

国寿安保新蓝筹灵活配置 混合型证券投资基金 2020 年中期报告

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：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 28 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 2020 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.....	5
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
§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合规守信情况的说明.....	10
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.....	11
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.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	36
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
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.....	39
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	39
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	39
7.12 投资组合报告附注.....	39

§8 基金份额持有人信息	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
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.....	41
§9 开放式基金份额变动	42
§10 重大事件揭示	43
10.1 基金份额持有人大会决议.....	43
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.....	43
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43
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.....	43
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	43
10.8 其他重大事件.....	44
§11 影响投资者决策的其他重要信息	46
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.....	46
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	46
§12 备查文件目录	47
12.1 备查文件目录.....	47
12.2 存放地点.....	47
12.3 查阅方式.....	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国寿安保新蓝筹混合
基金主代码	007074
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	306,517,495.72 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过深入的产业研究与上市公司研究，寻找细分领域领军企业，挖掘顺应时代发展和产业趋势的蓝筹股以及潜在蓝筹股的投资机会，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场的发展趋势，评估市场的系统风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例。 本基金将在保持风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。在大类资产配置上，在具备足够多本基金所定义的投资标的时，优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票及债券投资外，本基金还可通过投资衍生工具等，进一步为基金组合规避风险、增强收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中证全债指数收益率*25%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金、低于股票型基金，属于证券投资基金中的中高收益、风险品种。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉	郭明
	联系电话	010-50850744	010-66105799
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95588
传真		010-50850776	010-66105798
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 55 号
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 55 号

邮政编码	100033	100140
法定代表人	王军辉	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	4,297,153.23
本期利润	9,618,705.78
加权平均基金份额本期利润	0.1572
本期加权平均净值利润率	14.26%
本期基金份额净值增长率	10.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	32,837,080.11
期末可供分配基金份额利润	0.1071
期末基金资产净值	364,524,625.13
期末基金份额净值	1.1892
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	18.92%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

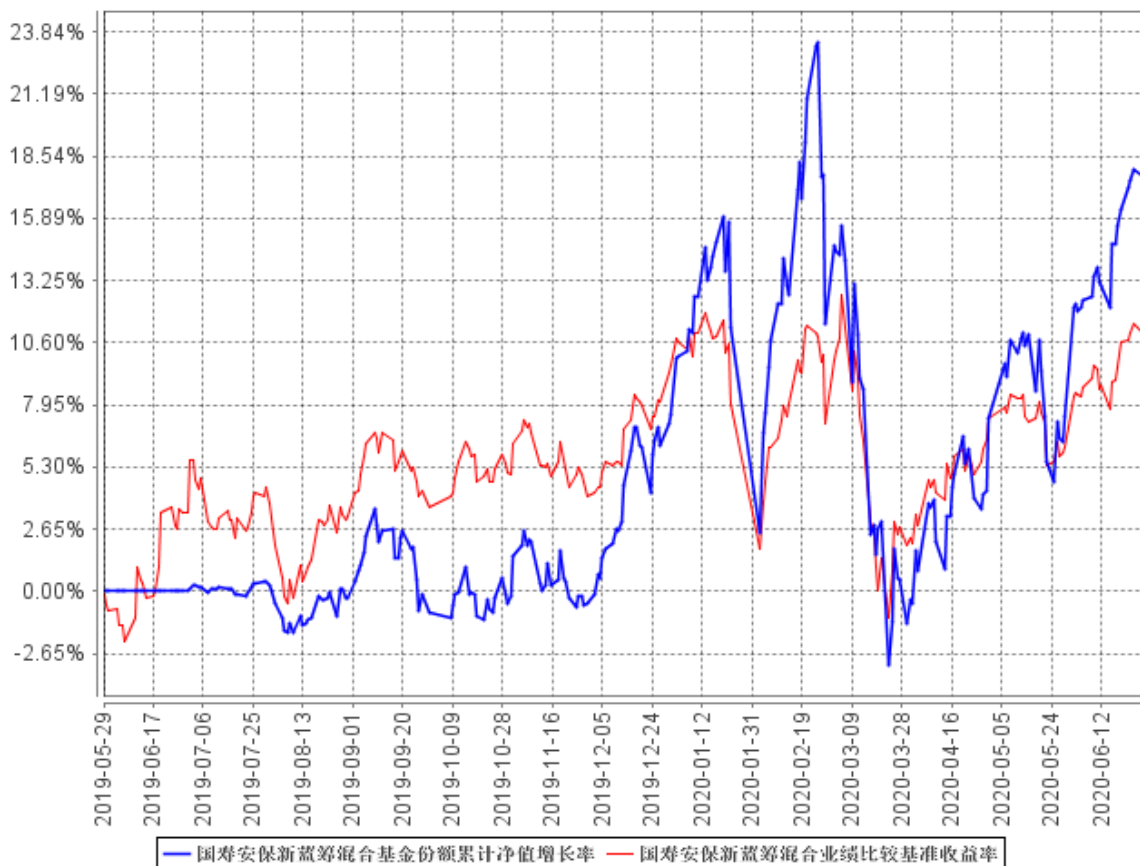
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.62%	1.12%	5.49%	0.67%	5.13%	0.45%
过去三个月	19.35%	1.28%	9.52%	0.67%	9.83%	0.61%
过去六个月	10.57%	1.96%	2.14%	1.13%	8.43%	0.83%
过去一年	18.85%	1.44%	8.37%	0.91%	10.48%	0.53%
自基金合同生效起至今	18.92%	1.37%	11.99%	0.90%	6.93%	0.47%

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

国寿安保新蓝筹混合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：本基金基金合同生效日为 2019 年 5 月 29 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。

§ 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 2020 年 6 月 30 日,公司共管理 63 只公募基金和部分私募资产管理计划,公司管理资产总规模为 2807.05 亿元,其中公募基金管理规模 2119.18 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		
张琦	股票投资总监、股票投资部总监及基金经理	2019 年 5 月 29 日	-	15 年	2005 年 1 月至 2015 年 5 月,任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理等职,2015 年 6 月加入国寿安保基金管理有限公司,现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监,国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金、国寿安保目标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保健康科学混合型证券投资基金、国寿安保消费新蓝海灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保研究精选混合型证券投资基金和国寿安保科技创新 3 年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

张标	基金经理	2019 年 5 月 29 日	-	6 年	张标先生，博士研究生，2014 年加入国寿安保基金，历任行业研究员、基金经理助理，现任国寿安保成长优选股票型证券投资基金、国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳吉混合型证券投资基金和国寿安保稳寿混合型证券投资基金基金经理。
----	------	-----------------	---	-----	--

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

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

1. 市场回顾

上半年全球经济遭遇了新冠疫情的持续冲击，叠加中美博弈等因素，金融市场跌宕起伏。A 股先后经历国内国外疫情冲击，一季度即出现了两次泥沙俱下的大幅度下跌。进入二季度，伴随疫情的逐步缓解以及复工复产的开展，A 股市场有所缓和，呈

现了显著的结构行情，内需相关领域投资机会丰富，部分科技板块受益于政策导向也跑出了一定的超额收益。总体而言，国际经济形势预期不明朗、海外疫情的持续蔓延加大了今年金融市场的不确定性，也对股票投研的应变能力提出了更高的要求。市场方面，上半年上证综指、沪深 300、创业板指等重要指数分别上涨-2.15%、1.64%、35.60%；一级行业中，医药生物、休闲服务、电子、食品饮料等行业涨幅居前，体现出显著的超额收益，采掘、银行、非银金融跌幅居前。

2. 运行分析

本报告期国寿安保新蓝筹基金做了一定的持股结构调整，布局方向为符合基金合同定义的个股，风格偏均衡。在二季度末，股票比例因大额申购出现了较大幅度的下降，主要配置行业为电子、金融、家电、汽车、军工等，其中电子行业配置比例最高。

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 1.1892 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.57%，业绩比较基准收益率为 2.14%。

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，国内复工复产基本恢复正常，但海外疫情依旧严重。在经济全球化程度较高的背景下，外贸相关企业存在一定压力。随着“促进内需消费”、“新基建”建设等相关政策落地，国内经济下行能得到一定程度对冲。我们继续看好 A 股核心资产，包括具有核心竞争力的行业龙头，以及 A 股相关稀缺标的。同时，我们也看好国产化替代机会，随着中国制造能力增强、产品竞争力增加，高端领域的国产化替代具备长期投资价值。

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交易和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据。

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

本基金在本报告期末未出现连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或者基金净资产低于五千万元的情形。

§ 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

本报告期内，本基金托管人在对国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

报告期内，国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的管理人—国寿安保基金管理有限公司在新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对国寿安保基金管理有限公司编制和披露的国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	123,195,493.89	8,298,036.10
结算备付金		159,417.92	171,451.45
存出保证金		31,482.91	41,832.55
交易性金融资产	6.4.7.2	195,269,139.08	72,563,589.75
其中：股票投资		195,269,139.08	72,563,589.75
基金投资		-	-
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		62,044,305.96	-
应收利息	6.4.7.5	11,230.51	2,554.85
应收股利		-	-
应收申购款		24,273.62	39,590.57
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		380,735,343.89	81,117,055.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		15,215,578.38	-
应付赎回款		538,104.35	1,018,460.44
应付管理人报酬		117,235.26	134,206.32
应付托管费		19,539.20	22,367.70
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	230,442.23	101,091.80
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	89,819.34	130,000.00
负债合计		16,210,718.76	1,406,126.26
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	306,517,495.72	74,112,058.12
未分配利润	6.4.7.10	58,007,129.41	5,598,870.89
所有者权益合计		364,524,625.13	79,710,929.01
负债和所有者权益总计		380,735,343.89	81,117,055.27

6.2 利润表

会计主体：国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 5 月 29 日(基 金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		10,747,433.32	671,203.08
1.利息收入		43,884.88	646,403.08
其中：存款利息收入	6.4.7.11	31,287.62	405,045.99
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		12,597.26	241,357.09
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,374,428.93	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	4,971,838.93	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	402,590.00	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	5,321,552.55	24,800.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	7,566.96	-
减：二、费用		1,128,727.54	482,212.83
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	520,791.25	391,490.99
2. 托管费	6.4.10.2.2	86,798.55	65,248.54

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	430,052.43	3,676.66
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	6.4.7.20	91,085.31	21,796.64
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,618,705.78	188,990.25
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,618,705.78	188,990.25

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 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）	74,112,058.12	5,598,870.89	79,710,929.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	9,618,705.78	9,618,705.78
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）	232,405,437.60	42,789,552.74	275,194,990.34
其中：1.基金申购款	257,636,259.52	45,553,618.28	303,189,877.80
2.基金赎回款	-25,230,821.92	-2,764,065.54	-27,994,887.46
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）	306,517,495.72	58,007,129.41	364,524,625.13
项目	上年度可比期间 2019 年 5 月 29 日（基金合同生效日）至 2019 年 6 月 30 日		

股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、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、中小企业私募债、证券公司短期公司债、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、权证、股指期货、国债期货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。本基金可以参与融资交易。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中不低于 80%的非现金资产投资于本基金所界定的新蓝筹主题相关证券；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的 5%的现金或者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》、《公开募集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〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

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 2020 年 06 月 30 日的财务状况以及 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正。

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，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。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 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 2020 年 6 月 30 日
活期存款	123,195,493.89
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：	123,195,493.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	183,403,430.86	195,269,139.08	11,865,708.22
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	183,403,430.86	195,269,139.08	11,865,708.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未进行买断式逆回购交易。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	11,144.51
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	71.80
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	-
应收出借证券利息	-
其他	14.20
合计	11,230.51

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 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	230,442.23
银行间市场应付交易费用	-
合计	230,442.23

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	311.74
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,507.60
合计	89,819.34

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	74,112,058.12	74,112,058.12
本期申购	257,636,259.52	257,636,259.52
本期赎回(以“-”号填列)	-25,230,821.92	-25,230,821.92
- 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	306,517,495.72	306,517,495.72

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

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	2,157,751.00	3,441,119.89	5,598,870.89
本期利润	4,297,153.23	5,321,552.55	9,618,705.78
本期基金份额交易产生的变动数	26,382,175.88	16,407,376.86	42,789,552.74
其中：基金申购款	27,628,231.91	17,925,386.37	45,553,618.28
基金赎回款	-1,246,056.03	-1,518,009.51	-2,764,065.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,837,080.11	25,170,049.30	58,007,129.41

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
----	----------------------------

活期存款利息收入	30,025.09
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	933.92
其他	328.61
合计	31,287.62

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	109,873,833.41
减：卖出股票成本总额	104,901,994.48
买卖股票差价收入	4,971,838.93

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未投资债券。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 06 月 30 日无投资资产支持证券产生的收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日无投资贵金属产生的收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期 2020 年 06 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	402,590.00
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	402,590.00

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	5,321,552.55
——股票投资	5,321,552.55
——债券投资	-
——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	5,321,552.55

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	7,566.96
合计	7,566.96

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	430,052.43
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	430,052.43

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	1,577.71
合计	91,085.31

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

截至财务报表批准日，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

本基金本会计期间内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	基金管理人、注册登记机构、直销机构
工商银行	基金托管人、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司、基金销售机构
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.1 关联方报酬

6.4.10.1.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月 30日	上年度可比期间 2019年5月29日(基金合同生效日) 至2019年6月30日

当期发生的基金应支付的管理费	520,791.25	391,490.99
其中：支付销售机构的客户维护费	94,052.08	180,978.77

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 1.50%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.1.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年5月29日(基金合同生效日)至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	86,798.55	65,248.54

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 0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.1.3 销售服务费

无。

6.4.10.2 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.3 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

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

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

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 2020年6月30日		上年度末 2019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 保险股份 有限公司	40,000,800.00	13.05%	40,000,800.00	53.97%

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 2020年1月1日至2020年6月30 日		上年度可比期间 2019年5月29日(基金合同生效日)至2019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
中国工商银行	123,195,493.89	31,287.62	90,685,885.01	23,338.52

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2020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	可流 通日	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
300845	捷安 高科	2020年 6月24 日	2020 年7月 3日	新股流 通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝 股份	2020年 6月23 日	2020 年7月 2日	新股流 通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特	2020年	2020	新股流	5.94	5.94	948	5,631.12	5,631.12	-

	智能	6 月 30 日	年 7 月 8 日	通受限						
300846	首都 在线	2020 年 6 月 22 日	2020 年 7 月 1 日	新股流 通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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、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；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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放期内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。

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、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	123,195,493.89	-	-	-	123,195,493.89
结算备付金	159,417.92	-	-	-	159,417.92
存出保证金	31,482.91	-	-	-	31,482.91
交易性金融资产	-	-	-	195,269,139.08	195,269,139.08
应收证券清算款	-	-	-	62,044,305.96	62,044,305.96
应收利息	-	-	-	11,230.51	11,230.51
应收申购款	-	-	-	24,273.62	24,273.62
资产总计	123,386,394.72	-	-	257,348,949.17	380,735,343.89
负债					
应付证券清算款	-	-	-	15,215,578.38	15,215,578.38
应付赎回款	-	-	-	538,104.35	538,104.35
应付管理人报酬	-	-	-	117,235.26	117,235.26

应付托管费	-	-	-	19,539.20	19,539.20
应付交易费用	-	-	-	230,442.23	230,442.23
其他负债	-	-	-	89,819.34	89,819.34
负债总计	-	-	-	16,210,718.76	16,210,718.76
利率敏感度缺口	123,386,394.72	-	-	241,138,230.41	364,524,625.13
上年度末 2019 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	8,298,036.10	-	-	-	8,298,036.10
结算备付金	171,451.45	-	-	-	171,451.45
存出保证金	41,832.55	-	-	-	41,832.55
交易性金融资产	-	-	-	72,563,589.75	72,563,589.75
应收利息	-	-	-	2,554.85	2,554.85
应收申购款	-	-	-	39,590.57	39,590.57
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	8,511,320.10	-	-	72,605,735.17	81,117,055.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,018,460.44	1,018,460.44
应付管理人报酬	-	-	-	134,206.32	134,206.32
应付托管费	-	-	-	22,367.70	22,367.70
应付交易费用	-	-	-	101,091.80	101,091.80
其他负债	-	-	-	130,000.00	130,000.00
负债总计	-	-	-	1,406,126.26	1,406,126.26
利率敏感度缺口	8,511,320.10	-	-	71,199,608.91	79,710,929.01

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和债券，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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中不低于 80%的非现金资产投资于本基金所界定的新蓝筹主题相关证券；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的 5%的现金或者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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		上年度末 2019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	195,269,139.08	53.57	72,563,589.75	91.03
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	195,269,139.08	53.57	72,563,589.75	91.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1、假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变		
	2、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；		
	3、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。		
分析	风险价值 (单位：人民币元)	本期末 (2020年06月30日)	上年度末 (2019年12月31日)
	+5%	19,684,329.76	2,233,337.13
	-5%	-19,684,329.76	-2,233,337.13

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、买入返售金融资产等，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

本基金于本报告期末持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 195,243,892.88 元，属于第二层次的余额为人民币 25,246.2 元，本报告期末无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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可转换债券的公允价值列入第一层次。本基金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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

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 2020 年 8 月 28 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	195,269,139.08	51.29
	其中：股票	195,269,139.08	51.29
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	123,354,911.81	32.40
8	其他各项资产	62,111,293.00	16.31
9	合计	380,735,343.89	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	167,239,197.91	45.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,660.80	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	3,651,000.00	1.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,232,280.37	2.26
J	金融业	14,832,000.00	4.07
K	房地产业	1,307,000.00	0.36
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	195,269,139.08	53.57

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持有港股通投资股票。

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	002008	大族激光	330,000	11,863,500.00	3.25
2	600036	招商银行	350,000	11,802,000.00	3.24
3	600887	伊利股份	360,000	11,206,800.00	3.07
4	300327	中颖电子	291,970	9,459,828.00	2.60
5	600884	杉杉股份	799,950	9,431,410.50	2.59
6	300036	超图软件	325,000	8,183,500.00	2.24
7	688396	华润微	150,000	6,516,000.00	1.79
8	002594	比亚迪	90,000	6,462,000.00	1.77
9	600703	三安光电	250,000	6,250,000.00	1.71
10	300639	凯普生物	120,000	6,231,600.00	1.71
11	688358	祥生医疗	60,000	5,719,800.00	1.57
12	000651	格力电器	100,000	5,657,000.00	1.55
13	600276	恒瑞医药	60,000	5,538,000.00	1.52
14	600660	福耀玻璃	260,000	5,426,200.00	1.49
15	600438	通威股份	300,000	5,214,000.00	1.43
16	300724	捷佳伟创	55,000	4,869,150.00	1.34
17	000063	中兴通讯	120,000	4,815,600.00	1.32
18	603986	兆易创新	20,000	4,718,200.00	1.29
19	300482	万孚生物	40,000	4,160,000.00	1.14
20	002677	浙江美大	359,947	4,060,202.16	1.11
21	000977	浪潮信息	100,000	3,918,000.00	1.07
22	603766	隆鑫通用	1,000,000	3,870,000.00	1.06
23	002456	欧菲光	210,000	3,861,900.00	1.06
24	603801	志邦家居	140,000	3,736,600.00	1.03
25	000034	神州数码	150,000	3,651,000.00	1.00
26	002138	顺络电子	140,000	3,493,000.00	0.96
27	300750	宁德时代	20,000	3,487,200.00	0.96
28	600741	华域汽车	160,000	3,326,400.00	0.91

29	600885	宏发股份	80,000	3,209,600.00	0.88
30	002626	金达威	120,000	3,115,200.00	0.85
31	000100	TCL 科技	500,000	3,100,000.00	0.85
32	300059	东方财富	150,000	3,030,000.00	0.83
33	600563	法拉电子	30,000	1,854,000.00	0.51
34	300623	捷捷微电	60,000	1,803,000.00	0.49
35	000951	中国重汽	50,000	1,563,000.00	0.43
36	002242	九阳股份	40,000	1,490,800.00	0.41
37	000002	万 科 A	50,000	1,307,000.00	0.36
38	002851	麦格米特	45,000	1,166,400.00	0.32
39	000860	顺鑫农业	20,000	1,139,600.00	0.31
40	300661	圣邦股份	3,000	915,150.00	0.25
41	002706	良信电器	50,000	834,000.00	0.23
42	300577	开润股份	30,000	809,100.00	0.22
43	600055	万东医疗	50,000	800,500.00	0.22
44	002572	索 菲 亚	30,000	725,100.00	0.20
45	603596	伯特利	20,000	704,000.00	0.19
46	300703	创源文化	50,000	652,500.00	0.18
47	002987	京北方	616	36,682.80	0.01
48	605166	聚合顺	1,352	21,429.20	0.01
49	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.01
50	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.00
51	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
52	600956	新天绿能	1,520	7,660.80	0.00
53	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
54	300840	酷特智能	948	5,631.12	0.00
55	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	600036	招商银行	11,799,180.00	14.80
2	002008	大族激光	11,432,283.44	14.34
3	600887	伊利股份	11,167,096.00	14.01
4	600884	杉杉股份	9,606,915.60	12.05
5	002594	比 亚 迪	7,751,764.06	9.72

6	688396	华润微	6,197,131.24	7.77
7	600703	三安光电	6,069,730.00	7.61
8	000651	格力电器	5,624,180.00	7.06
9	600276	恒瑞医药	5,536,639.20	6.95
10	600660	福耀玻璃	5,433,242.00	6.82
11	600438	通威股份	5,317,113.00	6.67
12	300327	中颖电子	5,160,856.40	6.47
13	000063	中兴通讯	4,972,527.00	6.24
14	688358	祥生医疗	4,791,122.87	6.01
15	603986	兆易创新	4,765,246.00	5.98
16	603801	志邦家居	4,677,029.89	5.87
17	300639	凯普生物	4,491,531.00	5.63
18	300036	超图软件	4,254,298.00	5.34
19	000977	浪潮信息	4,144,983.28	5.20
20	002677	浙江美大	4,035,617.28	5.06
21	603766	隆鑫通用	3,917,752.00	4.91
22	300724	捷佳伟创	3,832,170.00	4.81
23	300482	万孚生物	3,791,250.00	4.76
24	002138	顺络电子	3,582,955.00	4.49
25	000034	神州数码	3,547,411.00	4.45
26	300750	宁德时代	3,437,431.00	4.31
27	002456	欧菲光	3,377,260.00	4.24
28	600741	华域汽车	3,346,050.00	4.20
29	600885	宏发股份	3,069,301.00	3.85
30	002626	金达威	3,048,902.35	3.82
31	000100	TCL 科技	3,012,699.00	3.78
32	300059	东方财富	2,839,244.00	3.56
33	002572	索菲亚	2,700,987.00	3.39
34	300232	洲明科技	2,315,376.72	2.90
35	002508	老板电器	1,980,606.00	2.48
36	300418	昆仑万维	1,915,095.00	2.40
37	688099	晶晨股份	1,887,483.68	2.37
38	002126	银轮股份	1,838,696.00	2.31
39	300207	欣旺达	1,738,291.34	2.18
40	601012	隆基股份	1,700,063.00	2.13
41	002484	江海股份	1,657,467.00	2.08

42	300119	瑞普生物	1,628,218.00	2.04
----	--------	------	--------------	------

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	600036	招商银行	4,857,476.00	6.09
2	002035	华帝股份	4,672,515.21	5.86
3	002508	老板电器	4,461,853.00	5.60
4	600104	上汽集团	4,352,384.55	5.46
5	000333	美的集团	4,310,384.00	5.41
6	000063	中兴通讯	4,302,577.94	5.40
7	601318	中国平安	4,273,491.00	5.36
8	002572	索菲亚	3,965,130.00	4.97
9	601933	永辉超市	3,773,890.28	4.73
10	000625	长安汽车	3,650,151.72	4.58
11	600887	伊利股份	3,493,214.00	4.38
12	600741	华域汽车	3,141,331.68	3.94
13	000338	潍柴动力	3,078,130.00	3.86
14	000002	万科A	2,820,696.00	3.54
15	601138	工业富联	2,790,385.06	3.50
16	600563	法拉电子	2,449,393.00	3.07
17	300232	洲明科技	2,161,481.22	2.71
18	600038	中直股份	2,072,144.05	2.60
19	688099	晶晨股份	2,053,259.43	2.58
20	002050	三花智控	2,012,733.00	2.53
21	300418	昆仑万维	1,810,660.00	2.27
22	002484	江海股份	1,802,362.00	2.26
23	002126	银轮股份	1,769,574.48	2.22
24	300623	捷捷微电	1,683,593.80	2.11
25	600584	长电科技	1,607,200.00	2.02

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	222,285,991.26
卖出股票收入（成交）总额	109,873,833.41

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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金报告期末未持有股指期货。

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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

7.12.2 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

本基金本报告期投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	31,482.91
2	应收证券清算款	62,044,305.96
3	应收股利	-
4	应收利息	11,230.51

5	应收申购款	24,273.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	62,111,293.00

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无流通受限的情况。

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
375	817,379.99	294,742,871.00	96.16%	11,774,624.72	3.84%

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	225,088.30	0.0734%

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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（ 2019 年 5 月 29 日 ）基金份额总额	297,605,745.14
本报告期期初基金份额总额	74,112,058.12
本报告期基金总申购份额	257,636,259.52
减：本报告期基金总赎回份额	25,230,821.92
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	306,517,495.72

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、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	
中信证券	2	242,986,602.55	73.31%	226,293.41	77.82%	-
长江证券	2	76,121,269.06	22.97%	55,667.51	19.14%	-
银河证券	2	10,201,937.68	3.08%	7,460.64	2.57%	-
太平洋证券	1	2,147,159.84	0.65%	1,355.34	0.47%	-
安信证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	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》（证监基金字[2007]48号）的有关规定要求，本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。

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	-	-	100,000,000.00	100.00%	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
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	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 18 日
2	国寿安保基金关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 25 日
3	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加南京苏宁基金销售有限公司转换手续费率优惠活动的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 30 日
4	国寿安保基金管理有限公司关于	中证报、证监会指定	2020 年 4 月 15 日

	旗下部分基金在喜鹊财富基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	网站及公司网站	
5	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 22 日
6	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金 2019 年度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 30 日
7	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 6 月 5 日
8	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金托管协议	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 6 月 5 日
9	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（摘要）（2020 年第 1 号）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 6 月 5 日
10	国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 6 月 5 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	20200101~20200628	40,000,800.00	-	-	40,000,800.00	13.05%
	2	20200624~20200630	0.00	63,801,786.47	-	63,801,786.47	20.82%
	3	20200624~20200630	0.00	63,801,786.47	-	63,801,786.47	20.82%
	4	20200629~20200630	0.00	63,569,249.03	-	63,569,249.03	20.74%
	5	20200629~20200630	0.00	63,569,249.03	-	63,569,249.03	20.74%
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-	-	-

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新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保新蓝筹灵活配置混合型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 报告期内国寿安保新蓝筹灵活配置混合型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

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

2020 年 8 月 29 日