

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 2020 年第 2 季度报告

2020 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：中信证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年七月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 07 月 20 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	国寿安保创精选 88ETF 联接	
交易代码	008898	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 3 月 20 日	
报告期末基金份额总额	278,170,919.72 份	
投资目标	本基金通过对目标 ETF 基金份额的投资，追求跟踪标的指数，获得与指数收益相似的回报。	
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	国证创业板中盘精选 88 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 ETF 联接基金，通过投资于目标 ETF 跟踪国证创业板中盘精选 88 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 ETF 联接基金，目标 ETF 为股票型基金，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。	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	国寿安保创精选 88ETF 联接 A	国寿安保创精选 88ETF 联接 C

下属分级基金的交易代码	008898	008899
报告期末下属分级基金的份额总额	275,583,746.46 份	2,587,173.26 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	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
场内简称	创精选88
基金主代码	159804
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年3月4日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年3月31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	中信证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	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。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。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。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，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	国证创业板中盘精选88指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（ 2020 年 4 月 1 日 — 2020 年 6 月 30 日 ）	
	国寿安保创精选 88ETF 联接 A	国寿安保创精选 88ETF 联接 C
1. 本期已实现收益	1,462,049.70	15,537.12
2. 本期利润	11,017,487.24	99,061.48
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0469	0.0268
4. 期末基金资产净值	286,829,317.34	2,691,483.72
5. 期末基金份额净值	1.0408	1.0403

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 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保创精选 88ETF 联接 A

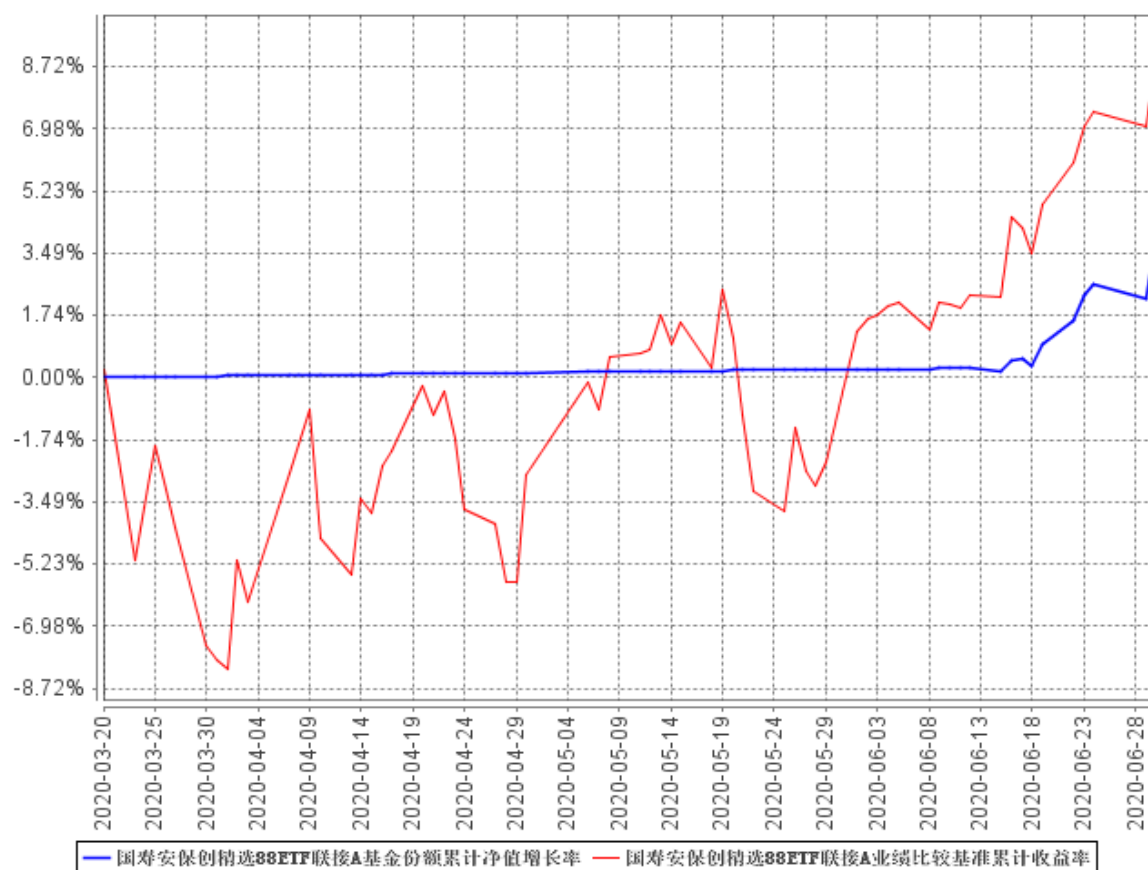
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.04%	0.28%	18.66%	1.53%	-14.62%	-1.25%
自基金合同生效起至今	4.08%	0.27%	9.26%	1.69%	-5.18%	-1.42%

国寿安保创精选 88ETF 联接 C

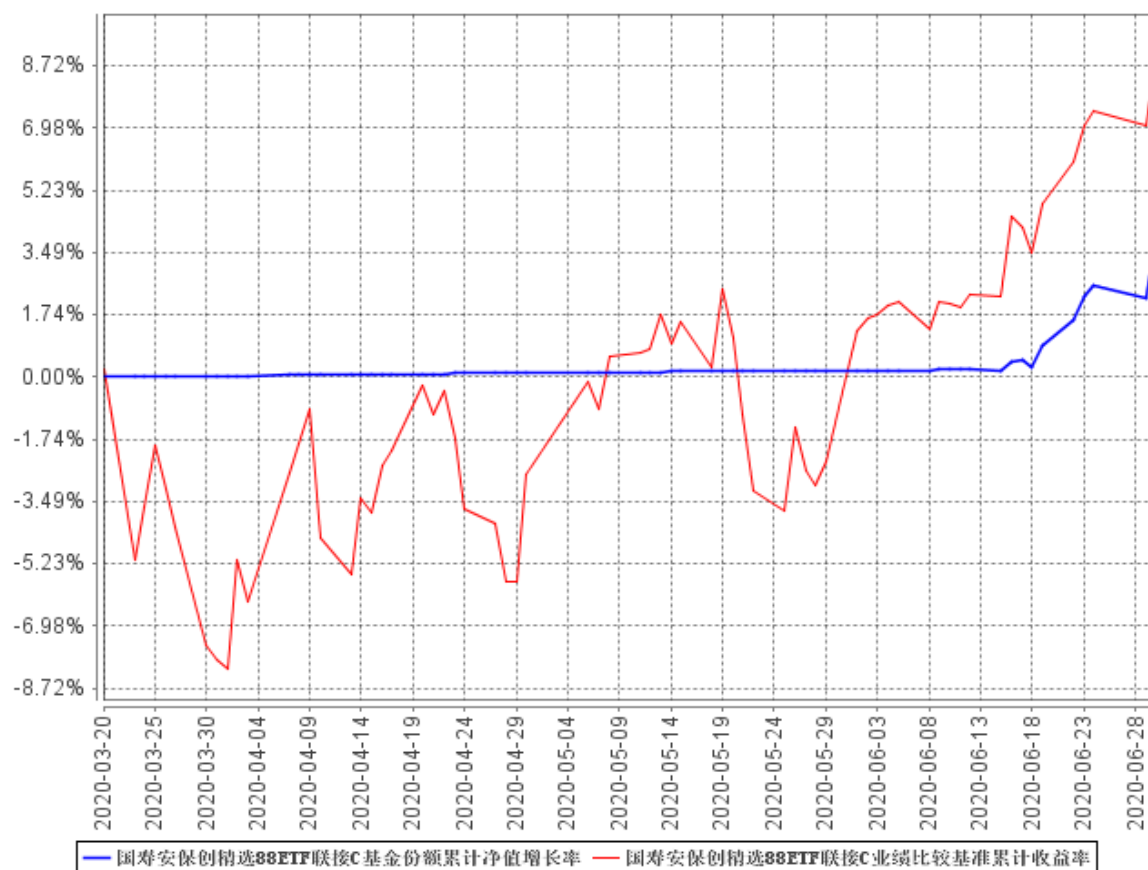
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.00%	0.28%	18.66%	1.53%	-14.66%	-1.25%
自基金合同生效起至今	4.03%	0.26%	9.26%	1.69%	-5.23%	-1.43%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国寿安保创精选88ETF联接A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



国寿安保创精选88ETF联接C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 2020 年 3 月 20 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。截止到本报告期末，本基金建仓期尚未结束。图示日期为 2020 年 3 月 20 日至 2020 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2020 年 3 月 20 日	—	10 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、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及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。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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《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合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，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 公平交易专项说明

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 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。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。

本基金处于建仓期，跟踪误差主要源自初期仓位不足、成分股调整以及目标 ETF 相对指数的偏离。成分股停复牌、日常申赎、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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保创精选 88ETF 联接 A 基金份额净值为 1.0408 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.04%；截至本报告期末国寿安保创精选 88ETF 联接 C 基金份额净值为 1.0403 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.00%；同期业绩比较基准收益率为 18.66%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	25,044,575.57	8.35
	其中：股票	25,044,575.57	8.35
2	基金投资	227,120,000.00	75.69
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	47,627,817.16	15.87
8	其他资产	288,941.42	0.09
9	合计	300,081,334.15	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末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	-	-
B	采矿业	184,536.00	0.06
C	制造业	15,994,989.98	5.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	537,585.60	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,174,456.99	2.48
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	222,500.00	0.08
M	科学研究和技术服务业	834,127.00	0.29
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	96,380.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	25,044,575.57	8.65

5.2.2 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持有港股通投资股票投资组合。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300054	鼎龙股份	47,800	793,480.00	0.27
2	300348	长亮科技	34,900	663,100.00	0.23
3	300751	迈为股份	2,200	653,312.00	0.23
4	300036	超图软件	25,400	639,572.00	0.22
5	300685	艾德生物	7,750	596,440.00	0.21
6	300031	宝通科技	19,900	498,296.00	0.17
7	300725	药石科技	4,000	497,000.00	0.17
8	300458	全志科技	12,800	471,040.00	0.16
9	300737	科顺股份	22,500	443,925.00	0.15
10	300702	天宇股份	3,997	424,961.04	0.15

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末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

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	国寿安保创精选 88ETF	股票指数型	交易型开放式	国寿安保国证创业板中盘精选 88ETF	227,120,000.00	78.45

5.10 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。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注**5.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

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。

5.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-

2	应收证券清算款	135,720.09
3	应收股利	—
4	应收利息	34,064.91
5	应收申购款	119,156.42
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	288,941.42

5.12.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.12.5 报告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。

5.12.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保创精选 88ETF 联接 A	国寿安保创精选 88ETF 联接 C
报告期期初基金份额总额	200,977,727.22	4,668,712.05
报告期期间基金总申购份额	75,091,638.94	716,582.21
减：报告期期间基金总赎回份额	485,619.70	2,798,121.00
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	—	—
报告期期末基金份额总额	275,583,746.46	2,587,173.26

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

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------

者类别	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	20200401~20200630	200,006,000.00	-	-	200,006,000.00	71.90%
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。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

9.1.1 中国证监会批准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募集的文件

9.1.2 《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合同》

9.1.3 《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托管协议》

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

9.1.5 报告期内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在指定媒体上披露的各项公告

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 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

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

9.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：www.gsfoods.com.cn

9.3.3 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

2020 年 7 月 21 日