

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 2019 年半年度报告

2019 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：2019 年 8 月 28 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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 27 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 2019 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	错误!未定义书签。
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	10
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	11
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
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
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	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序所有资产支持证券投资明细	48
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	48
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	48
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	48
7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	48

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.13 投资组合报告附注.....	49
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	50
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	52
10.1 基金份额持有人大会决议.....	52
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.....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	52
10.4 基金投资策略的改变.....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	52
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.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
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.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 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联接基金
基金简称	国寿安保沪深 300ETF 联接
基金主代码	000613
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 6 月 5 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	4,924,162,321.30 份
基金合同存续期	不定期

注：本基金于 2018 年 8 月 13 日转型为国寿安保沪深 300ETF 联接基金。

2.1.1 目标基金基本情况

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
基金管理人名称	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过主要投资于国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金，紧密跟踪标的指数即沪深 300 指数的表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为被动式投资的交易型开放式指数基金联接基金，跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金属于被动式投资的股票指数基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金，属于高预期风险、高预期收益的开放式基金。

2.2.1 目标基金产品说明

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	张彬	贺倩
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
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	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		王军辉	周慕冰

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金半年度报告备置地点	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	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	12,603,849.53
本期利润	-1,584,005.52
加权平均基金份额本期利润	-0.0006
本期加权平均净值利润率	-0.06%
本期基金份额净值增长率	25.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)
期末可供分配利润	146,072,592.47
期末可供分配基金份额利润	0.0297
期末基金资产净值	5,070,234,913.77
期末基金份额净值	1.0297
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年6月30日)
基金份额累计净值增长率	73.77%

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。

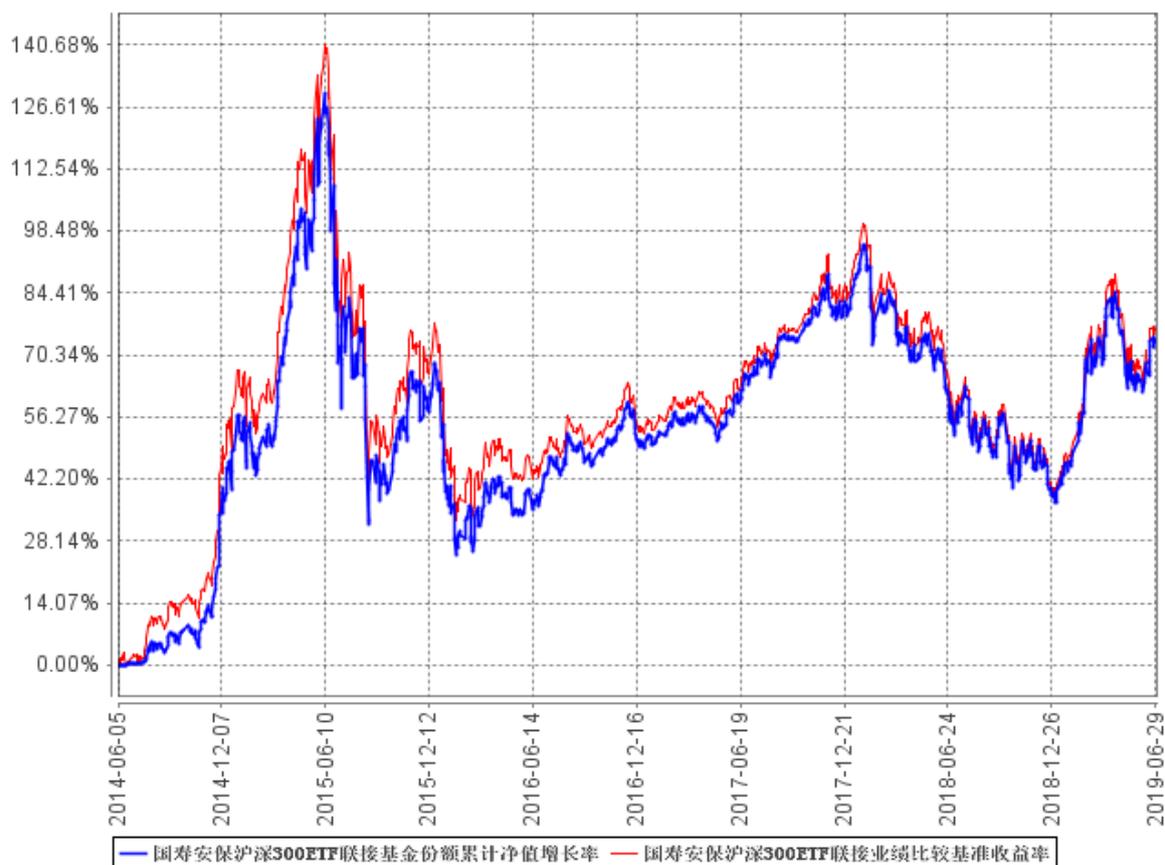
3.2 基金净值表现

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	5.59%	1.09%	5.13%	1.10%	0.46%	-0.01%
过去三个月	-0.59%	1.41%	-1.11%	1.45%	0.52%	-0.04%
过去六个月	25.21%	1.43%	25.65%	1.47%	-0.44%	-0.04%
过去一年	9.52%	1.41%	8.66%	1.45%	0.86%	-0.04%
过去三年	24.40%	1.03%	20.45%	1.05%	3.95%	-0.02%
自基金合同生效起至今	73.77%	1.48%	76.01%	1.49%	-2.24%	-0.01%

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联接基金份额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：本基金的基金合同于 2014 年 6 月 5 日生效，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 2014 年 06 月 05 日至 2019 年 06 月 30 日。

§ 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（澳大利亚安安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2019 年 6 月 30 日，公司共管理 48 只证券投资基金及部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 2,070.27 亿元，其中证券投资基金管理规模为 1,538.97 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	2015 年 3 月 20 日	-	9 年	李康先生，博士研究生。2009 年 10 月至 2012 年 12 月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013 年 11 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、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金及国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：任职日期为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合规守信情况的说明

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

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。

本基金跟踪误差主要源自日常申赎以及目标 ETF 相对指数的偏离。成分股停复牌、公司行为和市场波动等因素，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 1.0297 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.21%，业绩比较基准收益率为 25.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经历去年股票市场回调，上半年主流指数均取得不错的反弹。展望 2019 年下半年，我国宏观经济仍处在稳定可控的区间，经济韧性强但仍有下行压力，企业盈利增速仍处于探底的过程中，预期全年 GDP 增速会在 6.3% 左右，在主要经济体中增速依然突出。外部因素仍难言乐观，贸易摩擦影响仍然是一个不可忽视的因素，全球经济增长预期下修，全球主要央行纷纷降息开启货币宽松模式刺激经济，加息周期中的美联储也提前降息应对经济下行，预计美国经济有可能将步入缓慢衰退的过程。从国内环

境看，社融增速在经历了连续几个季度下降后，目前在 11%左右，处于合理稳定区间。中央再次强调房住不炒，以防止信贷资金大规模流向地产领域，同时加强对小微企业的信贷力度以激发民营经济活力。货币政策保持稳健，财政上继续实施减税降费，稳增长的同时调结构，从传统的刺激基建地产切换到激发民营企业活力、发挥消费的基础性作用、促进创新型企业发展的新增长点。资本市场方面，明确提出科创板要坚守定位，落实好以信息披露为核心的注册制，提高上市公司质量等举措，都说明资本市场的改革创新和制度完善已经在加速进行，有利于整个资本市场长期向好，主要核心指数的配置价值将逐步显现。

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

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

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签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

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《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 2019 年 01 月 01 日至 2019 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《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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《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半年度报告中的财务指标、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联接基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	354,050,426.24	40,460,032.28
结算备付金		838,857.34	179,021.66
存出保证金		969,710.02	70,143.53
交易性金融资产	6.4.7.2	4,716,381,041.55	484,095,645.08
其中：股票投资		96,928,266.55	11,820,045.08
基金投资		4,619,452,775.00	472,275,600.00
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	71,913.36	8,979.84
应收股利		-	-
应收申购款		26,147.55	19,521.08
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,072,338,096.06	524,833,343.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		48,936.85	20,178.64
应付管理人报酬		184,491.35	22,506.69
应付托管费		36,898.27	4,501.35
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,480,943.46	159,098.42
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	351,912.36	638,065.22
负债合计		2,103,182.29	844,350.32
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	4,924,162,321.30	637,174,137.64
未分配利润	6.4.7.10	146,072,592.47	-113,185,144.49
所有者权益合计		5,070,234,913.77	523,988,993.15
负债和所有者权益总计		5,072,338,096.06	524,833,343.47

注：报告截止日 2019 年 06 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0297 元，基金份额总额 4,924,162,321.30 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联接基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		1,482,980.77	-65,477,459.34
1.利息收入		854,470.08	181,166.91
其中：存款利息收入	6.4.7.11	850,741.86	134,671.34
债券利息收入		3,728.22	44,424.33
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	2,071.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		14,698,274.31	2,559,644.70
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,770,393.45	-2,104,578.45
基金投资收益	6.4.7.13	10,141,193.39	-
债券投资收益	6.4.7.14	-1,400.00	6,220.00
资产支持证券投资收益	6.4.7.14.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	788,087.47	4,658,003.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-14,187,855.05	-68,373,198.76
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	118,091.43	154,927.81
减：二、费用		3,066,986.29	2,479,105.21

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	581,150.35	1,441,733.02
2. 托管费	6.4.10.2.2	116,230.06	288,346.63
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	2,269,838.65	439,353.77
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	99,767.23	309,671.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,584,005.52	-67,956,564.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,584,005.52	-67,956,564.55

6.3 所有者权益（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联接基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	637,174,137.64	-113,185,144.49	523,988,993.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-1,584,005.52	-1,584,005.52
三、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）	4,286,988,183.66	260,841,742.48	4,547,829,926.14
其中：1. 基金申购款	4,380,506,384.66	261,165,993.78	4,641,672,378.44
2. 基金赎回款	-93,518,201.00	-324,251.30	-93,842,452.30
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	4,924,162,321.30	146,072,592.47	5,070,234,913.77
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		

金”（简称“本基金”），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合同于同日生效。

本基金为被动式投资的交易性开放式指数基金联接基金，跟踪沪深 300 指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金主要投资于目标 ETF，方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。本基金采用被动式指数化投资策略，通过控制基金组合相对于标的指数的偏离度和跟踪误差，实现对标的指数的有效跟踪，以为投资者带来与指数收益相似的长期回报。本基金投资范围主要为目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股。此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于部分非成份股（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、国债、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

本基金投资于目标 ETF 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，每个交易日日终，本基金应当保持不低于基金资产净值的 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和半年度报告〉》及其他中国证监会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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 2019 年 06

月 30 日的财务状况以及 2019 年 01 月 01 日至 2019 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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

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

本基金于本报告期均无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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

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

6.4.6.2 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务

及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

6.4.6.3 企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股

东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

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

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

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 2019 年 6 月 30 日
活期存款	354,050,426.24
定期存款	-
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	-

合计	354,050,426.24
----	----------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	95,277,587.70	96,928,266.55	1,650,678.85
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	4,666,824,294.60	4,619,452,775.00	-47,371,519.60
其他	-	-	-
合计	4,762,101,882.30	4,716,381,041.55	-45,720,840.75

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度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及上年度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

无。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	71,099.46
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	377.50
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-

其他	436.40
合计	71,913.36

6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,480,943.46
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,480,943.46

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	155.46
预提费用	351,756.90
应付指数使用费	-
-	-
合计	351,912.36

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	637,174,137.64	637,174,137.64
本期申购	4,380,506,384.66	4,380,506,384.66
本期赎回(以“-”号填列)	-93,518,201.00	-93,518,201.00
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,924,162,321.30	4,924,162,321.30

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	436,209,357.06	-549,394,501.55	-113,185,144.49
本期利润	12,603,849.53	-14,187,855.05	-1,584,005.52
本期基金份额交易产生的变动数	3,010,519,989.15	-2,749,678,246.67	260,841,742.48
其中：基金申购款	3,074,577,036.78	-2,813,411,043.00	261,165,993.78
基金赎回款	-64,057,047.63	63,732,796.33	-324,251.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,459,333,195.74	-3,313,260,603.27	146,072,592.47

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
活期存款利息收入	808,867.19
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	38,741.70
其他	3,132.97
合计	850,741.86

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-645,861.88
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	4,416,255.33
合计	3,770,393.45

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出股票成交总额	36,687,334.86
减：卖出股票成本总额	37,333,196.74
买卖股票差价收入	-645,861.88

6.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
申购基金份额总额	4,235,095,200.00
减：现金支付申购款总额	1,348,963,758.72
减：申购股票成本总额	2,881,715,185.95
申购差价收入	4,416,255.33

6.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	75,690,634.55
减：卖出/赎回基金成本总额	65,549,441.16
基金投资收益	10,141,193.39

6.4.7.14 债券投资收益**6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,400.00
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	-1,400.00

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,037,800.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,001,400.00
减：应收利息总额	37,800.00
买卖债券差价收入	-1,400.00

6.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期末未持有贵金属。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金于本报告期无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	788,087.47
基金投资产生的股利收益	-
合计	788,087.47

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1. 交易性金融资产	-14,187,855.05
——股票投资	5,933,030.16
——债券投资	-
——基金投资	-20,120,885.21
——资产支持证券投资	-
——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	-14,187,855.05

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	117,949.64

转换费收入	141.79
合计	118,091.43

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
交易所市场交易费用	2,210,188.59
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	59,650.06
其中：申购费	57,403.79
赎回费	655.20
合计	2,269,838.65

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,044.72
银行费用	6,010.33
其他	-
指数使用费	-
上清所账户维护费	-
中债登账户维护费	-
-	-
合计	99,767.23

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

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

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
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）	基金托管人、代销机构
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
国寿安保沪深 300ETF（简称“目标基金”）	公司管理的其他基金

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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方进行的交易。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 03 月 30 日期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

6.4.10.1.5 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均未发生应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	581,150.35	1,441,733.02
其中：支付销售机构的客户维护费	21,495.89	11,393.92

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

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

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

R 为基金管理费年费率

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	116,230.06	288,346.63

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10% 的费率计提；计算方法如下：

$$H = E \times R / \text{当年天数}$$

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

R 为基金托管费年费率

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期末及上年度末基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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 2019年6月30日		上年度末 2018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
中国人寿	4,641,143,460.44	94.2524%	509,728,655.22	80.0000%
集团公司	27,017,042.77	0.5487%	27,017,042.77	4.2400%

6.4.10.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	354,050,426.24	808,867.19	41,401,069.53	130,035.72

6.4.10.6 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 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 06 月 30 日期间均无其他关联交易事项。

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（2019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

无。

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
600485	信威集团	2016年12月26日	公告重大事项目	12.74	2019年7月12日	13.86	656,320	9,841,334.83	8,361,516.80	-

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**

本基金本报告期末及上年度末均未持有证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。

6.4.13 金融工具风险及管理

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。本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

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。本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务

人员 岗位自控构成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 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，其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的

匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及结算保证金等。本基金于本报告期末无债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019 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	354,050,426.24	-	-	-	354,050,426.24
结算备付金	838,857.34	-	-	-	838,857.34
存出保证金	969,710.02	-	-	-	969,710.02
交易性金融资产	-	-	-	4,716,381,041.55	4,716,381,041.55
应收利息	-	-	-	71,913.36	71,913.36
应收申购款	-	-	-	26,147.55	26,147.55
资产总计	355,858,993.60	-	-	4,716,479,102.46	5,072,338,096.06
负债					
应付赎回款	-	-	-	48,936.85	48,936.85
应付管理人报酬	-	-	-	184,491.35	184,491.35

应付托管费	-	-	-	36,898.27	36,898.27
应付交易费用	-	-	-	1,480,943.46	1,480,943.46
其他负债	-	-	-	351,912.36	351,912.36
负债总计	-	-	-	2,103,182.29	2,103,182.29
利率敏感度缺口	355,858,993.60	-	-	4,714,375,920.17	5,070,234,913.77
上年度末 2018 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	40,460,032.28	-	-	-	40,460,032.28
结算备付金	179,021.66	-	-	-	179,021.66
存出保证金	70,143.53	-	-	-	70,143.53
交易性金融资产	-	-	-	484,095,645.08	484,095,645.08
应收利息	-	-	-	8,979.84	8,979.84
应收申购款	-	-	-	19,521.08	19,521.08
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	40,709,197.47	-	-	484,124,146.00	524,833,343.47
负债					
应付赎回款	-	-	-	20,178.64	20,178.64
应付管理人报酬	-	-	-	22,506.69	22,506.69
应付托管费	-	-	-	4,501.35	4,501.35
应付交易费用	-	-	-	159,098.42	159,098.42
其他负债	-	-	-	638,065.22	638,065.22
负债总计	-	-	-	844,350.32	844,350.32
利率敏感度缺口	40,709,197.47	-	-	483,279,795.68	523,988,993.15

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款等，除此之外的金融资产和金融负债均不计息，因此市场利率的变动对本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，所持有的股票资产占基金

资产的比例不低于 90%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。于 2019 年 06 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	96,928,266.55	1.91	11,820,045.08	2.26
交易性金融资产—基金投资	4,619,452,775.00	91.11	472,275,600.00	90.13
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	4,716,381,041.55	93.02	484,095,645.08	92.39

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 系数是根据本报告期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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2019 年 6 月 30 日）	上年度末（2018 年 12 月 31 日）
	+5%	245,625,593.04	25,521,719.69
	-5%	-245,625,593.04	-25,521,719.69

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价

值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 4,708,019,524.75 元（上年度末：475,713,545.28 元），属于第二层次的余额为人民币 8,361,516.80 元（上年度末：8,382,099.80 元），无属于第三层次的余额（上年度末：无）。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期转入第三层次公允价值的金额为 0.00 元。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2019 年 8 月 27 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	96,928,266.55	1.91
	其中：股票	96,928,266.55	1.91
2	基金投资	4,619,452,775.00	91.07
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	354,889,283.58	7.00
8	其他各项资产	1,067,770.93	0.02
9	合计	5,072,338,096.06	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	1,475,158.00	0.03
B	采矿业	2,674,560.00	0.05
C	制造业	44,867,123.10	0.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,081,070.00	0.04
E	建筑业	2,679,960.00	0.05
F	批发和零售业	1,224,852.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	2,748,037.00	0.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,255,138.00	0.06
J	金融业	29,460,542.45	0.58
K	房地产业	4,098,040.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,082,160.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	260,040.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	116,850.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	428,166.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	476,570.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	96,928,266.55	1.91

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沪港通股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	656,320	8,361,516.80	0.16
2	601318	中国平安	78,000	6,911,580.00	0.14
3	600519	贵州茅台	2,945	2,897,880.00	0.06
4	600036	招商银行	75,000	2,698,500.00	0.05
5	000651	格力电器	36,000	1,980,000.00	0.04
6	000858	五粮液	15,000	1,769,250.00	0.03
7	000333	美的集团	33,000	1,711,380.00	0.03
8	601166	兴业银行	90,000	1,646,100.00	0.03
9	600887	伊利股份	44,905	1,500,276.05	0.03
10	600030	中信证券	57,000	1,357,170.00	0.03
11	601328	交通银行	201,000	1,230,120.00	0.02
12	600276	恒瑞医药	18,000	1,188,000.00	0.02
13	600016	民生银行	180,000	1,143,000.00	0.02
14	300498	温氏股份	31,300	1,122,418.00	0.02
15	600000	浦发银行	87,000	1,016,160.00	0.02
16	000661	长春高新	3,000	1,014,000.00	0.02
17	000002	万科A	36,000	1,001,160.00	0.02
18	601398	工商银行	156,000	918,840.00	0.02
19	601668	中国建筑	153,000	879,750.00	0.02
20	601601	中国太保	23,995	876,057.45	0.02
21	000001	平安银行	63,000	868,140.00	0.02
22	600900	长江电力	48,000	859,200.00	0.02
23	600837	海通证券	60,000	851,400.00	0.02
24	002415	海康威视	27,000	744,660.00	0.01
25	600104	上汽集团	26,954	687,327.00	0.01
26	600048	保利地产	51,000	650,760.00	0.01

27	601169	北京银行	108,000	638,280.00	0.01
28	603288	海天味业	6,000	630,000.00	0.01
29	600585	海螺水泥	15,000	622,500.00	0.01
30	601211	国泰君安	33,000	605,550.00	0.01
31	000725	京东方 A	174,000	598,560.00	0.01
32	000063	中兴通讯	18,000	585,540.00	0.01
33	601766	中国中车	72,000	582,480.00	0.01
34	601988	中国银行	153,000	572,220.00	0.01
35	600031	三一重工	42,000	549,360.00	0.01
36	601688	华泰证券	24,000	535,680.00	0.01
37	601888	中国国旅	6,000	531,900.00	0.01
38	600309	万华化学	12,000	513,480.00	0.01
39	600009	上海机场	6,000	502,680.00	0.01
40	600028	中国石化	90,000	492,300.00	0.01
41	000568	泸州老窖	6,000	484,980.00	0.01
42	600690	海尔智家	27,000	466,830.00	0.01
43	601229	上海银行	39,000	462,150.00	0.01
44	002475	立讯精密	18,000	446,220.00	0.01
45	601818	光大银行	117,000	445,770.00	0.01
46	000338	潍柴动力	36,000	442,440.00	0.01
47	300059	东方财富	32,400	439,020.00	0.01
48	002142	宁波银行	18,000	436,320.00	0.01
49	600019	宝钢股份	66,000	429,000.00	0.01
50	600050	中国联通	69,000	425,040.00	0.01
51	603160	汇顶科技	3,000	416,400.00	0.01
52	601012	隆基股份	18,000	415,980.00	0.01
53	601857	中国石油	60,000	412,800.00	0.01
54	002230	科大讯飞	12,000	398,880.00	0.01
55	600340	华夏幸福	12,000	390,840.00	0.01
56	001979	招商蛇口	18,000	376,200.00	0.01
57	600919	江苏银行	51,000	370,260.00	0.01
58	601989	中国重工	66,000	366,960.00	0.01
59	002304	洋河股份	3,000	364,680.00	0.01
60	600999	招商证券	21,000	358,890.00	0.01
61	601939	建设银行	48,000	357,120.00	0.01
62	002714	牧原股份	6,000	352,740.00	0.01
63	601390	中国中铁	54,000	352,080.00	0.01
64	601009	南京银行	42,000	346,920.00	0.01
65	600015	华夏银行	45,000	346,500.00	0.01

66	600436	片仔癀	3,000	345,600.00	0.01
67	601006	大秦铁路	42,000	339,780.00	0.01
68	601336	新华保险	6,000	330,180.00	0.01
69	601186	中国铁建	33,000	328,350.00	0.01
70	601899	紫金矿业	87,000	327,990.00	0.01
71	603833	欧派家居	3,000	322,860.00	0.01
72	002024	苏宁云商	27,000	309,960.00	0.01
73	601088	中国神华	15,000	305,700.00	0.01
74	002594	比亚迪	6,000	304,320.00	0.01
75	300033	同花顺	3,000	295,080.00	0.01
76	000776	广发证券	21,000	288,540.00	0.01
77	600958	东方证券	27,000	288,360.00	0.01
78	002027	分众传媒	54,000	285,660.00	0.01
79	600352	浙江龙盛	18,000	283,860.00	0.01
80	601225	陕西煤业	30,000	277,200.00	0.01
81	601933	永辉超市	27,000	275,670.00	0.01
82	600570	恒生电子	3,900	265,785.00	0.01
83	002202	金风科技	21,000	261,030.00	0.01
84	000876	新希望	15,000	260,550.00	0.01
85	603259	药明康德	3,000	260,040.00	0.01
86	000100	TCL 集团	78,000	259,740.00	0.01
87	600741	华域汽车	12,000	259,200.00	0.01
88	300142	沃森生物	9,000	255,240.00	0.01
89	603986	兆易创新	2,940	254,898.00	0.01
90	000538	云南白药	3,000	250,260.00	0.00
91	600547	山东黄金	6,000	247,020.00	0.00
92	601555	东吴证券	24,000	246,000.00	0.00
93	600588	用友网络	9,000	241,920.00	0.00
94	300015	爱尔眼科	7,800	241,566.00	0.00
95	000166	申万宏源	48,000	240,480.00	0.00
96	601155	新城控股	6,000	238,860.00	0.00
97	601669	中国电建	45,000	238,050.00	0.00
98	002736	国信证券	18,000	236,880.00	0.00
99	600886	国投电力	30,000	233,100.00	0.00
100	002032	苏泊尔	3,000	227,490.00	0.00
101	600406	国电南瑞	12,000	223,680.00	0.00
102	600010	宝钢股份	132,000	223,080.00	0.00
103	601377	兴业证券	33,000	222,420.00	0.00
104	600795	国电电力	87,000	220,980.00	0.00

105	601901	方正证券	30,000	213,300.00	0.00
106	600438	通威股份	15,000	210,900.00	0.00
107	000783	长江证券	27,000	210,870.00	0.00
108	000069	华侨城 A	30,000	208,500.00	0.00
109	600271	航天信息	9,000	207,450.00	0.00
110	300003	乐普医疗	9,000	207,180.00	0.00
111	600809	山西汾酒	3,000	207,150.00	0.00
112	002008	大族激光	6,000	206,280.00	0.00
113	600011	华能国际	33,000	205,590.00	0.00
114	600660	福耀玻璃	9,000	204,570.00	0.00
115	601800	中国交建	18,000	203,760.00	0.00
116	600703	三安光电	18,000	203,040.00	0.00
117	603993	洛阳钼业	51,000	201,960.00	0.00
118	601111	中国国航	21,000	200,970.00	0.00
119	000157	中联重科	33,000	198,330.00	0.00
120	600089	特变电工	27,000	195,750.00	0.00
121	600111	北方稀土	15,000	192,600.00	0.00
122	601600	中国铝业	48,000	188,160.00	0.00
123	600115	东方航空	30,000	188,100.00	0.00
124	002410	广联达	5,700	187,473.00	0.00
125	000963	华东医药	7,200	186,912.00	0.00
126	002044	美年健康	15,000	186,600.00	0.00
127	603019	中科曙光	5,300	186,030.00	0.00
128	002311	海大集团	6,000	185,400.00	0.00
129	600029	南方航空	24,000	185,280.00	0.00
130	600606	绿地控股	27,000	184,410.00	0.00
131	601985	中国核电	33,000	183,480.00	0.00
132	600383	金地集团	15,000	178,950.00	0.00
133	600705	中航资本	33,000	178,860.00	0.00
134	002422	科伦药业	6,000	178,380.00	0.00
135	300408	三环集团	9,000	175,050.00	0.00
136	600109	国金证券	18,000	174,960.00	0.00
137	002236	大华股份	12,000	174,240.00	0.00
138	601788	光大证券	15,000	171,300.00	0.00
139	600221	海航控股	84,000	170,520.00	0.00
140	600498	烽火通信	6,000	167,160.00	0.00
141	600522	中天科技	18,000	165,060.00	0.00
142	600516	方大炭素	13,410	164,808.90	0.00
143	600004	白云机场	9,000	163,800.00	0.00

144	600018	上港集团	24,000	163,680.00	0.00
145	601607	上海医药	9,000	163,350.00	0.00
146	600177	雅戈尔	25,200	160,020.00	0.00
147	600637	东方明珠	15,000	158,100.00	0.00
148	603156	养元饮品	4,200	155,736.00	0.00
149	601618	中国中冶	51,000	155,040.00	0.00
150	002466	天齐锂业	6,000	151,680.00	0.00
151	600196	复星医药	5,977	151,218.10	0.00
152	600487	亨通光电	9,000	150,840.00	0.00
153	000895	双汇发展	6,000	149,340.00	0.00
154	000425	徐工机械	33,000	147,180.00	0.00
155	300136	信维通信	6,000	146,700.00	0.00
156	601727	上海电气	27,000	145,260.00	0.00
157	600176	中国巨石	15,000	142,950.00	0.00
158	000768	中航飞机	9,000	141,750.00	0.00
159	600482	中国动力	6,000	141,720.00	0.00
160	600362	江西铜业	9,000	141,660.00	0.00
161	603260	合盛硅业	3,000	141,180.00	0.00
162	002460	赣锋锂业	6,000	140,580.00	0.00
163	300144	宋城演艺	6,000	138,840.00	0.00
164	000413	东旭光电	27,000	138,780.00	0.00
165	600867	通化东宝	9,000	138,600.00	0.00
166	601877	正泰电器	6,000	138,540.00	0.00
167	000728	国元证券	15,000	137,550.00	0.00
168	300124	汇川技术	6,000	137,460.00	0.00
169	002007	华兰生物	4,500	137,205.00	0.00
170	300024	机器人	9,000	137,070.00	0.00
171	600893	航发动力	6,000	136,260.00	0.00
172	002271	东方雨虹	6,000	135,960.00	0.00
173	600100	同方股份	15,000	135,750.00	0.00
174	601919	中远海控	27,000	135,540.00	0.00
175	601021	春秋航空	3,000	135,000.00	0.00
176	002241	歌尔股份	15,000	133,350.00	0.00
177	600023	浙能电力	30,000	132,600.00	0.00
178	601018	宁波港	30,000	131,700.00	0.00
179	600068	葛洲坝	21,000	130,830.00	0.00
180	002179	中航光电	3,900	130,494.00	0.00
181	000961	中南建设	15,000	129,900.00	0.00
182	300017	网宿科技	12,000	129,360.00	0.00

183	300122	智飞生物	3,000	129,300.00	0.00
184	002739	万达院线	7,000	129,080.00	0.00
185	002773	康弘药业	3,900	128,388.00	0.00
186	601998	中信银行	21,000	125,370.00	0.00
187	600926	杭州银行	15,000	124,950.00	0.00
188	600170	上海建工	33,000	124,080.00	0.00
189	002081	金螳螂	12,000	123,720.00	0.00
190	002050	三花智控	11,700	123,435.00	0.00
191	600489	中金黄金	12,000	123,240.00	0.00
192	600038	中直股份	3,000	123,060.00	0.00
193	000703	恒逸石化	9,000	122,940.00	0.00
194	600332	白云山	3,000	122,910.00	0.00
195	000629	*ST 钒钛	36,100	122,379.00	0.00
196	002673	西部证券	12,000	120,960.00	0.00
197	002120	韵达股份	3,900	120,198.00	0.00
198	000423	东阿阿胶	3,000	119,460.00	0.00
199	000596	古井贡酒	1,000	118,510.00	0.00
200	600066	宇通客车	9,000	117,180.00	0.00
201	002925	盈趣科技	3,000	117,030.00	0.00
202	300070	碧水源	15,000	116,850.00	0.00
203	002001	新 和 成	6,000	115,740.00	0.00
204	600219	南山铝业	51,000	115,260.00	0.00
205	600663	陆家嘴	7,400	114,700.00	0.00
206	000938	紫光股份	4,200	114,450.00	0.00
207	002146	荣盛发展	12,000	112,680.00	0.00
208	000630	铜陵有色	45,000	110,700.00	0.00
209	601881	中国银河	9,000	110,250.00	0.00
210	601997	贵阳银行	12,600	108,990.00	0.00
211	600398	海澜之家	12,000	108,840.00	0.00
212	000786	北新建材	6,000	108,780.00	0.00
213	002153	石基信息	3,000	108,570.00	0.00
214	000656	金科股份	18,000	108,540.00	0.00
214	002493	荣盛石化	9,000	108,540.00	0.00
215	601138	工业富联	9,000	108,450.00	0.00
216	601198	东兴证券	9,000	106,920.00	0.00
217	600674	川投能源	12,000	106,800.00	0.00
218	600153	建发股份	12,000	106,560.00	0.00
219	002065	东华软件	15,000	104,850.00	0.00
220	600369	西南证券	21,000	103,740.00	0.00

221	600346	恒力石化	8,400	102,144.00	0.00
222	002352	顺风股份	3,000	101,880.00	0.00
223	000625	长安汽车	15,000	99,450.00	0.00
224	600535	天士力	5,995	99,217.25	0.00
225	600208	新潮中宝	30,000	94,200.00	0.00
226	300296	利亚德	12,000	93,960.00	0.00
226	600977	中国电影	6,000	93,960.00	0.00
227	600027	华电国际	24,000	90,480.00	0.00
228	600566	济川药业	3,000	90,330.00	0.00
229	601117	中国化学	15,000	90,300.00	0.00
230	601992	金隅集团	24,000	90,240.00	0.00
231	000709	河钢股份	30,000	89,700.00	0.00
232	600760	中航沈飞	3,000	87,090.00	0.00
233	600085	同仁堂	3,000	87,000.00	0.00
234	600415	小商品城	21,000	86,520.00	0.00
235	601319	中国人保	9,000	85,410.00	0.00
236	600061	国投资本	6,000	84,060.00	0.00
237	600583	海油工程	15,000	84,000.00	0.00
238	601878	浙商证券	9,000	83,700.00	0.00
239	002252	上海莱士	12,000	83,400.00	0.00
240	603799	华友钴业	3,900	83,109.00	0.00
241	002010	传化股份	11,000	82,830.00	0.00
242	002508	老板电器	3,000	81,420.00	0.00
243	002555	三七互娱	6,000	81,300.00	0.00
244	600297	广汇汽车	18,000	80,280.00	0.00
245	601216	君正集团	24,000	78,960.00	0.00
246	000627	天茂集团	12,000	77,880.00	0.00
247	000671	阳光城	12,000	77,760.00	0.00
248	002624	完美世界	3,000	77,430.00	0.00
249	600688	上海石化	15,000	77,400.00	0.00
250	603858	步长制药	3,000	77,310.00	0.00
251	600816	安信信托	15,000	75,750.00	0.00
252	002468	申通快递	3,000	74,820.00	0.00
253	601633	长城汽车	9,000	74,430.00	0.00
254	300413	快乐购	1,800	73,890.00	0.00
255	300072	三聚环保	9,000	71,370.00	0.00
256	000402	金融街	9,000	70,560.00	0.00
257	600118	中国卫星	3,000	67,650.00	0.00
258	002294	信立泰	3,000	67,140.00	0.00

259	601238	广汽集团	6,000	65,580.00	0.00
260	600188	兖州煤业	6,000	65,220.00	0.00
261	600704	物产中大	12,000	65,040.00	0.00
262	601360	三六零	3,000	64,140.00	0.00
263	601066	中信建投	3,000	63,240.00	0.00
264	601228	广州港	15,000	62,700.00	0.00
265	002938	鹏鼎控股	2,100	61,656.00	0.00
266	000898	鞍钢股份	15,600	59,124.00	0.00
267	000415	渤海金控	15,000	58,800.00	0.00
268	601898	中煤能源	12,000	57,600.00	0.00
269	002558	巨人网络	3,000	54,510.00	0.00
270	002310	东方园林	9,000	54,000.00	0.00
271	002602	世纪华通	4,800	52,416.00	0.00
272	002411	延安必康	3,000	52,200.00	0.00
273	600339	中油工程	12,000	50,640.00	0.00
274	600025	华能水电	12,000	48,840.00	0.00
275	002939	N 长城	2,900	48,401.00	0.00
276	601162	天风证券	4,400	47,696.00	0.00
277	600372	中航电子	3,000	44,520.00	0.00
278	002601	佰利联	3,000	44,490.00	0.00
279	002945	华林证券	2,300	42,550.00	0.00
280	300433	蓝思科技	6,000	41,820.00	0.00
281	300251	光线传媒	6,000	40,800.00	0.00
282	600998	九州通	3,000	37,080.00	0.00
283	600233	圆通速递	3,000	36,990.00	0.00
284	601828	美凯龙	3,000	36,450.00	0.00
285	601298	青岛港	4,100	34,399.00	0.00
286	601108	财通证券	3,000	32,940.00	0.00
287	000553	沙隆达 A	3,000	32,160.00	0.00
288	601577	长沙银行	3,200	30,528.00	0.00
289	600733	北汽蓝谷	3,500	28,910.00	0.00
290	601808	中海油服	3,000	28,890.00	0.00
291	600390	五矿资本	3,000	28,290.00	0.00
292	002625	龙生股份	3,000	27,870.00	0.00
293	601838	成都银行	3,000	26,490.00	0.00
294	601212	白银有色	6,000	26,340.00	0.00
295	600299	安迪苏	2,500	25,925.00	0.00
296	000408	*ST 金源	3,000	24,810.00	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	601318	中国平安	293,938,151.41	56.10
2	600519	贵州茅台	123,912,353.77	23.65
3	600036	招商银行	123,662,131.87	23.60
4	601166	兴业银行	81,618,910.06	15.58
5	600030	中信证券	67,366,794.00	12.86
6	600887	伊利股份	62,181,226.82	11.87
7	601328	交通银行	60,424,403.24	11.53
8	600016	民生银行	56,573,260.46	10.80
9	600276	恒瑞医药	54,612,318.17	10.42
10	600000	浦发银行	47,946,507.02	9.15
11	601668	中国建筑	45,847,432.80	8.75
12	601398	工商银行	43,363,582.00	8.28
13	600837	海通证券	41,384,174.27	7.90
14	601601	中国太保	40,141,524.70	7.66
15	600900	长江电力	38,085,839.89	7.27
16	600104	上汽集团	35,402,645.06	6.76
17	600048	保利地产	34,696,234.88	6.62
18	601169	北京银行	32,596,661.32	6.22
19	601766	中国中车	31,781,290.00	6.07
20	601211	国泰君安	31,636,699.52	6.04
21	600585	海螺水泥	29,429,157.14	5.62
22	601988	中国银行	28,075,641.00	5.36
23	600309	万华化学	27,231,442.82	5.20
24	600031	三一重工	26,086,360.60	4.98
25	601688	华泰证券	25,780,358.00	4.92
26	600028	中国石化	25,364,918.00	4.84
27	603288	海天味业	24,203,082.72	4.62
28	600019	宝钢股份	24,052,971.40	4.59
29	601818	光大银行	23,347,290.53	4.46
30	601229	上海银行	22,929,047.60	4.38

31	600690	海尔智家	22,866,126.52	4.36
32	600050	中国联通	22,283,695.00	4.25
33	601857	中国石油	21,978,079.00	4.19
34	601888	中国国旅	20,129,184.64	3.84
35	601989	中国重工	19,764,092.00	3.77
36	601390	中国中铁	19,074,528.00	3.64
37	601186	中国铁建	18,596,277.00	3.55
38	600340	华夏幸福	18,120,853.80	3.46
39	600015	华夏银行	18,107,458.46	3.46
40	600999	招商证券	17,778,063.75	3.39
41	600919	江苏银行	17,687,073.00	3.38
42	600009	上海机场	17,326,862.39	3.31
43	601006	大秦铁路	17,266,152.54	3.30
44	601009	南京银行	17,258,420.30	3.29
45	603833	欧派家居	16,714,083.06	3.19
46	601939	建设银行	16,612,885.40	3.17
47	600436	片仔癀	16,514,332.90	3.15
48	601336	新华保险	16,399,191.54	3.13
49	600958	东方证券	15,542,252.00	2.97
50	601012	隆基股份	15,398,589.93	2.94
51	601899	紫金矿业	15,397,793.00	2.94
52	603160	汇顶科技	14,545,365.86	2.78
53	601088	中国神华	14,436,407.86	2.76
54	603986	兆易创新	13,739,615.52	2.62
55	601225	陕西煤业	13,527,390.69	2.58
56	603259	药明康德	13,213,495.50	2.52
57	600570	恒生电子	13,143,758.63	2.51
58	600741	华域汽车	13,037,613.00	2.49
59	601669	中国电建	12,821,186.00	2.45
60	600703	三安光电	12,379,325.65	2.36
61	600271	航天信息	12,352,095.93	2.36
62	601155	新城控股	12,297,830.24	2.35
63	600886	国投电力	12,180,599.52	2.32
64	600406	国电南瑞	11,994,479.12	2.29
65	603993	洛阳钼业	11,921,732.00	2.28
66	600010	宝钢股份	11,819,734.00	2.26

67	601933	永辉超市	11,694,487.81	2.23
68	601800	中国交建	11,556,370.28	2.21
69	601377	兴业证券	11,548,091.00	2.20
70	600516	方大炭素	11,516,452.40	2.20
71	600383	金地集团	11,488,734.69	2.19
72	601901	方正证券	11,362,677.30	2.17
73	600795	国电电力	11,311,422.00	2.16
74	600089	特变电工	10,844,743.90	2.07
75	600518	ST 康美	10,831,398.10	2.07
76	600352	浙江龙盛	10,794,154.96	2.06
77	601111	中国国航	10,772,128.00	2.06
78	600660	福耀玻璃	10,622,734.00	2.03

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	601318	中国平安	2,791,974.07	0.53
2	000540	中天金融	1,391,322.00	0.27
3	600519	贵州茅台	1,327,283.08	0.25
4	600036	招商银行	1,204,738.58	0.23
5	000538	云南白药	1,123,819.38	0.21
6	601166	兴业银行	797,181.75	0.15
7	600030	中信证券	721,046.00	0.14
8	601328	交通银行	647,954.00	0.12
9	600016	民生银行	605,942.00	0.12
10	600887	伊利股份	603,555.00	0.12
11	601398	工商银行	597,785.00	0.11
12	601288	农业银行	532,776.00	0.10
13	600276	恒瑞医药	530,516.00	0.10
14	600000	浦发银行	516,426.16	0.10
15	601668	中国建筑	487,317.00	0.09
16	601601	中国太保	475,090.57	0.09
17	002252	上海莱士	448,132.68	0.09
18	601988	中国银行	446,442.00	0.09

19	600837	海通证券	419,859.10	0.08
20	000333	美的集团	403,310.48	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	2,968,453,509.00
卖出股票收入（成交）总额	36,687,334.86

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国寿安保 沪深 300ETF	股票型	交易型开 放式	国寿安保 基金管理 有限公司	4,619,452,775.00	91.11

7.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 报告期内基金投资的前十名证券的发行主体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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	969,710.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	71,913.36
5	应收申购款	26,147.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,067,770.93

7.13.4 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。

7.13.5 期末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	600485	信威集团	8,361,516.80	0.16	公告重大事项

7.13.6 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
1,975	2,493,246.75	4,905,557,787.55	99.62%	18,604,533.75	0.38%

8.2 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	856,723.24	0.02%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	10~50
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（2014年6月5日）基金份额总额	5,130,087,968.40
本报告期期初基金份额总额	637,174,137.64
本报告期期间基金总申购份额	4,380,506,384.66
减：本报告期期间基金总赎回份额	93,518,201.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	4,924,162,321.30

注：报告期内基金总申购份额含转换入份额，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

本报告期末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。

2019 年 1 月，中国农业银行总行决定免去史静欣托管业务部副总裁职务。

2019 年 4 月，中国农业银行总行决定免去马曙光托管业务部总裁职务。

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安永华明会计师事务所（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、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
国盛证券	1	1,832,106,460.54	60.97%	1,156,608.08	60.65%	-
东方财富	1	747,888,317.84	24.89%	472,138.60	24.76%	-
安信证券	1	392,544,429.25	13.06%	247,812.17	13.00%	-
中信证券	1	32,601,636.23	1.08%	30,362.43	1.59%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-

太平洋证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例

国盛证券	1,001,400.00	100.00%	-	-	-	-	35,356,369.50	100.00%
东方财富	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-	-	-

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联接基金 2018 年第 4 季度报告	上证报及公司网站	2019 年 1 月 19 日
2	国寿安保部分基金新增华润银行为销售机构的公告	上证报及公司网站	2019 年 2 月 18 日
3	国寿安保部分基金新增众升财富为销售机构的公告	上证报及公司网站	2019 年 2 月 19 日
4	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金北京肯特瑞基金销售有限公司为销售机构并参加费率优惠活动的公告	上证报及公司网站	2019 年 3 月 14 日
5	关于旗下基金新增东海证券为销售机构并参加费率优惠的公告	上证报及公司网站	2019 年 3 月 25 日
6	国寿安保旗下基金参加交通银行手机银行 2019 年交易费率优惠活动的公告	上证报及公司网站	2019 年 3 月 30 日
7	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 2018 年度报告	上证报及公司网站	2019 年 3 月 30 日
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国人寿保险股份有限公司为销售机构的公告	上证报及公司网站	2019 年 4 月 11 日
9	国寿安保沪深 300 交易型开放式指	上证报及公司网站	2019 年 4 月 22 日

	数证券投资基金联接基金 2019 年第 1 季度报告		
10	国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资关联方证券的公告	上证报及公司网站	2019 年 5 月 17 日
11	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	上证报及公司网站	2019 年 6 月 27 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	20190101~20190630	536,745,697.99	4,131,414,805.22	-	4,668,160,503.21	94.80%
个人	-	-	-	-	-	-	-
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>							

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联接基金募集的文件

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

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

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联接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

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

2019 年 8 月 28 日