

国寿安保核心产业灵活配置混合型
证券投资基金
2021 年中期报告

2021 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：中国银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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	6
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
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	10
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	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4 报表附注	14
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	40
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	41
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	41

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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	41
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	41
7.12 投资组合报告附注	41
§ 8 基金份额持有人信息	42
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	42
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	42
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情况.....	42
§ 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	45
§ 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	46
12.1 备查文件目录	46
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	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	国寿安保核心产业混合
基金主代码	002376
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016 年 2 月 3 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	432,042,612.64 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入研究的基础上，自上而下精选具备核心产业优势的上市公司，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	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。除主要的股票投资策略外，本基金还可通过债券投资策略以及衍生工具投资策略，进一步为基金组合规避风险、增强收益。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发展趋势，评估市场的系统性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，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。在债券类资产的投资上，将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 X60%+中证全债指数收益率 X40%。
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	95566
传真	010-50850776	010-66594942
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 1 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 1 号

邮政编码	100033	100818
法定代表人	王军辉	刘连舸

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

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(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	43,301,399.85
本期利润	-8,294,247.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0184
本期加权平均净值利润率	-1.56%
本期基金份额净值增长率	-0.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	22,351,641.65
期末可供分配基金份额利润	0.0517
期末基金资产净值	510,670,768.68
期末基金份额净值	1.182
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	58.33%

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

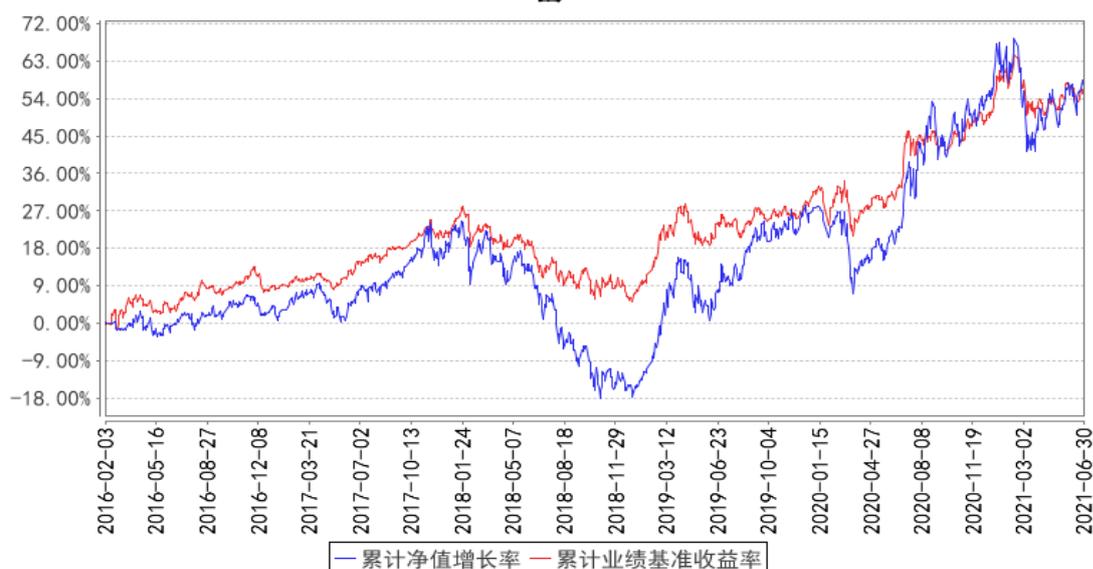
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	1.03%	1.03%	-1.13%	0.48%	2.16%	0.55%
过去三个月	8.04%	1.01%	2.68%	0.59%	5.36%	0.42%

过去六个月	-0.56%	1.41%	1.31%	0.79%	-1.87%	0.62%
过去一年	27.72%	1.44%	16.48%	0.80%	11.24%	0.64%
过去三年	47.99%	1.36%	36.72%	0.81%	11.27%	0.55%
自基金合同生效起至今	58.33%	1.18%	55.83%	0.71%	2.50%	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

国寿安保核心产业混合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 2016 年 02 月 03 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2016 年 02 月 03 日至 2021 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可（2013）1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安本资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 81 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 3175.94

亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2371.90 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		
李丹	基金经理	2016 年 2 月 3 日	-	14 年	李丹女士，硕士。曾任中国银河证券研究部研究员、资产管理部投资经理；现任国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳嘉混合型证券投资基金、国寿安保稳信混合型证券投资基金及国寿安保消费新蓝海灵活配置混合型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遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，新冠疫情持续反复仍对全球经济产生了不确定性，印度疫情爆发带动东南亚和英国疫情反复。美国消费继续复苏，通胀走高，就业伴随疫苗接种有所

恢复。美联储维持了利率水平和货币政策导向，三季度关注美国就业恢复后美联储可能明确 QE taper 信号。

国内方面，中国政府坚持各项疫情防控手段，社会生产和需求保持稳定发展，出口整体偏强，消费投资有所改善。大宗价格仍居高位，CPI 快速升，PPI 大幅回升至年内较高点。

国内经济结构转型加速，部分高景气行业出现了爆发式增长，成为国内经济增长中的亮点。海外疫情在疫苗陆续接种的背景下仍有反复，经济预期转弱使得中美银行间的流动性都非常宽松，2 季度呈现股债双牛局面。A 股市场在经历了 2021 年春节后的快速下跌之后，从稳固盘整逐步走向了快速上涨，其中以创业板为代表的成长股表现突出。新能源车、半导体、光伏、CXO、有色等行业表现强势，带动了市场情绪的修复，甚至到了季度末，这一短期交易情绪逐步向极端。分行业看，电气设备、钢铁、化工、采掘、有色、医药等行业涨幅居前，家电、非银等行业跌幅居前。

本基金在市场先抑后扬的过程中，维持了权益仓位中高配置，以稳健绩优个股为主，适当增配了部分产业趋势好、业绩趋势好、估值处于合理区间的价值成长股。

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 1.182 元；本报告期基金份额净值增长率为 -0.56%，业绩比较基准收益率为 1.31%。

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，全球疫情仍面临反复，短期内预计仍会维持经济预期走弱与流动性充裕的宏观组合。但三季度需要密切关注美国就业恢复后美联储可能明确 QE taper 信号。如果美国就业市场出现持续恢复，或者疫情得到有效控制，货币政策或将面临转向风险，全球市场的波动就会加大。

当前 A 股市场存在显著的结构分化，从市场整体估值水平来看仍处于合理水平，这为我们下半年投资创造出一些板块性投资机会。本基金延续一贯的投资思路，在优势产业方向上加强布局，在这些产业中寻找公司治理规范、具备长期成长性驱动力的公司作为组合的核心配置。另外对过去一个阶段市场表现较差的低估值品种，在风险充分释放之后，最终有机会为投资者带来可观的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日

常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

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

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金于 2021 年 1 月 13 日登记权益并除息，2021 年 1 月 14 日每份份额发放红利 0.05 元人民币。

本基金于 2021 年 3 月 12 日登记权益并除息，2021 年 3 月 15 日每份份额发放红利 0.05 元人民币。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算以及费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	50,757,687.65	55,185,086.54
结算备付金		861,767.41	935,411.49
存出保证金		120,332.90	324,173.02
交易性金融资产	6.4.7.2	454,483,007.45	538,908,364.75
其中：股票投资		454,467,920.90	538,891,958.53
基金投资		-	-
债券投资		15,086.55	16,406.22
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		5,576,637.49	15,202,591.06
应收利息	6.4.7.5	4,879.85	6,324.81
应收股利		-	-
应收申购款		1,238.15	1,008.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		511,805,550.90	610,562,960.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		859.92	6,476.08

应付管理人报酬		617,996.25	750,342.91
应付托管费		102,999.36	125,057.15
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	323,665.93	273,862.79
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	89,260.76	170,000.89
负债合计		1,134,782.22	1,325,739.82
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	432,042,612.64	471,735,832.31
未分配利润	6.4.7.10	78,628,156.04	137,501,388.04
所有者权益合计		510,670,768.68	609,237,220.35
负债和所有者权益总计		511,805,550.90	610,562,960.17

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.182 元，基金份额总额 432,042,612.64 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		-2,056,234.16	-16,299,769.64
1. 利息收入		133,225.08	1,475,128.47
其中：存款利息收入	6.4.7.11	133,219.96	634,426.24
债券利息收入		5.12	232,440.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	608,261.53
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		49,404,379.86	34,438,377.47
其中：股票投资收益	6.4.7.12	45,636,515.60	13,353,990.63
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	6.4.7.13.3	-	-
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	3,767,864.26	21,084,386.84
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填	6.4.7.17	-51,595,647.46	-52,214,063.66

列)			
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	1, 808. 36	788. 08
减: 二、费用		6, 238, 013. 45	9, 772, 227. 33
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	3, 979, 548. 97	7, 245, 247. 46
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	663, 258. 21	1, 207, 541. 23
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	1, 478, 770. 55	1, 206, 297. 74
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	116, 435. 72	113, 140. 90
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		-8, 294, 247. 61	-26, 071, 996. 97
减: 所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		-8, 294, 247. 61	-26, 071, 996. 97

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金

本报告期: 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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)	471, 735, 832. 31	137, 501, 388. 04	609, 237, 220. 35
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-8, 294, 247. 61	-8, 294, 247. 61
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)	-39, 693, 219. 67	-3, 405, 405. 01	-43, 098, 624. 68
其中: 1. 基金申购款	446, 781. 98	97, 124. 17	543, 906. 15
2. 基金赎回款	-40, 140, 001. 65	-3, 502, 529. 18	-43, 642, 530. 83
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)	-	-47, 173, 579. 38	-47, 173, 579. 38
五、期末所有者权益 (基金净值)	432, 042, 612. 64	78, 628, 156. 04	510, 670, 768. 68
项目	上年度可比期间 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)	892, 792, 925. 30	150, 019, 164. 54	1, 042, 812, 089. 84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	-26, 071, 996. 97	-26, 071, 996. 97
三、本期基金份额交易产生的基	-17, 017, 227. 66	-2, 596, 680. 29	-19, 613, 907. 95

金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	272,069.63	32,639.72	304,709.35
2. 基金赎回款	-17,289,297.29	-2,629,320.01	-19,918,617.30
四、本期向基金份额持有人分配 利润产生的基金净值变动(净值 减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	875,775,697.64	121,350,487.28	997,126,184.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

王文英

韩占锋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金（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[2016]66号文《关于准予国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2016年1月18日至2016年2月1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(2016)验字第61090605_A01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2016年2月3日正式生效，首次设立募集规模为240,904,248.57份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国银行股份有限公司（简称“中国银行”）。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、权证等权益类金融工具，债券等固定收益类金融工具（包括国债、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、大额存单等）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（但须符合中国证监会相关规定）。

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核心产业相关股票，其余资产占基金资产的比例

为 5%-100%；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 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整

证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

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

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[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[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 2021 年 6 月 30 日
活期存款	50,757,687.65
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	50,757,687.65

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	403,029,321.07	454,467,920.90	51,438,599.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,900.00	15,086.55
	银行间市场	-	-
	合计	12,900.00	15,086.55
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	403,042,221.07	454,483,007.45	51,440,786.38

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	4,431.16
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	387.80
应收债券利息	6.79
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	54.10

合计	4,879.85
----	----------

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 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	323,665.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	323,665.93

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	0.61
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	89,260.76

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	471,735,832.31	471,735,832.31
本期申购	446,781.98	446,781.98
本期赎回（以“-”号填列）	-40,140,001.65	-40,140,001.65
- 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	432,042,612.64	432,042,612.64

注：本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.10 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	26,543,090.83	110,958,297.21	137,501,388.04
本期利润	43,301,399.85	-51,595,647.46	-8,294,247.61
本期基金份额交易产生的变动数	-319,269.65	-3,086,135.36	-3,405,405.01

其中：基金申购款	10,824.88	86,299.29	97,124.17
基金赎回款	-330,094.53	-3,172,434.65	-3,502,529.18
本期已分配利润	-47,173,579.38	-	-47,173,579.38
本期末	22,351,641.65	56,276,514.39	78,628,156.04

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
活期存款利息收入		126,086.61
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		5,846.20
其他		1,287.15
合计		133,219.96

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		45,636,515.60
股票投资收益——赎回差价收入		-
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		45,636,515.60

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年1月1日至2021年6月30日	
卖出股票成交总额		608,061,548.97
减：卖出股票成本总额		562,425,033.37
买卖股票差价收入		45,636,515.60

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

本基金于本报告期间无债券投资收益。

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金于本报告期间无债券买卖的投资收益。

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期间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 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,767,864.26
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	3,767,864.26

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1. 交易性金融资产	-51,595,647.46
股票投资	-51,594,327.79
债券投资	-1,319.67
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	-51,595,647.46

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	1,808.32
基金转换费收入	0.04
合计	1,808.36

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	1,478,770.55
银行间市场交易费用	-
合计	1,478,770.55

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	8,575.57
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
其他	600.00
合计	116,435.72

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

本基金本报告期内不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。

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
中国银行	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、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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,979,548.97	7,245,247.46
其中：支付销售机构的客户维护费	20,995.82	1,194,008.12

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	663,258.21	1,207,541.23

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25%的年费率计提。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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间基金管理人均未有运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020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	-	-	38,231,998.98	8.10

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国银行	50,757,687.65	126,086.61	50,761,748.57	588,255.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

基金于本报告期及上年度均未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

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。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年1月13日	-	2021年1月13日	0.5000	23,581,465.29	5,253.75	23,586,719.04	-
2	2021年3月12日	-	2021年3月12日	0.5000	23,581,642.27	5,218.07	23,586,860.34	-
合计	-	-	-	1.0000	47,163,107.56	10,471.82	47,173,579.38	-

6.4.12 期末(2021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
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	549	13,505.40	89,487.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

		日	日							
300940	南极光	2021年 1月27 日	2021年 8月3 日	新股流 通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股流 通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年 2月2 日	2021年 8月9 日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年 2月3 日	2021年 8月10 日	新股流 通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年 2月18 日	2021年 8月25 日	新股流 通受限	13.00	27.42	648	5,616.00	17,768.16	锁定期内 发生送股
300950	德固特	2021年 2月24 日	2021年 9月3 日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300953	震裕科技	2021年 3月11 日	2021年 9月22 日	新股流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年 3月16 日	2021年 9月24 日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年 3月16 日	2021年 9月27 日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股流 通受限	47.33	251.96	368	17,417.44	92,721.28	-
300958	建工修复	2021年 3月18 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业科技	2021年 3月22 日	2021年 9月29 日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金	2021年	2021年	新股流	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-

	辐照	3月29日	10月11日	通受限						
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	270	7,635.60	31,241.70	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	555	18,437.10	48,562.50	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-

300991	创益通	2021年 5月12 日	2021年 11月 22日	新股流 通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年 5月17 日	2021年 11月 25日	新股流 通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月 26日	新股流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股流 通受限	20.81	42.23	482	10,030.42	20,354.86	-
300997	欢乐家	2021年 5月26 日	2021年 12月2 日	新股流 通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	新股流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	新股流 通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年 6月18 日	2021年 12月 27日	新股流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年 6月4 日	2021年 12月 16日	新股流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9 日	2021年 12月 20日	新股流 通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9 日	2021年 12月 17日	新股流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月 22日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月 29日	新股流 通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月 30日	新股流 通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-

		日	日								
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2022年 1月5 日	新股流 通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股流 通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44		-
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-
688079	美迪凯	2021年 2月23 日	2021年 9月2 日	新股流 通受限	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80		-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24		-
688131	皓元医药	2021年 6月1 日	2021年 12月8 日	新股流 通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50		-
688195	腾景科技	2021年 3月18 日	2021年 9月27 日	新股流 通受限	13.60	19.87	2,693	36,624.80	53,509.91		-
688316	青云科技	2021年 3月5 日	2021年 9月16 日	新股流 通受限	63.70	65.00	1,428	90,963.60	92,820.00		-
688319	欧林生物	2021年 5月31 日	2021年 12月8 日	新股流 通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08		-
688367	工大高科	2021年 6月21 日	2021年 12月 28日	新股流 通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98		-
688499	利元亨	2021年 6月23 日	2021年 7月1 日	新股未 上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65		-
688533	上声电子	2021年 4月9 日	2021年 10月 19日	新股流 通受限	7.72	19.11	3,493	26,965.96	66,751.23		-
688621	阳光	2021年	2021年	新股流	26.89	63.99	1,485	39,931.65	95,025.15		-

	诺和	6月11日	12月21日	通受限							
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91		-
688662	富信科技	2021年3月25日	2021年10月8日	新股流通受限	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56		-
688665	四方光电	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02		-
688667	菱电电控	2021年3月3日	2021年9月13日	新股流通受限	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08		-
688681	科汇股份	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46		-
688690	纳微科技	2021年6月16日	2021年12月23日	新股流通受限	8.07	79.89	3,477	28,059.39	277,777.53		-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未有参与转融通证券出借业务的债券。

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、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，因此，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有

的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、结算保证金、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 2021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	50,757,687.65	-	-	-	50,757,687.65
结算备付金	861,767.41	-	-	-	861,767.41
存出保证金	120,332.90	-	-	-	120,332.90
交易性金融资产	-	-	15,086.55	454,467,920.90	454,483,007.45
应收利息	-	-	-	4,879.85	4,879.85
应收申购款	-	-	-	1,238.15	1,238.15
应收证券清算款	-	-	-	5,576,637.49	5,576,637.49
资产总计	51,739,787.96	-	15,086.55	460,050,676.39	511,805,550.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	859.92	859.92
应付管理人报酬	-	-	-	617,996.25	617,996.25
应付托管费	-	-	-	102,999.36	102,999.36
应付交易费用	-	-	-	323,665.93	323,665.93
其他负债	-	-	-	89,260.76	89,260.76
负债总计	-	-	-	1,134,782.22	1,134,782.22
利率敏感度缺口	51,739,787.96	-	15,086.55	458,915,894.17	510,670,768.68
上年度末 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	55,185,086.54	-	-	-	55,185,086.54

结算备付金	935,411.49	-	-	-	935,411.49
存出保证金	324,173.02	-	-	-	324,173.02
交易性金融资产	-	-	16,406.22	538,891,958.53	538,908,364.75
应收利息	-	-	-	6,324.81	6,324.81
应收申购款	-	-	-	1,008.50	1,008.50
应收证券清算款	-	-	-	15,202,591.06	15,202,591.06
资产总计	56,444,671.05	-	16,406.22	554,101,882.90	610,562,960.17
负债	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	6,476.08	6,476.08
应付管理人报酬	-	-	-	750,342.91	750,342.91
应付托管费	-	-	-	125,057.15	125,057.15
应付交易费用	-	-	-	273,862.79	273,862.79
其他负债	-	-	-	170,000.89	170,000.89
负债总计	-	-	-	1,325,739.82	1,325,739.82
利率敏感度缺口	56,444,671.05	-	16,406.22	552,776,143.08	609,237,220.35

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票和银行间同业市场交易的债券，所面临的最大的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。

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核心产业相关股票，其余资产占基金资产的比例为 5%-100%；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。于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	454,467,920.90	88.99	538,891,958.53	88.45
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	15,086.55	0.00	16,406.22	0.00
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	454,483,007.45	89.00	538,908,364.75	88.46

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	+5%	41,497,024.10	11,952,758.08
	-5%	-41,497,024.10	-11,952,758.08

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。本表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 451,745,914.25 元（上年度末属于第一层次的余额为人民币：520,168,203.67 元），属于第二层次的余额为人民币 2,737,093.20 元（上年度末属于第二层次的余额为人民币：18,740,161.08 元），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

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基

金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公允价值的情况。

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 2021 年 8 月 30 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	454,467,920.90	88.80
	其中：股票	454,467,920.90	88.80
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	15,086.55	0.00
	其中：债券	15,086.55	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	51,619,455.06	10.09
8	其他各项资产	5,703,088.39	1.11
9	合计	511,805,550.90	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	441,037,266.71	86.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	77,638.12	0.02

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	158,997.70	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	13,105,305.65	2.57
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	0.01
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	454,467,920.90	88.99

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的股票。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000858	五粮液	134,722	40,132,336.58	7.86
2	000725	京东方A	5,872,100	36,641,904.00	7.18
3	603589	口子窖	451,000	30,528,190.00	5.98
4	600885	宏发股份	386,300	24,221,010.00	4.74
5	600887	伊利股份	566,464	20,862,869.12	4.09
6	002304	洋河股份	80,000	16,576,000.00	3.25
7	600519	贵州茅台	8,000	16,453,600.00	3.22
8	688981	中芯国际	254,197	15,714,458.54	3.08
9	300207	欣旺达	460,000	14,977,600.00	2.93
10	603185	上机数控	82,000	14,673,900.00	2.87
11	300316	晶盛机电	289,963	14,643,131.50	2.87
12	002191	劲嘉股份	1,300,000	13,832,000.00	2.71
13	600809	山西汾酒	30,000	13,440,000.00	2.63
14	605305	中际联合	242,968	12,784,976.16	2.50
15	603259	药明康德	80,000	12,527,200.00	2.45
16	688139	海尔生物	109,896	11,550,069.60	2.26
17	600660	福耀玻璃	200,000	11,170,000.00	2.19
18	002484	江海股份	699,965	10,835,458.20	2.12
19	300911	亿田智能	154,527	10,705,630.56	2.10
20	688656	浩欧博	111,757	8,311,368.09	1.63
21	002706	良信股份	354,453	7,989,370.62	1.56

22	002138	顺络电子	200,000	7,754,000.00	1.52
23	000799	酒鬼酒	29,944	7,653,686.40	1.50
24	002154	报喜鸟	1,000,000	6,370,000.00	1.25
25	601689	拓普集团	169,973	6,362,089.39	1.25
26	000301	东方盛虹	300,000	6,270,000.00	1.23
27	002463	沪电股份	400,000	6,188,000.00	1.21
28	688301	奕瑞科技	21,801	6,104,280.00	1.20
29	600966	博汇纸业	399,900	5,218,695.00	1.02
30	002925	盈趣科技	119,920	4,666,087.20	0.91
31	600882	妙可蓝多	65,100	4,543,980.00	0.89
32	002597	金禾实业	130,000	4,511,000.00	0.88
33	688696	极米科技	4,800	3,993,600.00	0.78
34	000650	仁和药业	300,000	3,276,000.00	0.64
35	600703	三安光电	100,000	3,205,000.00	0.63
36	002677	浙江美大	143,497	2,623,125.16	0.51
37	600031	三一重工	89,979	2,615,689.53	0.51
38	003016	欣贺股份	150,000	2,401,500.00	0.47
39	000333	美的集团	30,000	2,141,100.00	0.42
40	002626	金达威	40,000	1,788,000.00	0.35
41	000488	晨鸣纸业	200,000	1,628,000.00	0.32
42	002705	新宝股份	60,000	1,575,000.00	0.31
43	002475	立讯精密	30,000	1,380,000.00	0.27
44	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.09
45	688289	圣湘生物	4,423	439,867.35	0.09
46	688155	先惠技术	2,403	286,197.30	0.06
47	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.05
48	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.04
49	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.04
50	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.02
51	688621	阳光诺和	1,485	95,025.15	0.02
52	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.02
53	688316	青云科技	1,428	92,820.00	0.02
54	300957	贝泰妮	368	92,721.28	0.02
55	300919	中伟股份	549	89,487.00	0.02
56	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.02
57	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.01
58	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01
59	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
60	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.01
61	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.01
62	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.01
63	300979	华利集团	555	48,562.50	0.01

64	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.01
65	300894	火星人	628	42,704.00	0.01
66	300973	立高食品	270	31,241.70	0.01
67	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.01
68	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.01
69	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
70	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
71	300925	法本信息	600	15,774.00	0.00
72	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
73	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
74	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
75	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
76	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
77	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
78	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
79	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
80	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
81	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
82	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
83	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
84	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
85	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
86	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
87	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
88	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
89	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
90	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
91	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
92	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
93	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
94	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
95	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
96	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
97	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
98	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
99	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
100	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
101	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
102	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
103	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
104	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
105	300991	创益通	254	6,733.54	0.00

106	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
107	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
108	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
109	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
110	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
111	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
112	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
113	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
114	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
115	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
116	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
117	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
118	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
119	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
120	301010	晶雪节能	218	3,838.98	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	002304	洋河股份	27,202,164.40	4.46
2	000799	酒鬼酒	22,438,817.00	3.68
3	002714	牧原股份	21,413,674.00	3.51
4	300911	亿田智能	19,161,531.18	3.15
5	002677	浙江美大	19,068,056.90	3.13
6	603589	口子窖	16,203,704.00	2.66
7	002191	劲嘉股份	14,776,899.98	2.43
8	600809	山西汾酒	14,224,939.00	2.33
9	603185	上机数控	13,756,687.00	2.26
10	000725	京东方 A	13,339,439.00	2.19
11	600519	贵州茅台	13,149,183.00	2.16
12	605305	中际联合	12,891,421.04	2.12
13	002463	沪电股份	12,675,584.00	2.08
14	603259	药明康德	11,924,825.00	1.96
15	600966	博汇纸业	11,915,592.00	1.96
16	000568	泸州老窖	11,633,435.00	1.91
17	002444	巨星科技	11,493,954.32	1.89
18	688139	海尔生物	10,872,823.47	1.78
19	000488	晨鸣纸业	10,821,446.00	1.78
20	600600	青岛啤酒	10,632,528.00	1.75

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	000596	古井贡酒	31,645,356.26	5.19
2	600690	海尔智家	27,708,035.66	4.55
3	600031	三一重工	25,605,509.00	4.20
4	002706	良信股份	24,059,261.18	3.95
5	002714	牧原股份	23,224,480.00	3.81
6	002600	领益智造	22,070,963.92	3.62
7	000799	酒鬼酒	20,998,061.00	3.45
8	600887	伊利股份	20,139,182.00	3.31
9	601318	中国平安	19,924,335.00	3.27
10	002677	浙江美大	18,203,234.00	2.99
11	002304	洋河股份	18,029,401.00	2.96
12	002938	鹏鼎控股	15,386,312.25	2.53
13	688169	石头科技	13,583,256.23	2.23
14	000568	泸州老窖	12,169,865.00	2.00
15	002867	周大生	11,765,405.39	1.93
16	600438	通威股份	11,709,926.18	1.92
17	000651	格力电器	11,427,472.00	1.88
18	601636	旗滨集团	11,143,346.00	1.83
19	002242	九阳股份	10,786,314.58	1.77
20	002444	巨星科技	10,567,295.60	1.73

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	529,595,323.53
卖出股票收入（成交）总额	608,061,548.97

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

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）	15,086.55	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	15,086.55	0.00

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

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	128136	立讯转债	129	15,086.55	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金本报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	120,332.90
2	应收证券清算款	5,576,637.49

3	应收股利	-
4	应收利息	4,879.85
5	应收申购款	1,238.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,703,088.39

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	128136	立讯转债	15,086.55	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，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 (%)
431	1,002,419.05	430,920,999.72	99.74	1,121,612.92	0.26

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	56,528.07	0.01

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、基金投资和研发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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2016 年 2 月 3 日）基金份额总额	240,904,248.57
本报告期期初基金份额总额	471,735,832.31
本报告期基金总申购份额	446,781.98
减：本报告期基金总赎回份额	40,140,001.65
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	432,042,612.64

§ 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

本基金管理人于 2021 年 3 月 3 日发布公告，岳海先生自 2021 年 3 月 3 日起任公司总经理助理。

本报告期内，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、基金托管人的托管业务部门及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国盛证券	2	983,656,315.25	86.98%	620,984.39	82.55%	-
海通证券	2	127,802,194.42	11.30%	119,022.77	15.82%	-
东吴证券	2	19,451,604.60	1.72%	12,279.62	1.63%	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，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。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国盛证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告（全上线基金）	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年1月4日
2	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年1月12日
3	关于国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年1月8日
4	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年1月22日
5	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年1月12日
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告（全上线基金）	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年1月4日
7	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年1月22日
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司（招赢通平台）费率优惠活动的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月10日
9	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月11日
10	关于国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月9日
11	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月31日
12	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司（招赢通平台）费率优惠活动的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月10日
13	关于国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月9日
14	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金分红公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月11日
15	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告（全上线基金）	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021年4月1日

16	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
17	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告（全上线基金）	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 1 日
18	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
19	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 6 月 8 日
20	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
21	国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 6 月 8 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	20210101~20210630	429,921,754.08	-	-	429,921,754.08	99.51
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保核心产业灵活配置混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保核心产业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 报告期内国寿安保核心产业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.gsfoods.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

2021 年 8 月 31 日