4,256,588.50	0.18
157	601633	长城汽车	114,500	4,241,080.00	0.18
158	00011	恒生银行	35,500	4,204,755.43	0.18
159	600926	杭州银行	275,700	4,129,986.00	0.17
160	600460	士兰微	78,700	4,092,400.00	0.17
161	688012	中微公司	34,776	4,060,098.00	0.17
162	300782	卓胜微	30,016	4,052,160.00	0.17
163	02688	新奥能源	36,700	4,045,587.47	0.17
164	600426	华鲁恒升	138,400	4,041,280.00	0.17
165	300316	晶盛机电	59,400	4,014,846.00	0.17
166	000538	云南白药	66,480	4,014,727.20	0.17
167	002821	凯莱英	13,800	3,988,200.00	0.17
168	001979	招商蛇口	294,500	3,955,135.00	0.17
169	002001	新和成	172,608	3,937,188.48	0.16
170	601989	中国重工	1,058,900	3,928,519.00	0.16

171	000768	中航西飞	129,300	3,916,497.00	0.16
172	02382	舜宇光学科技	35,700	3,904,823.20	0.16
173	600176	中国巨石	224,000	3,899,840.00	0.16
174	000596	古井贡酒	15,300	3,819,798.00	0.16
175	00291	华润啤酒	76,000	3,802,174.74	0.16
176	000799	酒鬼酒	20,300	3,771,943.00	0.16
177	603993	洛阳钼业	656,200	3,760,026.00	0.16
178	00003	香港中华煤气	518,550	3,747,226.64	0.16
179	600763	通策医疗	21,057	3,673,183.08	0.15
180	601006	大秦铁路	553,600	3,648,224.00	0.15
181	601138	工业富联	369,100	3,631,944.00	0.15
182	000166	申万宏源	839,500	3,601,455.00	0.15
183	601877	正泰电器	100,094	3,581,363.32	0.15
184	00960	龙湖集团	112,500	3,564,538.82	0.15
185	601066	中信建投	121,500	3,512,565.00	0.15
186	601600	中国铝业	731,000	3,472,250.00	0.15
187	600588	用友网络	159,343	3,459,336.53	0.14
188	600029	南方航空	470,900	3,442,279.00	0.14
189	688111	金山办公	17,400	3,429,888.00	0.14
190	02313	申洲国际	41,800	3,397,746.84	0.14
191	600741	华域汽车	146,800	3,376,400.00	0.14
192	601186	中国铁建	427,300	3,375,670.00	0.14
193	600188	兖矿能源	84,900	3,351,852.00	0.14
194	601111	中国国航	278,000	3,227,580.00	0.14
195	300408	三环集团	106,700	3,211,670.00	0.13
196	603806	福斯特	48,973	3,208,710.96	0.13
197	600132	重庆啤酒	21,700	3,181,220.00	0.13
198	600150	中国船舶	165,900	3,148,782.00	0.13
199	601238	广汽集团	205,100	3,125,724.00	0.13
200	600547	山东黄金	168,100	3,119,936.00	0.13
201	003816	中国广核	1,100,700	3,081,960.00	0.13
202	06618	京东健康	58,500	3,079,261.25	0.13
203	09618	京东集团-SW	14,095	3,047,226.69	0.13
204	601800	中国交建	327,900	3,042,912.00	0.13
205	00066	港铁公司	86,500	3,032,931.34	0.13
206	600989	宝丰能源	204,400	2,994,460.00	0.13
207	600015	华夏银行	571,700	2,978,557.00	0.12
208	300999	金龙鱼	54,900	2,965,698.00	0.12
209	601100	恒立液压	48,000	2,962,560.00	0.12
210	01093	石药集团	444,000	2,957,896.96	0.12
211	688396	华润微	49,800	2,941,686.00	0.12
212	00006	电能实业	69,500	2,933,152.04	0.12

213	600886	国投电力	277,600	2,914,800.00	0.12
214	002648	卫星化学	111,800	2,890,030.00	0.12
215	601868	中国能建	1,206,900	2,860,353.00	0.12
216	300601	康泰生物	62,280	2,813,810.40	0.12
217	06098	碧桂园服务	94,000	2,809,555.71	0.12
218	000301	东方盛虹	165,600	2,800,296.00	0.12
219	00267	中信股份	405,000	2,753,498.00	0.12
220	01997	九龙仓置业	85,000	2,718,649.01	0.11
221	002601	龙佰集团	133,600	2,678,680.00	0.11
222	00881	中升控股	56,000	2,650,746.92	0.11
223	01821	ESR	144,800	2,625,228.05	0.11
224	688008	澜起科技	42,667	2,584,766.86	0.11
225	603833	欧派家居	17,100	2,576,628.00	0.11
226	601901	方正证券	383,904	2,575,995.84	0.11
227	603392	万泰生物	16,584	2,575,495.20	0.11
228	00968	信义光能	248,000	2,570,495.89	0.11
229	002736	国信证券	267,100	2,556,147.00	0.11
230	603486	科沃斯	20,600	2,510,934.00	0.11
231	601336	新华保险	77,600	2,497,944.00	0.10
232	300628	亿联网络	32,800	2,497,720.00	0.10
233	601995	中金公司	53,700	2,389,113.00	0.10
234	01928	金沙中国有限公司	149,200	2,388,566.19	0.10
235	603260	合盛硅业	20,100	2,370,996.00	0.10
236	300454	深信服	22,500	2,335,050.00	0.10
237	601618	中国中冶	662,400	2,318,400.00	0.10
238	300413	芒果超媒	69,400	2,315,184.00	0.10
239	688126	沪硅产业	100,200	2,302,596.00	0.10
240	601360	三六零	265,200	2,259,504.00	0.09
241	01177	中国生物制药	520,000	2,210,153.04	0.09
242	601155	新城控股	84,400	2,146,292.00	0.09
243	300919	中伟股份	17,200	2,131,080.00	0.09
244	00992	联想集团	336,000	2,106,230.35	0.09
245	00868	信义玻璃	130,000	2,092,307.85	0.09
246	00322	康师傅控股	182,000	2,091,863.16	0.09
247	300433	蓝思科技	184,300	2,040,201.00	0.09
248	00268	金蝶国际	129,000	2,029,878.98	0.08
249	688036	传音控股	22,667	2,022,576.41	0.08
250	01801	信达生物	67,500	2,014,613.84	0.08
251	600918	中泰证券	260,200	1,990,530.00	0.08
252	002938	鹏鼎控股	64,700	1,954,587.00	0.08
253	000708	中信特钢	94,200	1,898,130.00	0.08

254	601728	中国电信	506,800	1,890,364.00	0.08
255	02007	碧桂园	431,000	1,791,332.29	0.07
256	601865	福莱特	46,700	1,779,270.00	0.07
257	601898	中煤能源	170,100	1,765,638.00	0.07
258	600018	上港集团	302,500	1,763,575.00	0.07
259	00083	信和置业	178,000	1,762,751.84	0.07
260	01929	周大福	139,200	1,757,066.53	0.07
261	06969	思摩尔国际	84,000	1,738,430.23	0.07
262	300957	贝泰妮	7,900	1,718,487.00	0.07
263	00012	恒基地产	68,000	1,709,695.85	0.07
264	00017	新世界发展	70,000	1,685,151.90	0.07
265	01876	百威亚太	79,100	1,589,669.93	0.07
266	06186	中国飞鹤	206,000	1,589,045.64	0.07
267	601319	中国人保	299,200	1,513,952.00	0.06
268	01038	长江基建集团	35,000	1,439,712.37	0.06
269	01193	华润燃气	43,100	1,347,185.08	0.06
270	601998	中信银行	283,100	1,344,725.00	0.06
271	02618	京东物流	91,500	1,339,638.03	0.06
272	01378	中国宏桥	170,000	1,289,541.00	0.05
273	688363	华熙生物	9,060	1,288,150.80	0.05
274	06862	海底捞	77,000	1,205,048.23	0.05
275	600025	华能水电	167,500	1,170,825.00	0.05
276	601881	中国银河	119,900	1,159,433.00	0.05
277	00241	阿里健康	250,000	1,154,506.50	0.05
278	000617	中油资本	237,700	1,143,337.00	0.05
279	603195	公牛集团	7,300	1,116,243.00	0.05
280	00316	东方海外国际	6,000	1,067,277.12	0.04
281	01209	华润万象生活	31,800	1,057,887.13	0.04
282	00384	中国燃气	101,400	1,051,001.14	0.04
283	002607	中公教育	172,500	998,775.00	0.04
284	01972	太古地产	54,200	902,923.29	0.04
285	00762	中国联通	284,000	901,062.39	0.04
286	03692	翰森制药	54,000	731,495.32	0.03
287	605499	东鹏饮料	4,100	700,526.00	0.03
288	300979	华利集团	7,900	577,332.00	0.02
289	688197	首药控股	24,261	562,855.20	0.02
290	01918	融创中国	141,000	552,264.60	0.02
291	688739	成大生物	9,882	502,104.42	0.02
292	688062	迈威生物	27,002	453,093.56	0.02
293	001289	龙源电力	13,500	293,760.00	0.01
294	688151	华强科技	12,238	292,121.06	0.01
295	301136	招标股份	7,172	141,575.28	0.01

296	688285	高铁电气	15,159	129,003.09	0.01
297	688236	春立医疗	4,052	80,229.60	0.00
298	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
299	301219	腾远钴业	556	48,827.92	0.00
300	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
301	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
302	301216	万凯新材	1,120	33,420.80	0.00
303	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
304	301109	军信股份	1,837	29,649.18	0.00
305	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
306	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
307	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
308	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
309	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
310	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
311	301120	新特电气	1,032	15,985.68	0.00
312	301151	冠龙节能	703	15,086.38	0.00
313	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
314	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
315	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
316	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
317	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
318	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
319	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
320	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
321	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
322	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
323	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	12,970,963.00	0.52
2	600089	特变电工	9,308,214.88	0.37
3	00700	腾讯控股	7,404,814.11	0.29
4	688599	天合光能	6,243,946.50	0.25
5	02015	理想汽车-W	5,989,108.93	0.24
6	09868	小鹏汽车-W	5,068,582.14	0.20
7	600519	贵州茅台	4,680,595.00	0.19
8	600426	华鲁恒升	4,127,553.19	0.16

9	300661	圣邦股份	4,089,987.00	0.16
10	601600	中国铝业	3,777,823.00	0.15
11	600460	士兰微	3,670,078.00	0.15
12	600188	兖矿能源	3,620,901.00	0.14
13	000799	酒鬼酒	3,540,027.00	0.14
14	300316	晶盛机电	3,538,081.89	0.14
15	300750	宁德时代	3,532,230.00	0.14
16	01024	快手-W	3,217,855.50	0.13
17	002648	卫星化学	3,092,749.05	0.12
18	600886	国投电力	2,898,308.98	0.12
19	000725	京东方 A	2,842,995.00	0.11
20	01821	ESR	2,827,709.50	0.11

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	03690	美团-W	10,054,478.75	0.40
2	600519	贵州茅台	6,424,372.00	0.26
3	300750	宁德时代	4,836,218.40	0.19
4	00700	腾讯控股	3,729,634.11	0.15
5	06690	海尔智家	2,856,858.22	0.11
5	600690	海尔智家	449,155.00	0.02
6	000876	新希望	3,290,248.00	0.13
7	000157	中联重科	3,034,460.10	0.12
8	000786	北新建材	2,995,334.00	0.12
9	000858	五粮液	2,987,652.00	0.12
10	002594	比亚迪	2,623,992.00	0.10
10	01211	比亚迪股份	317,725.86	0.01
11	002236	大华股份	2,903,121.00	0.12
12	002841	视源股份	2,890,805.78	0.12
13	601318	中国平安	2,337,730.00	0.09
13	02318	中国平安	343,718.21	0.01
14	600036	招商银行	2,264,410.00	0.09
14	03968	招商银行	218,528.63	0.01
15	000333	美的集团	2,313,150.00	0.09
16	688223	晶科能源	2,159,678.52	0.09
17	002007	华兰生物	2,125,623.76	0.08
18	300059	东方财富	2,094,311.00	0.08
19	00288	万洲国际	1,994,550.26	0.08

20	603899	晨光股份	1,945,752.00	0.08
----	--------	------	--------------	------

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	226,935,521.88
卖出股票收入（成交）总额	186,401,900.41

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本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曾受生态环境部的处罚；招商银行股份有限公司

司、美团、腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局或地方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中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行或其分支行的处罚；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国税局的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚。

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	89,758.14
2	应收清算款	1,251,281.37
3	应收股利	3,303,996.49
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	3,628.19
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,648,664.19

#### 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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 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

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 (%)
18,451	164,242.29	2,103,406,350.00	69.41	927,028,100.00	30.59

### 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	中国人寿保险股份有限公司	1,820,000,000.00	60.06
2	中国人寿养老保险股份有限公司—国寿福盈今生个人养老保障管理产品开放式 4 号投资	39,353,900.00	1.30
3	宁波珑泰裕智投资管理有限公司	30,460,000.00	1.01
4	都邦财产保险股份有限公司	15,000,000.00	0.49
5	孙华玲	10,000,000.00	0.33
6	杨传博	9,500,000.00	0.31
7	中信证券股份有限公司	4,632,630.00	0.15
8	刘月明	3,800,000.00	0.13
9	雷光波	3,000,000.00	0.10
10	山东省天惠食品集团有限公司	3,000,000.00	0.10
11	招商银行股份有限公司—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	173,000,000.00	5.71

注：表中前十名持有人为除国寿安保中证沪港深 300ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 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	200,000.00	0.01

### 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（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额	3,936,434,450.00
本报告期期初基金份额总额	2,961,434,450.00
本报告期基金总申购份额	180,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	111,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,030,434,450.00

## § 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

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内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

本基金自基金合同生效日起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 (%)	

中信证券	2	281,551,198.01	70.77	119,128.22	70.46	-
华泰证券	2	107,214,140.02	26.95	44,234.59	26.16	-
天风证券	2	9,047,253.14	2.27	5,711.64	3.38	-
华创证券	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(%)
中信证券	5,742,015.50	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

### 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	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指	上证报、证监会指定	2022 年 1 月 24 日

	数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	网站及公司网站	
2	国寿安保中证沪港深 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	国寿安保中证沪港深 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	国寿安保中证沪港深 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	国寿安保中证沪港深 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	国寿安保中证沪港深 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	国寿安保中证沪港深 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	1	20220101~20220630	1,820,000,000.00	0.00	0.00	1,820,000,000.00	60.06
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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。

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。

### 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中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基

## 金募集的文件

12.1.2 《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保中证沪港深 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 报告期内国寿安保中证沪港深 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.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.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