

国寿安保中证 500 交易型开放式  
指数证券投资基金  
2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 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：2021 年 3 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 2021 年 03 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。

本报告中的财务资料经审计，安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
3.4 过去三年基金的利润分配情况	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
<b>§6 审计报告</b>	<b>11</b>
6.1 审计报告基本信息	11
6.2 审计报告的基本内容	12
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>13</b>
7.1 资产负债表	13
7.2 利润表	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
7.4 报表附注	16
<b>§8 投资组合报告</b>	<b>39</b>
8.1 期末基金资产组合情况	39

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	40
8.3 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 .....	40
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	54
8.6 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 .....	54
8.7 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
8.8 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
8.9 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
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	55
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
8.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>56</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	56
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	56
9.4 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 .....	56
<b>§10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>56</b>
<b>§11 重大事件揭示 .....</b>	<b>57</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
11.2 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 .....	57
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	57
11.4 基金投资策略的改变 .....	57
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	57
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	57
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	57
11.8 其他重大事件 .....	59
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>60</b>
12.1 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
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	61
<b>§13 备查文件目录 .....</b>	<b>61</b>
13.1 备查文件目录 .....	61
13.2 存放地点 .....	61
13.3 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 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	国寿 500
基金主代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 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	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	588,318,687.00 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	2015 年 7 月 3 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
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。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，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近的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95599
传真	010-50850776	010-68121816
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 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

注：中国农业银行股份有限公司法定代表人已于 2021 年 2 月 9 日变更为谷澍。

### 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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
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、基金净值表现及利润分配情况

### 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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	55,940,018.79	-20,398,409.40	-23,204,748.30
本期利润	160,034,633.22	55,523,284.09	-75,924,415.41
加权平均基金份额本期利润	0.2612	0.1150	-0.4292
本期加权平均净值利润率	20.48%	10.80%	-37.98%
本期基金份额净值增长率	21.94%	26.44%	-32.58%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	-515,682,836.17	-656,335,418.05	-233,606,419.74
期末可供分配基金份额利润	-0.8765	-1.0315	-1.2674
期末基金资产净值	809,348,527.85	717,909,176.40	164,462,919.65
期末基金份额净值	1.3757	1.1282	0.8923
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	-36.30%	-47.76%	-58.68%

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
过去三个月	2.96%	1.15%	2.82%	1.16%	0.14%	-0.01%
过去六个月	9.09%	1.44%	8.57%	1.45%	0.52%	-0.01%
过去一年	21.94%	1.61%	20.87%	1.62%	1.07%	-0.01%
过去三年	3.95%	1.53%	1.86%	1.54%	2.09%	-0.01%
过去五年	-11.89%	1.50%	-16.42%	1.52%	4.53%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-36.30%	1.76%	-35.48%	1.79%	-0.82%	-0.03%

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

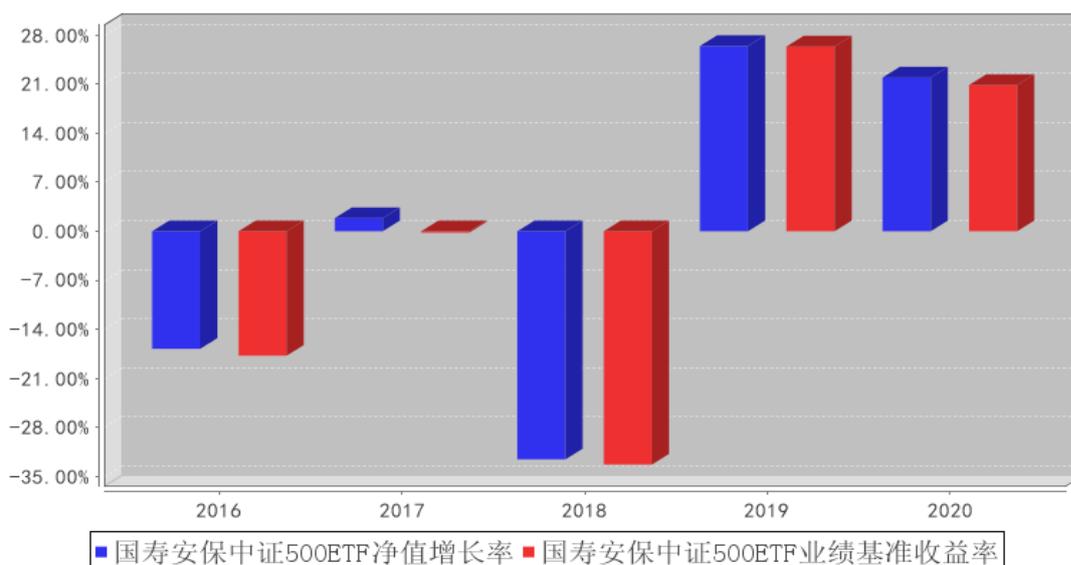
国寿安保中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 05 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 3 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 2015 年 05 月 29 日至 2020 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

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2020年12月31日,公司共管理71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2996.65亿元,其中公募证券投资基金管理规模为2296.27亿元。

#### 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5月29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、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、国寿安保稳丰6个月持有期混合型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

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 公平交易制度和控制方法

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。

### 4.3.2 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。

### 4.3.3 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。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为1.3757元；本报告期基金份额净值增长率为

21.94%，业绩比较基准收益率为20.87%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年全球市场经历了疫情考验，年初疫情爆发股市有较大幅度波动，随后流动性支持和复工复产稳步推进带动经济动能恢复，主要指数都创出近年新高。展望2021年，疫情好转背景下，全球经济基本面有望复苏，有利于上市公司盈利能力改善。央行表态货币政策不会急转弯，但市场对经济复苏后可能的宏观流动性边际收紧有所担忧。市场近年呈现比较明显的结构性行情，整体上核心资产受到市场追捧，也使得部分板块估值处于高位，在流动性不会继续大幅宽松的情况下，估值消化将是必须面对的问题，需要更加重视基本面与估值相互印证匹配的投资逻辑。整体上，权益市场仍将是结构化行情为主，受企业盈利恢复和流动性边际趋紧等宏观因素共同作用，阶段性投资机会将不断涌现。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司2020年1月1日至2020年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2021）审字第 61090605_A09 号

## 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无。
其他事项	无。
其他信息	<p>国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	黄悦栋 郭燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2021 年 03 月 30 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	5,252,939.56	4,253,270.08
结算备付金		-	-
存出保证金		30,926.98	6,567.74
交易性金融资产	7.4.7.2	797,929,494.64	714,300,817.18
其中：股票投资		797,913,194.64	714,209,817.18
基金投资		-	-
债券投资		16,300.00	91,000.00
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,195,640.39	99,240.32
应收利息	7.4.7.5	1,203.80	935.28
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		810,410,205.37	718,660,830.60
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		339,894.74	294,715.01
应付托管费		67,978.95	58,942.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	423,318.14	176,342.53
应交税费		1.38	0.25
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	230,484.31	221,653.42
负债合计		1,061,677.52	751,654.20
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	1,270,579,965.54	1,374,244,594.45
未分配利润	7.4.7.10	-461,231,437.69	-656,335,418.05
所有者权益合计		809,348,527.85	717,909,176.40
负债和所有者权益总计		810,410,205.37	718,660,830.60

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3757 元，基金份额总额 588,318,687.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		165,880,339.64	59,919,597.32
1. 利息收入		54,073.96	45,014.62
其中：存款利息收入	7.4.7.11	53,756.36	45,002.03
债券利息收入		317.60	12.59
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		61,687,010.40	-17,906,272.11
其中：股票投资收益	7.4.7.12	52,444,129.73	-26,465,138.53
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	334,960.84	8,621.15
资产支持证券投资	7.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	8,907,919.83	8,550,245.27
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	104,094,614.43	75,921,693.49
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	44,640.85	1,859,161.32
减：二、费用		5,845,706.42	4,396,313.23
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,894,567.95	2,557,725.47
2. 托管费	7.4.10.2.2	778,913.53	511,545.00
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	715,006.80	890,229.22
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		1.10	0.04
7. 其他费用	7.4.7.20	457,217.04	436,813.50
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		160,034,633.22	55,523,284.09
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		160,034,633.22	55,523,284.09

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 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）	1,374,244,594.45	-656,335,418.05	717,909,176.40

二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	160,034,633.22	160,034,633.22
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）	-103,664,628.91	35,069,347.14	-68,595,281.77
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-103,664,628.91	35,069,347.14	-68,595,281.77
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）	1,270,579,965.54	-461,231,437.69	809,348,527.85
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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）	398,069,339.39	-233,606,419.74	164,462,919.65
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,523,284.09	55,523,284.09
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）	976,175,255.06	-478,252,282.40	497,922,972.66
其中：1. 基金申购款	1,105,756,041.26	-534,050,378.87	571,705,662.39
2. 基金赎回款	-129,580,786.20	55,798,096.47	-73,782,689.73
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）	1,374,244,594.45	-656,335,418.05	717,909,176.40

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2015]485 号文《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2015 年 5 月 11 日至 2015 年 5 月 22 日向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

验证出具安永华明(2015)验字第 61090605\_A04 号验资报告后,向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2015 年 5 月 29 日正式生效,首次设立募集规模为 665,869,631.00 份基金份额。本基金为交易型开放式,存续期限不定。本基金的基金管理人为国寿安保,注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(简称“农业银行”)。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金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。本基金可根据法律法规的规定,参与转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

#### 7.4.2 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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2 号《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。

### 7.4.3 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12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和净值变动情况。

### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利

已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (3) 权证投资

买入权证于交易日确认为权证投资。权证投资成本按交易日应支付的全部价款扣除交易费用后入账；

卖出权证于交易日确认衍生工具投资收益，卖出权证的成本按移动加权平均法于交易日结转；

#### (4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资、债券投资和权证投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值；

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管

理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/(损失)占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/(累计亏损)”

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 股票投资收益/(损失)于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(4) 债券投资收益/(损失)于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息

的差额入账；

(5) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(6) 公允价值变动收益/（损失）系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；

(2) 基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；

(3) 在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率；

(4) 若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配；

(5) 基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值；

(6) 基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日；

(7) 本基金收益分配采取现金分红；

(8) 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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。

##### 7.4.6.2 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。

#### **7.4.6.3 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。

#### **7.4.6.4 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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	5,252,939.56	4,253,270.08
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	5,252,939.56	4,253,270.08

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	703,109,974.36	797,913,194.64	94,803,220.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,300.00	16,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	16,300.00	16,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-

合计		703,126,274.36	797,929,494.64	94,803,220.28
项目	上年度末 2019年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		723,501,211.33	714,209,817.18	-9,291,394.15
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	91,000.00	91,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	91,000.00	91,000.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		723,592,211.33	714,300,817.18	-9,291,394.15

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 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及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	1,187.01	928.39
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	-	-
应收债券利息	1.50	3.59
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	15.29	3.30
合计	1,203.80	935.28

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	423,318.14	176,342.53
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	423,318.14	176,342.53

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31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	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
应付指数使用费	60,484.31	51,653.42
合计	230,484.31	221,653.42

#### 7.4.7.9 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12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	636,318,687.00	1,374,244,594.45
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-48,000,000.00	-103,664,628.91
- 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	588,318,687.00	1,270,579,965.54

#### 7.4.7.10 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	-615,711,296.88	-40,624,121.17	-656,335,418.05
本期利润	55,940,018.79	104,094,614.43	160,034,633.22
本期基金份额交易产生的变动数	44,088,441.92	-9,019,094.78	35,069,347.14
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	44,088,441.92	-9,019,094.78	35,069,347.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-515,682,836.17	54,451,398.48	-461,231,437.69

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	50,333.97	38,400.92
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	3,152.52	5,613.47
其他	269.87	987.64
合计	53,756.36	45,002.03

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	47,250,133.55	-23,956,510.41
股票投资收益——赎回差价收入	5,193,996.18	-2,508,628.12
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	52,444,129.73	-26,465,138.53

## 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	249,599,934.79	244,584,889.91
减：卖出股票成本总额	202,349,801.24	268,541,400.32
买卖股票差价收入	47,250,133.55	-23,956,510.41

## 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	68,595,281.77	73,782,689.73
减：现金支付赎回款总额	36,264,157.77	38,522,559.73
减：赎回股票成本总额	27,137,127.82	37,768,758.12

赎回差价收入	5,193,996.18	-2,508,628.12
--------	--------------	---------------

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31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	334,960.84	8,621.15
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	334,960.84	8,621.15

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	1,869,689.93	49,630.50
减:卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	1,534,400.00	41,000.00
减:应收利息总额	329.09	9.35
买卖债券差价收入	334,960.84	8,621.15

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资产生的收益/损失。

##### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

##### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均无衍生工具产生的收益/损失。

##### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12 月31日
股票投资产生的股利收益	8,907,919.83	8,550,245.27

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	8,907,919.83	8,550,245.27

#### 7.4.7.17 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12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至 2019年12月31日
1. 交易性金融资产	104,094,614.43	75,921,693.49
股票投资	104,094,614.43	75,921,693.49
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	104,094,614.43	75,921,693.49

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	44,640.85	1,859,161.32
合计	44,640.85	1,859,161.32

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
交易所市场交易费用	715,006.80	890,229.22
银行间市场交易费用	-	-
合计	715,006.80	890,229.22

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月 31日
----	---------------------------------	--------------------------------------

审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	3,542.99	4,458.84
指数使用费	233,674.05	202,354.66
上市费	-	60,000.00
律师费	40,000.00	-
持有人大会公证费	10,000.00	-
合计	457,217.04	436,813.50

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保中证 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 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 7.4.10.1.3 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均未发生应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,894,567.95	2,557,725.47
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	778,913.53	511,545.00

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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无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。

##### 7.4.10.4.2 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无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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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 2020年12月31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（%）
国寿安保中证500ETF联接基金	585,486,286.00	99.52	633,486,286.00	99.55

##### 7.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31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	5,252,939.56	50,333.97	4,253,270.08	38,400.92

##### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

##### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

### 7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

### 7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

#### 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
003030	祖名股份	2020年12月25日	2021年1月6日	新股发行未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷电子	2020年12月24日	2021年1月4日	新股发行未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300894	火星人	2020年12月24日	2021年6月30日	新股流通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	-
300900	广联航空	2020年10月19日	2021年4月29日	新股流通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	-
300901	中胤时尚	2020年10月19日	2021年4月29日	新股流通受限	8.96	15.00	9,611	86,114.56	144,165.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股发行未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年07月07日	新股流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股发行未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年07月07日	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股发行未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股发行未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128142	新乳转债	2020年12月18日	2021年01月19日	新债发行未上市	100.00	100.00	163	16,300.00	16,300.00	-

#### 7.4.12.2 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
------	------	------	------	--------	------	--------	-----------	--------	--------	----

300182	捷成股份	2020 年 12 月 30 日	重大事项停牌	3.23	2021 年 01 月 07 日	3.40	306,300	1,665,942.38	989,349.00	-
--------	------	------------------	--------	------	------------------	------	---------	--------------	------------	---

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

#### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

#### 7.4.13.3.2 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7.4.12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约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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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、结算备付金及存出保证金等。本基金于本报告期末持有债券投资占基金份额比例较低，因此基金净值受利率变动的影响较小。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	5,252,939.56	-	-	-	5,252,939.56
存出保证金	30,926.98	-	-	-	30,926.98
交易性金融资产	-	-	16,300.00	797,913,194.64	797,929,494.64
应收利息	-	-	-	1,203.80	1,203.80
应收证券清算款	-	-	-	7,195,640.39	7,195,640.39
资产总计	5,283,866.54	-	16,300.00	805,110,038.83	810,410,205.37
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	339,894.74	339,894.74
应付托管费	-	-	-	67,978.95	67,978.95
应付交易费用	-	-	-	423,318.14	423,318.14
应交税费	-	-	-	1.38	1.38
其他负债	-	-	-	230,484.31	230,484.31
负债总计	-	-	-	1,061,677.52	1,061,677.52
利率敏感度缺口	5,283,866.54	-	16,300.00	804,048,361.31	809,348,527.85
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	4,253,270.08	-	-	-	4,253,270.08
存出保证金	6,567.74	-	-	-	6,567.74
交易性金融资产	91,000.00	-	-	714,209,817.18	714,300,817.18
应收证券清算款	-	-	-	99,240.32	99,240.32
应收利息	-	-	-	935.28	935.28
资产总计	4,350,837.82	-	-	714,309,992.78	718,660,830.60
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	294,715.01	294,715.01
应付托管费	-	-	-	58,942.99	58,942.99
应付交易费用	-	-	-	176,342.53	176,342.53
应交税费	-	-	-	0.25	0.25
其他负债	-	-	-	221,653.42	221,653.42
负债总计	-	-	-	751,654.20	751,654.20
利率敏感度缺口	4,350,837.82	-	-	713,558,338.58	717,909,176.40

#### 7.4.13.4.1.2 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和债券投资等，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于本资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产不低于基金资产净值的90%，权证及其他金融工具的投资比例按照法律法规或监管机构的规定执行。于2020年12月31日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31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	797,913,194.64	98.59	714,209,817.18	99.48
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	16,300.00	0.00	91,000.00	0.01
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	797,929,494.64	98.59	714,300,817.18	99.50

##### 7.4.13.4.3.2 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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	+5%	40,201,924.80	35,704,941.36
	-5%	-40,201,924.80	-35,704,941.36

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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

于2020年12月31日，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工具中属于第一层次的余额为人民币796,513,428.31元（上年度末：714,209,817.18元），属于第二层次的余额为人民币1,416,066.33元（上年度末：91,000.00元），本报告期末及上年度末均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。

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工具公允价值所属层次本期变动情况如下：

转出第一层次 人民币989,349.00元

转入第二层次 人民币989,349.00元

#### 7.4.14.2 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。

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于2021年3月30日经本基金的基金管理人批准。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	797,913,194.64	98.46
	其中：股票	797,913,194.64	98.46
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,300.00	0.00

	其中：债券	16,300.00	0.00
	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	5,252,939.56	0.65
8	其他各项资产	7,227,771.17	0.89
9	合计	810,410,205.37	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	8,907,384.00	1.10
B	采矿业	25,257,517.64	3.12
C	制造业	510,240,000.59	63.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,759,191.00	2.32
E	建筑业	11,362,112.97	1.40
F	批发和零售业	30,366,776.09	3.75
G	交通运输、仓储和邮政业	16,144,545.84	1.99
H	住宿和餐饮业	3,995,037.40	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	60,283,490.70	7.45
J	金融业	47,565,493.54	5.88
K	房地产业	24,383,907.00	3.01
L	租赁和商务服务业	8,329,522.20	1.03
M	科学研究和技术服务业	6,989,563.00	0.86
N	水利、环境和公共设施管理业	7,154,105.47	0.88
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	736,454.40	0.09
Q	卫生和社会工作	6,636,298.40	0.82
R	文化、体育和娱乐业	6,780,440.00	0.84
S	综合	4,021,354.40	0.50
	合计	797,913,194.64	98.59

### 8.2.1 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。

## 8.3 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300274	阳光电源	152,420	11,016,917.60	1.36
2	600426	华鲁恒升	169,375	6,317,687.50	0.78
3	300012	华测检测	215,500	5,898,235.00	0.73
4	300496	中科创达	44,200	5,171,400.00	0.64
5	002074	国轩高科	130,500	5,105,160.00	0.63

6	000547	航天发展	184,900	5,084,750.00	0.63
7	600079	人福医药	147,920	5,011,529.60	0.62
8	300207	欣旺达	162,800	4,999,588.00	0.62
9	300285	国瓷材料	110,800	4,998,188.00	0.62
10	600739	辽宁成大	200,500	4,876,160.00	0.60
11	600143	金发科技	268,700	4,605,518.00	0.57
12	002709	天赐材料	43,620	4,527,756.00	0.56
13	002185	华天科技	330,500	4,501,410.00	0.56
14	603882	金域医学	35,000	4,484,200.00	0.55
15	600089	特变电工	439,400	4,459,910.00	0.55
16	600132	重庆啤酒	36,500	4,343,135.00	0.54
17	601099	太平洋	1,014,000	4,137,120.00	0.51
18	601799	星宇股份	20,500	4,110,250.00	0.51
19	002385	大北农	422,200	4,078,452.00	0.50
20	002340	格林美	580,178	4,055,444.22	0.50
21	600885	宏发股份	70,740	3,835,522.80	0.47
22	601233	桐昆股份	185,400	3,817,386.00	0.47
23	002797	第一创业	378,300	3,764,085.00	0.47
24	300595	欧普康视	45,300	3,710,976.00	0.46
25	600486	扬农化工	27,820	3,672,240.00	0.45
26	600316	洪都航空	64,400	3,662,428.00	0.45
27	600529	山东药玻	72,600	3,640,890.00	0.45
28	300357	我武生物	46,900	3,597,230.00	0.44
29	000636	风华高科	106,400	3,585,680.00	0.44
30	601168	西部矿业	283,666	3,511,785.08	0.43
31	600201	生物股份	167,414	3,497,278.46	0.43
32	002507	涪陵榨菜	82,300	3,481,290.00	0.43
33	002078	太阳纸业	231,700	3,343,431.00	0.41
34	000750	国海证券	567,220	3,323,909.20	0.41
35	002568	百润股份	31,500	3,285,135.00	0.41
36	603806	福斯特	37,430	3,196,522.00	0.39
37	002013	中航机电	276,300	3,163,635.00	0.39
38	002030	达安基因	91,740	3,146,682.00	0.39
39	600884	杉杉股份	171,110	3,085,113.30	0.38
40	300088	长信科技	342,000	3,040,380.00	0.38
41	601128	常熟银行	408,100	3,011,778.00	0.37
42	002465	海格通信	275,100	2,979,333.00	0.37
43	002500	山西证券	330,190	2,955,200.50	0.37
44	603338	浙江鼎力	29,060	2,940,581.40	0.36
45	600699	均胜电子	115,560	2,930,601.60	0.36
46	600460	士兰微	117,200	2,930,000.00	0.36
47	601966	玲珑轮胎	83,200	2,926,144.00	0.36

48	300316	晶盛机电	96,200	2,893,696.00	0.36
49	000009	中国宝安	384,280	2,893,628.40	0.36
50	002075	沙钢股份	262,800	2,882,916.00	0.36
51	002353	杰瑞股份	81,900	2,866,500.00	0.35
52	000630	铜陵有色	1,109,100	2,850,387.00	0.35
53	002131	利欧股份	931,709	2,823,078.27	0.35
54	002625	光启技术	125,500	2,792,375.00	0.35
55	300482	万孚生物	31,300	2,792,273.00	0.35
56	000988	华工科技	120,000	2,782,800.00	0.34
57	300168	万达信息	125,912	2,731,031.28	0.34
58	600862	中航高科	90,300	2,718,030.00	0.34
59	300699	光威复材	30,500	2,716,025.00	0.34
60	000998	隆平高科	136,800	2,710,008.00	0.33
61	603589	口子窖	39,300	2,707,770.00	0.33
62	600219	南山铝业	848,600	2,681,576.00	0.33
63	603345	安井食品	13,700	2,642,319.00	0.33
64	002250	联化科技	109,800	2,634,102.00	0.33
65	300001	特锐德	89,600	2,630,656.00	0.33
66	002156	通富微电	102,300	2,582,052.00	0.32
67	688002	睿创微纳	23,100	2,564,100.00	0.32
68	002223	鱼跃医疗	90,050	2,540,310.50	0.31
69	002080	中材科技	104,800	2,534,064.00	0.31
70	002212	天融信	119,400	2,508,594.00	0.31
71	002444	巨星科技	79,900	2,485,689.00	0.31
72	603486	科沃斯	28,000	2,477,720.00	0.31
73	002572	索菲亚	95,600	2,476,040.00	0.31
74	002557	洽洽食品	45,500	2,450,175.00	0.30
75	600754	锦江酒店	47,500	2,447,675.00	0.30
76	600733	北汽蓝谷	281,600	2,441,472.00	0.30
77	601689	拓普集团	63,370	2,435,309.10	0.30
78	002926	华西证券	195,100	2,434,848.00	0.30
79	600779	水井坊	29,200	2,424,184.00	0.30
80	600879	航天电子	324,000	2,423,520.00	0.30
81	601997	贵阳银行	304,800	2,423,160.00	0.30
82	600418	江淮汽车	197,000	2,409,310.00	0.30
83	002138	顺络电子	97,900	2,400,508.00	0.30
84	000039	中集集团	159,722	2,394,232.78	0.30
85	600511	国药股份	48,300	2,381,673.00	0.29
86	300271	华宇软件	98,700	2,355,969.00	0.29
87	300418	昆仑万维	117,600	2,346,120.00	0.29
88	300024	机器人	188,900	2,323,470.00	0.29
89	600909	华安证券	289,400	2,315,200.00	0.29

90	300070	碧水源	302,500	2,314,125.00	0.29
91	000623	吉林敖东	138,500	2,281,095.00	0.28
92	002670	国盛金控	165,836	2,280,245.00	0.28
93	300618	寒锐钴业	23,800	2,258,858.00	0.28
94	300146	汤臣倍健	93,500	2,258,025.00	0.28
95	600415	小商品城	409,300	2,255,243.00	0.28
96	600867	通化东宝	168,500	2,254,530.00	0.28
97	603816	顾家家居	31,760	2,239,397.60	0.28
98	000513	丽珠集团	55,253	2,237,746.50	0.28
99	002683	宏大爆破	62,000	2,228,900.00	0.28
100	000021	深科技	117,100	2,226,071.00	0.28
101	000050	深天马 A	150,600	2,219,844.00	0.27
102	002603	以岭药业	85,400	2,177,700.00	0.27
103	002791	坚朗五金	15,100	2,174,400.00	0.27
104	603444	吉比特	5,100	2,172,600.00	0.27
105	600038	中直股份	34,569	2,167,821.99	0.27
106	600563	法拉电子	20,100	2,161,755.00	0.27
107	002373	千方科技	113,000	2,160,560.00	0.27
108	600380	健康元	155,196	2,158,776.36	0.27
109	600166	福田汽车	684,500	2,156,175.00	0.27
110	600155	华创阳安	163,200	2,152,608.00	0.27
111	300244	迪安诊断	62,780	2,152,098.40	0.27
112	300463	迈克生物	45,900	2,138,940.00	0.26
113	600549	厦门钨业	126,300	2,128,155.00	0.26
114	000878	云南铜业	146,000	2,112,620.00	0.26
115	600153	建发股份	256,700	2,107,507.00	0.26
116	300315	掌趣科技	410,700	2,098,677.00	0.26
117	002019	亿帆医药	110,200	2,086,086.00	0.26
118	600801	华新水泥	100,872	2,080,989.36	0.26
119	002273	水晶光电	178,629	2,070,310.11	0.26
120	002511	中顺洁柔	99,200	2,070,304.00	0.26
121	600765	中航重机	82,800	2,070,000.00	0.26
122	000739	普洛药业	88,900	2,069,592.00	0.26
123	300115	长盈精密	83,880	2,067,642.00	0.26
124	000686	东北证券	209,400	2,056,308.00	0.25
125	000975	银泰黄金	237,972	2,048,938.92	0.25
126	002920	德赛西威	24,300	2,044,602.00	0.25
127	002081	金螳螂	216,600	2,033,874.00	0.25
128	600598	北大荒	105,500	2,030,875.00	0.25
129	300017	网宿科技	294,000	2,025,660.00	0.25
130	600535	天士力	136,500	2,018,835.00	0.25
131	300009	安科生物	137,010	2,011,306.80	0.25

132	002064	华峰化学	199,300	2,010,937.00	0.25
133	000401	冀东水泥	140,400	1,986,660.00	0.25
134	002648	卫星石化	75,600	1,974,672.00	0.24
135	600895	张江高科	115,300	1,964,712.00	0.24
136	603866	桃李面包	33,220	1,963,302.00	0.24
137	600497	驰宏锌锗	408,900	1,962,720.00	0.24
138	603858	步长制药	85,000	1,960,950.00	0.24
139	000830	鲁西化工	153,300	1,959,174.00	0.24
140	000738	航发控制	85,400	1,958,222.00	0.24
141	002506	协鑫集成	458,600	1,949,050.00	0.24
142	002299	圣农发展	73,300	1,945,382.00	0.24
143	000581	威孚高科	83,000	1,924,770.00	0.24
144	603737	三棵树	12,700	1,924,050.00	0.24
145	002152	广电运通	179,700	1,919,196.00	0.24
146	600516	方大炭素	270,200	1,910,314.00	0.24
147	600642	申能股份	365,000	1,905,300.00	0.24
148	600667	太极实业	201,600	1,905,120.00	0.24
149	600409	三友化工	185,100	1,897,275.00	0.23
150	000690	宝新能源	259,200	1,892,160.00	0.23
151	600859	王府井	57,975	1,888,825.50	0.23
152	300223	北京君正	20,400	1,866,396.00	0.23
153	002056	横店东磁	122,700	1,863,813.00	0.23
154	002124	天邦股份	127,400	1,860,040.00	0.23
155	002195	二三四五	813,585	1,838,702.10	0.23
156	002690	美亚光电	41,200	1,824,336.00	0.23
157	002028	思源电气	90,820	1,821,849.20	0.23
158	600580	卧龙电驱	116,400	1,815,840.00	0.22
159	002294	信立泰	63,600	1,801,788.00	0.22
160	000729	燕京啤酒	210,300	1,791,756.00	0.22
161	000060	中金岭南	371,700	1,791,594.00	0.22
162	300212	易华录	58,440	1,791,186.00	0.22
163	600372	中航电子	91,100	1,790,115.00	0.22
164	002281	光迅科技	61,400	1,783,056.00	0.22
165	300058	蓝色光标	296,900	1,781,400.00	0.22
166	600827	百联股份	121,000	1,766,600.00	0.22
167	002372	伟星新材	94,100	1,759,670.00	0.22
168	000807	云铝股份	233,000	1,754,490.00	0.22
169	601866	中远海发	590,600	1,754,082.00	0.22
170	002595	豪迈科技	59,000	1,749,350.00	0.22
171	002221	东华能源	171,800	1,742,052.00	0.22
172	600315	上海家化	50,000	1,736,500.00	0.21
173	600008	首创股份	606,120	1,715,319.60	0.21

174	000983	山西焦煤	304,120	1,715,236.80	0.21
175	600256	广汇能源	605,000	1,712,150.00	0.21
176	601717	郑煤机	155,900	1,703,987.00	0.21
177	002429	兆驰股份	273,100	1,693,220.00	0.21
178	300296	利亚德	265,300	1,687,308.00	0.21
179	000960	锡业股份	149,300	1,672,160.00	0.21
180	000997	新大陆	109,219	1,668,866.32	0.21
181	600528	中铁工业	190,147	1,661,884.78	0.21
182	600392	盛和资源	186,195	1,655,273.55	0.20
183	688099	晶晨股份	21,000	1,653,330.00	0.20
184	600704	物产中大	376,700	1,646,179.00	0.20
185	600875	东方电气	164,600	1,641,062.00	0.20
186	600160	巨化股份	201,820	1,636,760.20	0.20
187	002831	裕同科技	53,320	1,632,658.40	0.20
188	600811	东方集团	442,430	1,614,869.50	0.20
189	603883	老百姓	25,423	1,597,327.09	0.20
190	600839	四川长虹	549,700	1,594,130.00	0.20
191	002705	新宝股份	37,700	1,592,825.00	0.20
192	000301	东方盛虹	167,400	1,586,952.00	0.20
193	600170	上海建工	526,700	1,585,367.00	0.20
194	601615	明阳智能	83,000	1,575,340.00	0.19
195	600515	*ST 基础	233,000	1,572,750.00	0.19
196	002092	中泰化学	255,202	1,569,492.30	0.19
197	600728	佳都科技	206,700	1,568,853.00	0.19
198	000540	中天金融	497,600	1,567,440.00	0.19
199	600325	华发股份	251,770	1,563,491.70	0.19
200	002382	蓝帆医疗	73,900	1,558,551.00	0.19
201	002390	信邦制药	183,400	1,555,232.00	0.19
202	600258	首旅酒店	72,920	1,547,362.40	0.19
203	600737	中粮糖业	159,500	1,543,960.00	0.19
204	600967	内蒙一机	126,497	1,538,203.52	0.19
205	000012	南玻 A	207,075	1,528,213.50	0.19
206	600820	隧道股份	280,300	1,516,423.00	0.19
207	600881	亚泰集团	483,200	1,497,920.00	0.19
208	002396	星网锐捷	64,800	1,494,288.00	0.18
209	300002	神州泰岳	291,900	1,491,609.00	0.18
210	600597	光明乳业	91,502	1,487,822.52	0.18
211	300630	普利制药	35,253	1,476,748.17	0.18
212	688029	南微医学	8,000	1,472,080.00	0.18
213	688088	虹软科技	21,000	1,468,320.00	0.18
214	603712	七一二	35,200	1,466,080.00	0.18
215	000999	华润三九	58,700	1,463,978.00	0.18

216	002268	卫 士 通	87,600	1,462,920.00	0.18
217	601456	国联证券	68,500	1,461,105.00	0.18
218	600446	金证股份	90,100	1,460,521.00	0.18
219	603605	珀莱雅	8,200	1,459,600.00	0.18
220	002242	九阳股份	45,226	1,449,041.04	0.18
221	600167	联美控股	127,480	1,446,898.00	0.18
222	600410	华胜天成	163,120	1,445,243.20	0.18
223	600567	山鹰国际	477,700	1,442,654.00	0.18
224	603638	艾迪精密	20,900	1,440,846.00	0.18
225	600804	鹏博士	213,700	1,436,064.00	0.18
226	002368	太极股份	54,858	1,432,342.38	0.18
227	000877	天山股份	94,000	1,419,400.00	0.18
228	600260	凯乐科技	129,786	1,414,667.40	0.17
229	600039	四川路桥	312,262	1,408,301.62	0.17
230	000629	攀钢钒钛	647,000	1,403,990.00	0.17
231	601179	中国西电	304,400	1,403,284.00	0.17
232	600435	北方导航	155,800	1,402,200.00	0.17
233	002387	维信诺	122,700	1,398,780.00	0.17
234	002966	苏州银行	182,100	1,398,528.00	0.17
235	000930	中粮科技	165,800	1,396,036.00	0.17
236	603000	人民网	82,400	1,392,560.00	0.17
237	002807	江阴银行	323,660	1,385,264.80	0.17
238	001914	招商积余	64,300	1,384,379.00	0.17
239	300166	东方国信	126,378	1,383,839.10	0.17
240	600273	嘉化能源	149,500	1,381,380.00	0.17
241	600026	中远海能	206,159	1,377,142.12	0.17
242	600216	浙江医药	101,200	1,376,320.00	0.17
243	000778	新兴铸管	370,500	1,363,440.00	0.17
244	002085	万丰奥威	206,500	1,354,640.00	0.17
245	600718	东软集团	130,100	1,354,341.00	0.17
246	002233	塔牌集团	106,120	1,351,968.80	0.17
247	600060	海信视像	117,100	1,344,308.00	0.17
248	300474	景嘉微	19,100	1,335,281.00	0.16
249	600037	歌华有线	145,100	1,334,920.00	0.16
250	600064	南京高科	129,720	1,332,224.40	0.16
251	603290	斯达半导	5,500	1,324,950.00	0.16
252	002004	华邦健康	235,950	1,307,163.00	0.16
253	600572	康恩贝	277,454	1,306,808.34	0.16
254	002925	盈趣科技	20,300	1,305,899.00	0.16
255	000400	许继电气	90,300	1,305,738.00	0.16
256	600282	南钢股份	417,600	1,302,912.00	0.16
257	000027	深圳能源	213,020	1,297,291.80	0.16

258	601005	重庆钢铁	873,000	1,292,040.00	0.16
259	600755	厦门国贸	193,100	1,289,908.00	0.16
260	000932	华菱钢铁	268,780	1,284,768.40	0.16
261	600021	上海电力	180,400	1,284,448.00	0.16
262	000598	兴蓉环境	267,100	1,282,080.00	0.16
263	300026	红日药业	279,000	1,277,820.00	0.16
264	000887	中鼎股份	109,000	1,276,390.00	0.16
265	603198	迎驾贡酒	36,300	1,266,870.00	0.16
266	002174	游族网络	95,500	1,256,780.00	0.16
267	000089	深圳机场	153,300	1,252,461.00	0.15
268	002936	郑州银行	278,460	1,241,931.60	0.15
269	600158	中体产业	101,200	1,240,712.00	0.15
270	000488	晨鸣纸业	192,750	1,237,455.00	0.15
271	002110	三钢闽光	183,150	1,232,599.50	0.15
272	601118	海南橡胶	254,700	1,227,654.00	0.15
273	600908	无锡银行	201,800	1,226,944.00	0.15
274	000825	太钢不锈	338,800	1,223,068.00	0.15
275	601106	中国一重	408,400	1,221,116.00	0.15
276	600022	山东钢铁	852,170	1,218,603.10	0.15
277	600959	江苏有线	368,000	1,218,080.00	0.15
278	002745	木林森	83,300	1,215,347.00	0.15
279	000970	中科三环	127,600	1,205,820.00	0.15
280	002191	劲嘉股份	130,300	1,202,669.00	0.15
281	603927	中科软	29,800	1,194,682.00	0.15
282	002563	森马服饰	119,000	1,192,380.00	0.15
283	600171	上海贝岭	84,000	1,177,680.00	0.15
284	601975	招商南油	464,200	1,165,142.00	0.14
285	600195	中牧股份	90,600	1,160,586.00	0.14
286	601699	潞安环能	178,500	1,160,250.00	0.14
287	603228	景旺电子	38,468	1,159,810.20	0.14
288	000090	天健集团	194,271	1,153,969.74	0.14
289	000402	金融街	178,400	1,150,680.00	0.14
290	002048	宁波华翔	73,900	1,150,623.00	0.14
291	000967	盈峰环境	141,200	1,149,368.00	0.14
292	300072	三聚环保	201,500	1,144,520.00	0.14
293	002217	合力泰	277,800	1,138,980.00	0.14
294	600056	中国医药	79,300	1,136,369.00	0.14
295	000528	柳工	154,299	1,135,640.64	0.14
296	601992	金隅集团	380,000	1,128,600.00	0.14
297	600673	东阳光	224,200	1,127,726.00	0.14
298	000883	湖北能源	290,600	1,127,528.00	0.14
299	600006	东风汽车	119,400	1,127,136.00	0.14

300	600376	首开股份	191,500	1,124,105.00	0.14
301	601333	广深铁路	505,200	1,121,544.00	0.14
302	603077	和邦生物	788,760	1,120,039.20	0.14
303	000563	陕国投 A	295,500	1,114,035.00	0.14
304	002701	奥瑞金	225,280	1,112,883.20	0.14
305	600507	方大特钢	159,796	1,108,984.24	0.14
306	000898	鞍钢股份	361,700	1,099,568.00	0.14
307	300376	易事特	137,800	1,096,888.00	0.14
308	600808	马钢股份	412,036	1,096,015.76	0.14
309	601000	唐山港	441,346	1,094,538.08	0.14
310	300133	华策影视	176,900	1,093,242.00	0.14
311	600782	新钢股份	237,700	1,091,043.00	0.13
312	000685	中山公用	131,400	1,090,620.00	0.13
313	000559	万向钱潮	201,900	1,080,165.00	0.13
314	600500	中化国际	204,920	1,079,928.40	0.13
315	002266	浙富控股	239,280	1,076,760.00	0.13
316	002317	众生药业	97,700	1,076,654.00	0.13
317	000709	河钢股份	480,300	1,075,872.00	0.13
318	600970	中材国际	156,000	1,073,280.00	0.13
319	300113	顺网科技	62,500	1,071,875.00	0.13
320	002155	湖南黄金	125,804	1,070,592.04	0.13
321	002839	张家港行	175,300	1,069,330.00	0.13
322	002985	北摩高科	5,500	1,063,150.00	0.13
323	600120	浙江东方	177,252	1,058,194.44	0.13
324	002128	露天煤业	96,240	1,052,865.60	0.13
325	600388	龙净环保	118,400	1,051,392.00	0.13
326	000758	中色股份	205,200	1,042,416.00	0.13
327	600466	蓝光发展	224,720	1,040,453.60	0.13
328	601598	中国外运	235,000	1,034,000.00	0.13
329	000519	中兵红箭	103,062	1,032,681.24	0.13
330	600643	爱建集团	136,350	1,025,352.00	0.13
331	600373	中文传媒	101,600	1,025,144.00	0.13
332	600266	城建发展	201,458	1,023,406.64	0.13
333	601608	中信重工	258,300	1,022,868.00	0.13
334	600649	城投控股	188,200	1,021,926.00	0.13
335	601098	中南传媒	106,800	1,017,804.00	0.13
336	600073	上海梅林	98,475	1,013,307.75	0.13
337	000028	国药一致	22,100	1,012,180.00	0.13
338	002244	滨江集团	220,400	1,011,636.00	0.12
339	600348	华阳股份	179,400	1,006,434.00	0.12
340	300010	豆神教育	103,100	1,006,256.00	0.12
341	600729	重庆百货	34,800	1,005,720.00	0.12

342	603317	天味食品	12,220	1,004,972.80	0.12
343	603885	吉祥航空	88,100	1,001,697.00	0.12
344	600126	杭钢股份	188,930	999,439.70	0.12
345	002458	益生股份	89,100	993,465.00	0.12
346	601718	际华集团	327,200	991,416.00	0.12
347	300182	捷成股份	306,300	989,349.00	0.12
348	000078	海王生物	245,700	985,257.00	0.12
349	600398	海澜之家	153,100	982,902.00	0.12
350	601865	福莱特	24,500	977,550.00	0.12
351	002505	鹏都农牧	386,270	977,263.10	0.12
352	600188	兖州煤业	96,600	972,762.00	0.12
353	002867	周大生	36,500	972,725.00	0.12
354	002203	海亮股份	131,500	971,785.00	0.12
355	603568	伟明环保	51,279	970,711.47	0.12
356	002183	怡亚通	220,900	963,124.00	0.12
357	002399	海普瑞	55,800	960,876.00	0.12
358	600094	大名城	237,500	954,750.00	0.12
359	002440	闰土股份	102,400	954,368.00	0.12
360	002249	大洋电机	211,500	951,750.00	0.12
361	600633	浙数文化	116,500	948,310.00	0.12
362	600645	中源协和	48,300	947,163.00	0.12
363	600863	内蒙华电	365,800	940,106.00	0.12
364	601860	紫金银行	223,300	940,093.00	0.12
365	002408	齐翔腾达	111,481	931,981.16	0.12
366	002038	双鹭药业	92,100	930,210.00	0.11
367	600835	上海机电	47,800	930,188.00	0.11
368	600062	华润双鹤	77,532	929,608.68	0.11
369	600675	中华企业	276,200	928,032.00	0.11
370	002010	传化智联	196,000	923,160.00	0.11
371	600566	济川药业	45,600	922,488.00	0.11
372	601016	节能风电	264,500	907,235.00	0.11
373	000959	首钢股份	236,400	905,412.00	0.11
374	601958	金钼股份	144,200	895,482.00	0.11
375	000415	渤海租赁	372,100	893,040.00	0.11
376	601880	辽港股份	460,440	888,649.20	0.11
377	000158	常山北明	142,570	883,934.00	0.11
378	600928	西安银行	157,900	877,924.00	0.11
379	300180	华峰超纤	148,000	874,680.00	0.11
380	601200	上海环境	80,170	873,853.00	0.11
381	600312	平高电气	121,700	868,938.00	0.11
382	000869	张裕A	19,900	867,640.00	0.11
383	000564	*ST大集	334,600	866,614.00	0.11

384	600141	兴发集团	78,380	864,531.40	0.11
385	601611	中国核建	118,300	861,224.00	0.11
386	600717	天津港	179,948	860,151.44	0.11
387	002544	杰赛科技	51,200	859,136.00	0.11
388	002589	瑞康医药	162,790	851,391.70	0.11
389	002434	万里扬	95,400	850,968.00	0.11
390	600776	东方通信	71,300	844,905.00	0.10
391	002583	海能达	136,500	838,110.00	0.10
392	600823	世茂股份	180,100	830,261.00	0.10
393	002635	安洁科技	47,983	826,747.09	0.10
394	000031	大悦城	186,800	821,920.00	0.10
395	600901	江苏租赁	149,100	821,541.00	0.10
396	002640	跨境通	159,000	817,260.00	0.10
397	601228	广州港	242,500	814,800.00	0.10
398	000501	鄂武商 A	69,170	805,830.50	0.10
399	300459	金科文化	250,507	799,117.33	0.10
400	600546	山煤国际	93,500	795,685.00	0.10
401	002375	亚厦股份	105,000	781,200.00	0.10
402	000681	视觉中国	60,091	781,183.00	0.10
403	688321	微芯生物	21,000	777,210.00	0.10
404	600648	外高桥	55,600	776,732.00	0.10
405	000718	苏宁环球	225,900	774,837.00	0.10
406	000717	韶钢松山	180,600	771,162.00	0.10
407	000046	泛海控股	234,700	769,816.00	0.10
408	600307	酒钢宏兴	466,300	769,395.00	0.10
409	600259	广晟有色	25,500	769,335.00	0.10
410	000826	启迪环境	113,800	769,288.00	0.10
411	600339	中油工程	248,900	766,612.00	0.09
412	600329	中新药业	43,500	762,120.00	0.09
413	002815	崇达技术	52,500	758,100.00	0.09
414	600582	天地科技	245,700	756,756.00	0.09
415	300324	旋极信息	176,576	746,916.48	0.09
416	002424	贵州百灵	94,300	738,369.00	0.09
417	603377	东方时尚	38,040	736,454.40	0.09
418	000008	神州高铁	289,900	736,346.00	0.09
419	002002	鸿达兴业	245,208	735,624.00	0.09
420	603650	彤程新材	23,700	734,700.00	0.09
421	000156	华数传媒	85,500	731,880.00	0.09
422	600985	淮北矿业	65,300	730,707.00	0.09
423	000990	诚志股份	61,500	729,390.00	0.09
424	002468	申通快递	72,300	728,784.00	0.09
425	601928	凤凰传媒	113,600	719,088.00	0.09

426	000061	农产品	101,800	717,690.00	0.09
427	600664	哈药股份	223,726	713,685.94	0.09
428	601778	晶科科技	98,300	713,658.00	0.09
429	600707	彩虹股份	106,700	710,622.00	0.09
430	000543	皖能电力	168,370	703,786.60	0.09
431	300257	开山股份	50,900	694,785.00	0.09
432	603515	欧普照明	22,420	677,308.20	0.08
433	601127	小康股份	39,500	674,660.00	0.08
434	600748	上实发展	137,220	673,750.20	0.08
435	002948	青岛银行	113,200	671,276.00	0.08
436	000937	冀中能源	158,700	660,192.00	0.08
437	600869	远东股份	164,800	657,552.00	0.08
438	002416	爱施德	87,980	656,330.80	0.08
439	002302	西部建设	74,600	654,988.00	0.08
440	600639	浦东金桥	50,600	627,440.00	0.08
441	601139	深圳燃气	85,700	620,468.00	0.08
442	600277	亿利洁能	204,000	609,960.00	0.08
443	600131	国网信通	42,500	604,775.00	0.07
444	600787	中储股份	130,400	601,144.00	0.07
445	000600	建投能源	106,500	597,465.00	0.07
446	603888	新华网	31,250	593,750.00	0.07
447	002503	搜于特	264,460	592,390.40	0.07
448	300134	大富科技	57,336	592,280.88	0.07
449	000813	德展健康	133,000	589,190.00	0.07
450	600350	山东高速	95,100	587,718.00	0.07
451	600338	西藏珠峰	55,740	584,155.20	0.07
452	600640	号百控股	47,100	576,975.00	0.07
453	000062	深圳华强	46,310	576,096.40	0.07
454	600968	海油发展	240,400	574,556.00	0.07
455	600545	卓郎智能	162,100	567,350.00	0.07
456	603260	合盛硅业	16,800	561,792.00	0.07
457	600291	西水股份	98,300	557,361.00	0.07
458	603056	德邦股份	43,800	555,822.00	0.07
459	002419	天虹股份	72,500	553,900.00	0.07
460	002093	国脉科技	74,500	543,105.00	0.07
461	600575	淮河能源	231,300	536,616.00	0.07
462	601298	青岛港	82,900	533,047.00	0.07
463	000553	安道麦 A	67,400	527,068.00	0.07
464	000537	广宇发展	83,300	522,291.00	0.06
465	600657	信达地产	128,300	519,615.00	0.06
466	002051	中工国际	73,229	519,193.61	0.06
467	600556	天下秀	39,300	497,145.00	0.06

468	000732	泰禾集团	148,498	485,588.46	0.06
469	600623	华谊集团	83,200	482,560.00	0.06
470	603328	依顿电子	59,900	476,205.00	0.06
471	600517	国网英大	74,300	451,744.00	0.06
472	601828	美凯龙	52,400	444,876.00	0.05
473	600871	石化油服	225,000	441,000.00	0.05
474	600903	贵州燃气	34,540	438,658.00	0.05
475	601869	长飞光纤	16,000	432,640.00	0.05
476	603225	新凤鸣	30,840	428,676.00	0.05
477	601801	皖新传媒	89,000	422,750.00	0.05
478	002653	海思科	23,900	418,728.00	0.05
479	002901	大博医疗	5,400	398,142.00	0.05
480	603893	瑞芯微	5,500	397,925.00	0.05
481	601003	柳钢股份	75,900	393,921.00	0.05
482	603786	科博达	5,700	385,434.00	0.05
483	600053	九鼎投资	19,200	375,360.00	0.05
484	002818	富森美	24,840	350,989.20	0.04
485	601969	海南矿业	58,600	350,428.00	0.04
486	002946	新乳业	19,400	341,634.00	0.04
487	603355	莱克电气	11,200	338,576.00	0.04
488	603379	三美股份	17,140	327,374.00	0.04
489	603719	良品铺子	5,200	305,084.00	0.04
490	603983	丸美股份	5,700	297,597.00	0.04
491	603868	飞科电器	5,900	276,002.00	0.03
492	002941	新疆交建	24,300	267,300.00	0.03
493	002423	中粮资本	27,400	265,232.00	0.03
494	601512	中新集团	24,900	247,506.00	0.03
495	001872	招商港口	14,900	237,208.00	0.03
496	600917	重庆燃气	27,900	191,394.00	0.02
497	601068	中铝国际	45,500	161,980.00	0.02
498	603256	宏和科技	17,700	156,291.00	0.02
499	002957	科瑞技术	7,100	145,195.00	0.02
500	300901	中胤时尚	9,611	144,165.00	0.02
501	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.02
502	603708	家家悦	4,000	85,200.00	0.01
503	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
504	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
505	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
506	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
507	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
508	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
509	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00

510	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
511	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
512	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
513	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
514	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 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	002185	华天科技	5,123,778.00	0.71
2	300558	贝达药业	4,071,246.00	0.57
3	600529	山东药玻	4,009,590.00	0.56
4	600089	特变电工	3,462,872.95	0.48
5	300357	我武生物	3,401,414.00	0.47
6	300482	万孚生物	3,269,328.00	0.46
7	300496	中科创达	3,213,555.02	0.45
8	300595	欧普康视	3,207,474.50	0.45
9	300271	华宇软件	3,050,325.09	0.42
10	300017	网宿科技	3,001,378.11	0.42
11	002557	洽洽食品	2,939,186.00	0.41
12	002156	通富微电	2,904,933.21	0.40
13	002568	百润股份	2,896,513.00	0.40
14	300024	机器人	2,881,612.00	0.40
15	300070	碧水源	2,766,860.00	0.39
16	600667	太极实业	2,699,566.00	0.38
17	300212	易华录	2,694,773.00	0.38
18	002138	顺络电子	2,677,484.00	0.37
19	600153	建发股份	2,649,985.00	0.37
20	603345	安井食品	2,633,772.00	0.37

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。

##### 8.4.2 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	600745	闻泰科技	7,566,481.00	1.05
2	300014	亿纬锂能	6,525,669.66	0.91
3	002821	凯莱英	6,293,515.00	0.88
4	002371	北方华创	6,149,659.90	0.86
5	002129	中环股份	5,373,109.00	0.75
6	002384	东山精密	5,184,301.00	0.72

7	600584	长电科技	5,139,994.00	0.72
8	002463	沪电股份	4,705,964.00	0.66
9	600763	通策医疗	4,660,559.00	0.65
10	300253	卫宁健康	4,654,150.78	0.65
11	002127	南极电商	4,532,097.56	0.63
12	002049	紫光国微	4,528,118.00	0.63
13	300383	光环新网	4,496,602.94	0.63
14	300529	健帆生物	4,231,474.55	0.59
15	002812	恩捷股份	4,072,924.70	0.57
16	002414	高德红外	3,973,101.34	0.55
17	600536	中国软件	3,816,741.00	0.53
18	000066	中国长城	3,798,235.90	0.53
19	600161	天坛生物	3,775,416.32	0.53
20	600521	华海药业	3,735,977.10	0.52

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。

#### 8.4.3 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	209,095,692.09
卖出股票收入（成交）总额	249,599,934.79

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。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	16,300.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,300.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
----	------	------	-------	------	--------------

1	128142	新乳转债	163	16,300.00	0.00
---	--------	------	-----	-----------	------

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 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。

#### 8.11 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。

#### 8.12 投资组合报告附注

##### 8.12.1 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

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。

##### 8.12.2 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。

##### 8.12.3 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	30,926.98
2	应收证券清算款	7,195,640.39
3	应收股利	-
4	应收利息	1,203.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,227,771.17

##### 8.12.4 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。

##### 8.12.5 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。

### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
345	1,705,271.56	586,499,073.00	99.69	1,819,614.00	0.31

#### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

### 9.2 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	中信证券股份有限公司	1,012,787.00	0.17
2	姜晓平	235,683.00	0.04
3	张红艳	197,700.00	0.03
4	孙建兴	183,563.00	0.03
5	陈妙琴	139,373.00	0.02
6	朱庆芳	115,758.00	0.02
7	李淑清	69,455.00	0.01
8	肖伟华	66,700.00	0.01
9	徐红	61,115.00	0.01
10	钮冰融	46,303.00	0.01
11	中国农业银行股份有限公司— 国寿安保中证 500 交易型开放 式指数证券投资基金联接基	585,486,286.00	99.52

注：表中前十名持有人为除国寿安保中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 9.4 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

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年5月29日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	636,318,687.00

本报告期基金总申购份额	-
减：本报告期基金总赎回份额	48,000,000.00
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	588,318,687.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金管理人决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会表决投票时间自 2020 年 9 月 26 日起至 2020 年 10 月 25 日止，会议于 2020 年 10 月 26 日表决通过了《关于国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金修改投资范围并修订基金合同有关事项的议案》。议案对基金合同中的投资范围、投资策略、投资比例限制、基金资产估值、基金费用与税收、基金信息披露等相关章节予以修改，并根据法律法规的更新相应修改基金合同。

### 11.2 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。

2020 年 8 月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 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。

### 11.6 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。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	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	239,582,726.05	52.71%	223,125.91	52.71%	-
海通证券	2	178,510,036.99	39.27%	166,247.88	39.27%	-
国泰君安	2	36,448,250.55	8.02%	33,944.35	8.02%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	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。

### 11.7.2 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	1,754,514.08	93.84%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	115,175.85	6.16%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 11.8 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 500 交易型开放式指数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 1 月 15 日
2	国寿安保中证 500ETF 托管协议	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 15 日
3	国寿安保基金管理有限公司关于调整旗下部分 ETF 基金交易结算模式的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 15 日
4	国寿安保中证 500ETF 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 1 月 15 日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 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
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下 4 只基金增加扩位证券简称的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 14 日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费调整的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 18 日
8	国寿安保中证 500ETF 更新招募说明书（2020 年第 2 号）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 18 日
9	国寿安保中证 500ETF 更新招募说明书（摘要）	中证报、证监会指	2020 年 3 月 18 日

	(2020 年第 2 号)	定网站及公司网站	
10	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
11	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 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
12	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 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
13	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 2 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 7 月 21 日
14	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 8 月 29 日
15	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 8 月 31 日
16	国寿安保基金管理有限公司关于以通讯方式召开国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 9 月 22 日
17	国寿安保基金管理有限公司关于以通讯方式召开国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 9 月 23 日
18	国寿安保基金管理有限公司关于以通讯方式召开国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 9 月 24 日
19	国寿安保中证 500 交易型开放式指数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 10 月 27 日
20	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要(更新)	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 10 月 27 日
21	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 10 月 27 日
22	国寿安保中证 500 交易型开放式指数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 10 月 27 日
23	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 10 月 27 日
24	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 10 月 28 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

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

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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20200101~20201231	633,486,286.00	-	48,000,000.00	585,486,286.00	99.52
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>							

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

13.1.2 《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

13.1.3 《国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 报告期内国寿安保中证500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

13.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 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

### 13.3 查阅方式

13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

13.3.2 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)

13.3.3 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

2021 年 3 月 31 日