国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金
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：招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商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 02 月 04 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标和基金净值表现 6
3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 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遵规守信情况的说明 8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 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 9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 10
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遵规守信情况声明 10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、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 38
7.1 期末基金资产组合情况 38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 39
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 40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
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 50
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 50
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 50
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 50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 50
7.12 投资组合报告附注 51
§8 基金份额持有人信息 51

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 51
8.2 期末上市基金前十名持有人 52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 52
8.4 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 52
§9 开放式基金份额变动 52
§10 重大事件揭示 52
10.1 基金份额持有人大会决议 52
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 53
10.4 基金投资策略的改变 53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 53
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 53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 53
10.8 其他重大事件 54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 56
§12 备查文件目录 56
12.1 备查文件目录 56
12.2 存放地点 56
12.3 查阅方式 56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证沪港深 300ETF
场内简称	AH300ETF
基金主代码	517300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,285,434,450.00 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	2021 年 2 月 24 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。 1、组合复制策略 本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。 在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。 2、替代性策略 对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	中证沪港深 300 指数。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数、标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资标的包括港股通投资标的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉	张燕
	联系电话	010-50850744	0755-83199084
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95555
传真		010-50850776	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
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	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		王军辉	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金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、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 2 月 4 日(基金合同生效日) - 2021 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-70,906,228.30
本期利润	-291,414,907.13
加权平均基金份额本期利润	-0.0785
本期加权平均净值利润率	-8.54%
本期基金份额净值增长率	-7.12%
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	-234,063,664.48
期末可供分配基金份额利润	-0.0712
期末基金资产净值	3,051,370,785.52
期末基金份额净值	0.9288
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	-7.12%

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。

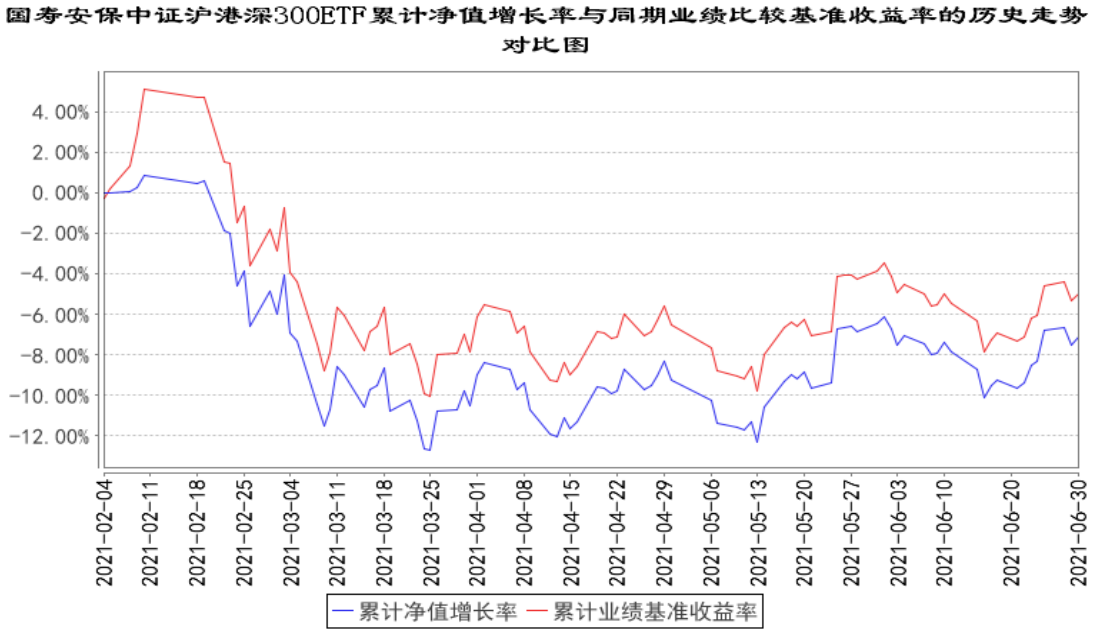
上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

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	-0.71%	0.76%	-1.16%	0.77%	0.45%	-0.01%
过去三个月	3.82%	0.92%	3.11%	0.94%	0.71%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-7.12%	1.18%	-4.96%	1.26%	-2.16%	-0.08%

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



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 02 月 04 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。至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。图示日期为 2021 年 02 月 04 日至 2021 年 06 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚

安保资本投资有限公司），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		
李康	本基金的基金经理	2021 年 2 月 4 日	-	12 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。
苏天醒	本基金的基金经理	2021 年 3 月 1 日	-	11 年	苏天醒，北京邮电大学电子工程专业硕士，2010 年 3 月至 2012 年 11 月任中国国际金融有限公司研究员；2013 年 2 月至 2014 年 6 月任新华资产管理股份有限公司交易员；2014 年 6 月至 2015 年 5 月任宁波灵均投资管理合伙企业（有限合伙）投资交易总监；2015 年 5 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保中证沪港深 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基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金

合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金处于建仓期，跟踪误差主要来自成立初期仓位不足、成分股调整、股票停牌等因素引起的成份股权重偏离、以及汇率波动等因素。日常申赎、市场波动和港股交易备付金等，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 0.9288 元；本报告期基金份额净值增长率为-7.12%，业绩比较基准收益率为-4.96%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 A 股市场主要指数呈震荡行情，均有一定涨幅，上证指数上涨 3.40%，沪深 300 上涨 0.24%，中证 500 上涨 6.93%。市场结构分化明显，行业和主题投资轮动加速，科技创新类上市公司受到市场关注，科创 50 和创业板指分别上涨 14.01%和 17.22%。展望下半年，整体宏观环境对权益类资产相对友好。短期疫情即使有所反复，但在前期防控经验和疫苗接种的背景下整体可控。受益于政策支持、经济增长对疫情适应能力增强等因素，主要经济体有望保持复苏势头，带动全球经济重建进程。国内

通胀呈现 CPI 整体可控,PPI 顶部回落的趋势,货币政策大概率保持稳健偏宽松的流动性环境。这样的宏观经济的大背景下，有利于企业盈利逐步向好，居民收入增长也将带来消费逐步改善。二季度中期以来，景气向好的半导体、新能源已经持续的走出结构性行情，后续随着上市公司业绩逐步改善，金融、消费、建筑建材等板块也会表现出一定的景气度，带动整个 A 股的投资机会不断涌现。

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历。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

托管人声明:招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金

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
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	44,196,136.63
结算备付金		4,547,699.83
存出保证金		731,353.24
交易性金融资产	6.4.7.2	3,000,047,088.92
其中：股票投资		2,998,518,088.92
基金投资		-
债券投资		1,529,000.00
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		8,621,180.89
应收利息	6.4.7.5	10,334.71
应收股利		3,699,363.04
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.6	-
资产总计		3,061,853,157.26
负债和所有者权益	**附注号**	**本期末 2021 年 6 月 30 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		8,104,109.62
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,292,986.25
应付托管费		258,597.24
应付销售服务费		-
应付交易费用	6.4.7.7	482,832.89
应交税费		653.07
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	343,192.67
负债合计		10,482,371.74
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	3,285,434,450.00
未分配利润	6.4.7.10	-234,063,664.48
所有者权益合计		3,051,370,785.52
负债和所有者权益总计		3,061,853,157.26

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 04 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 02 月 04 日起至 2021 年 06 月 30 日止。报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9288 元，基金份额总额 3,285,434,450.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
一、收入		-277,491,167.02
1.利息收入		1,579,620.28
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,396,867.11
债券利息收入		596.05
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		135,081.12
证券出借利息收入		47,076.00
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-59,933,795.71
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-86,084,645.33
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.13	715,372.48
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	25,435,477.14
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-220,508,678.83
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	1,371,687.24
减：二、费用		13,923,740.11
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	6,867,434.95
2．托管费	6.4.10.2.2	1,373,486.99
3．销售服务费		-
4．交易费用	6.4.7.19	5,161,732.81
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6．税金及附加		170.84
7．其他费用	6.4.7.20	520,914.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-291,414,907.13
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-291,414,907.13

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）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）	3,936,434,450.00	-	3,936,434,450.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-291,414,907.13	-291,414,907.13
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）	-651,000,000.00	57,351,242.65	-593,648,757.35
其中：1.基金申购款	3,000,000.00	-136,991.10	2,863,008.90
2.基金赎回款	-654,000,000.00	57,488,233.75	-596,511,766.25
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）	3,285,434,450.00	-234,063,664.48	3,051,370,785.52

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

国寿安保中证沪港深 300 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[2020]3525 号文《关于准予国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数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 2021 年 1 月 25 日至 2021 年 1 月 29 日向社会公开发行募集，募集期结束经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具普华永道中天验字(2021)第 0157 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 2021 年 2 月 4 日正式生效，首次设立募集规模为 3,936,434,450.00 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，基金托管人为招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）。

本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股。为更好地实现投资目标，本基金还可投资于其他股票（包含港股通标的股票、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货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的相关规定）。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%，且不低于非现金基金资产的 80%。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。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。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股，未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式，基金管理人可在履行适当程序后相应调整。本基金将根据法律法规

参与转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。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。

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 02 月 04 日（基金合同生效日）至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间系 2021 年 2 月 4 日至 2021 年 6 月 30 日止。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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、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。

6.4.4.4 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

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

卖出股票于成交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成交日结转；

(2)债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交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；

卖出债券于成交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

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

卖出权证于成交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成交日结转；

(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；

(5)回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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)资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4)买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5)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；

(6)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；

(7)衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8)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；

(9)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；

(10)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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

（1）当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1%以上，可进行收益分配；在收益评价日，基金管理人对基金累计报酬率和标的指数累计报酬率进行计算，计算方法参见招募说明书；

（2）在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 12 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值；

（3）若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

（4）本基金的收益分配方式是现金分红；

（5）本基金每一基金份额享有同等分配权；

（6）法律法规、监管机构、登记机构、深圳证券交易所另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

无。

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

本基金本报告期无需要说明的会计估值变更。

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；

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

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

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

业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

6.4.6.3 企业所得税

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

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

6.4.6.4 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，

证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

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

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	44,196,136.63
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	44,196,136.63

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		3,219,026,767.75	2,998,518,088.92	-220,508,678.83
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	1,529,000.00	1,529,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	1,529,000.00	1,529,000.00	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,220,555,767.75	3,000,047,088.92	-220,508,678.83

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金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	5,419.88
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	2,223.06
应收债券利息	108.84
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	2,256.33
其他	326.60
合计	10,334.71

6.4.7.6 其他资产

本基金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	482,832.89
银行间市场应付交易费用	-
合计	482,832.89

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	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	97,703.55
应付指数使用费	245,489.12
合计	343,192.67

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,936,434,450.00	3,936,434,450.00
本期申购	3,000,000.00	3,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-654,000,000.00	-654,000,000.00
- 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	3,285,434,450.00	3,285,434,450.00

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-70,906,228.30	-220,508,678.83	-291,414,907.13
本期基金份额交易产生的变动数	6,141,078.35	51,210,164.30	57,351,242.65
其中：基金申购款	-2,791.33	-134,199.77	-136,991.10
基金赎回款	6,143,869.68	51,344,364.07	57,488,233.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-64,765,149.95	-169,298,514.53	-234,063,664.48

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	1,241,365.63
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	135,121.86
其他	20,379.62
合计	1,396,867.11

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2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-60,706,178.39
股票投资收益——赎回差价收入	-25,378,466.94
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	-86,084,645.33

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	782,874,571.10
减：卖出股票成本总额	843,580,749.49
买卖股票差价收入	-60,706,178.39

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	407,270,442.82
减：现金支付赎回款总额	155,538,833.82
减：赎回股票成本总额	277,110,075.94
赎回差价收入	-25,378,466.94

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

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	715,372.48

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	715,372.48

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,493,470.99
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,777,600.00
减：应收利息总额	498.51
买卖债券差价收入	715,372.48

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期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

本基金于本报告期无买卖衍生工具差价收入。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	25,435,477.14
其中：证券出借权益补偿收入	30,935.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	25,435,477.14

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-220,508,678.83
股票投资	-220,508,678.83
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	-220,508,678.83

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	891,362.10
其他	480,325.14
合计	1,371,687.24

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
交易所市场交易费用	5,161,732.81
银行间市场交易费用	-
合计	5,161,732.81

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
审计费用	53,293.38
信息披露费	44,410.17
证券出借违约金	-
银行费用	10,764.87
指数使用费	412,046.10
其他	400.00
合计	520,914.52

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

截至财务报表报出日，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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”）	基金管理人
招商银行股份有限公司（简称"招商银行"）	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"）	国寿安保的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称"中国人寿"）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
广发银行股份有限公司(简称“广发银行”)	基金管理人股东之股东的联营企业

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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	6,867,434.95
其中：支付销售机构的客户维护费	5,466.42

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×0.50%/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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期

	2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,373,486.99

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×0.10%/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

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

本基金于本报告期未发生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

本基金于本报告期未发生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固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期未运用固有资金投资本基金。

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	
	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	1,820,269,500.00	55.40

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 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入

招商银行	44,196,136.63	1,241,365.63

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，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

本基金本报告期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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有 1,316,300.00 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 72,452,549.94 元，估值总额为人民币 71,330,297.00 元，占基金资产净值的比例为 2.34%；本基金持有 247,000.00 股招商银行的 H 股，成本总额为人民币 13,256,185.42 元，估值总额为人民币 13,615,949.10 元，占基金资产净值的比例为 0.45%。

本基金持有 177,200.00 股中国人寿的 A 股普通股，成本总额为人民币 6,053,350.66 元，估值总额为人民币 6,005,308.00 元，占基金资产净值的比例为 0.20%；本基金持有 401,000.00 股中国人寿的 H 股，成本总额为人民币 5,588,742.59 元，估值总额为人民币 5,138,426.83 元，占基金资产净值的比例为 0.17%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末(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	-
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	853	40,372.49	214,921.88	-
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	中金辐照	2021 年 3 月 29 日	2021 年 10 月 11 日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
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	-
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	360	10,180.80	41,655.60	-
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	925	30,728.50	80,937.50	-
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	241	5,015.21	10,177.43	-
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	-
301015	百洋医药	2021 年 6 月 22 日	2021 年 12 月 30 日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
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	-
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	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2021 年 7 月 6 日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 6 日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
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	-
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	-
688097	博众精工	2021 年 4 月 29 日	2021 年 11 月 12 日	新股流通受限	11.27	28.01	3,983	44,888.41	111,563.83	-
688113	联测科技	2021 年 4 月 26 日	2021 年 11 月 8 日	新股流通受限	19.14	49.29	1,415	27,083.10	69,745.35	-
688226	威腾电气	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股流通受限	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
688323	瑞华泰	2021 年 4 月 21 日	2021 年 10 月 28 日	新股流通受限	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
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	-
688633	星球石墨	2021 年 3 月 17 日	2021 年 9 月 24 日	新股流通受限	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
688661	和林微纳	2021 年 3 月 19 日	2021 年 9 月 29 日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
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	-

6.4.12.1.2 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
113049	长汽转债	2021 年 6 月 10 日	2021 年 07 月 08 日	新债未上市	100.00	100.00	730	73,000.00	73,000.00	-

113050	南银转债	2021 年 6 月 15 日	2021 年 07 月 01 日	新债未上市	100.00	100.00	14,560	1,456,000.00	1,456,000.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021 年 6 月 16 日	重大事项停牌	5.59	2021 年 07 月 06 日	6.15	409,700	2,828,535.23	2,290,223.00	-

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银行间市场债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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000625	长安汽车	2021 年 7 月 13 日-2021 年 7 月 14 日	26.28	48,000	1,261,440.00
2	000876	新 希 望	2021 年 7 月 13 日-2021 年 7 月 14 日	14.67	46,700	685,089.00
3	002352	顺丰控股	2021 年 7 月 2 日	67.70	12,500	846,250.00
4	002602	世纪华通	2021 年 7 月 7 日	6.42	100,000	642,000.00
5	600196	复星医药	2021 年 7 月 13 日	72.13	10,000	721,300.00
6	600584	长电科技	2021 年 7 月 14 日	37.68	13,400	504,912.00
7	600918	中泰证券	2021 年 7 月 9 日	10.82	13,000	140,660.00
8	601012	隆基股份	2021 年 7 月 5 日	88.84	22,540	2,002,453.60
9	601360	三六零	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 2 日	12.21	55,000	671,550.00
10	601633	长城汽车	2021 年 7 月 13 日	43.59	25,000	1,089,750.00
11	601696	中银证券	2021 年 7 月 9 日	20.59	15,000	308,850.00
12	601788	光大证券	2021 年 7 月 5 日	17.89	20,000	357,800.00
13	601919	中远海控	2021 年 7 月 13 日-2021 年 7 月 14 日	30.54	45,000	1,374,300.00
合计	-	-	-	-	426,140	10,606,354.60

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；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。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。

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	44,196,136.63	-	-	-	44,196,136.63
结算备付金	4,547,699.83	-	-	-	4,547,699.83
存出保证金	731,353.24	-	-	-	731,353.24
交易性金融资产	-	-	1,529,000.00	2,998,518,088.92	3,000,047,088.92
应收利息	-	-	-	10,334.71	10,334.71
应收股利	-	-	-	3,699,363.04	3,699,363.04
应收证券清算款	-	-	-	8,621,180.89	8,621,180.89
资产总计	49,475,189.70	-	1,529,000.00	3,010,848,967.56	3,061,853,157.26
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,292,986.25	1,292,986.25
应付托管费	-	-	-	258,597.24	258,597.24
应付证券清算款	-	-	-	8,104,109.62	8,104,109.62
应付交易费用	-	-	-	482,832.89	482,832.89
应交税费	-	-	-	653.07	653.07
其他负债	-	-	-	343,192.67	343,192.67
负债总计	-	-	-	10,482,371.74	10,482,371.74
利率敏感度缺口	49,475,189.70	-	1,529,000.00	3,000,366,595.82	3,051,370,785.52

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.05%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	861,367,680.82	-	861,367,680.82
资产合计	-	861,367,680.82	-	861,367,680.82
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	861,367,680.82	-	861,367,680.82

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。	
	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）
分析	+5 个基准点	43,068,384.04
	-5 个基准点	-43,068,384.04

注：此表为外汇风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的股票公允价值的变动对基金净值产生的影响。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致流

动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	2,998,518,088.92	98.27
交易性金融资产－基金投资	-	-
交易性金融资产－债券投资	1,529,000.00	0.05
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	3,000,047,088.92	98.32

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）
分析	+5%	139,670,373.68
	-5%	-139,670,373.68

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。此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

于 2021 年 6 月 30 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 2,994,573,756.92 元，属于第二层次的余额为人民币 5,473,332.00 元，本报告期末无属于第三层次的余额。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和可转换债券的公允价值列入第一层次。本基金根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 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	2,998,518,088.92	97.93
	其中：股票	2,998,518,088.92	97.93
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,529,000.00	0.05
	其中：债券	1,529,000.00	0.05
	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	48,743,836.46	1.59
8	其他各项资产	13,062,231.88	0.43
9	合计	3,061,853,157.26	100.00

注：1.上述表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额为人民币 861,367,680.82 元，

占基金净资产的比例为 28.23%。

2.通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 10,606,354.60 元，占基金资产净值的比例为 0.35%。

7.2 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	23,825,349.70	0.78
B	采矿业	45,343,901.00	1.49
C	制造业	1,217,525,778.13	39.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,242,915.39	1.06
E	建筑业	22,133,247.37	0.73
F	批发和零售业	4,278,923.22	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	57,221,248.33	1.88
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	72,085,914.90	2.36
J	金融业	498,584,461.66	16.34
K	房地产业	36,232,679.00	1.19
L	租赁和商务服务业	41,432,687.00	1.36
M	科学研究和技术服务业	35,974,567.40	1.18
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	4,109,063.00	0.13
Q	卫生和社会工作	40,929,645.40	1.34
R	文化、体育和娱乐业	5,199,880.00	0.17
S	综合	-	-
	合计	2,137,150,408.10	70.04

7.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	-	-
消费者非必需品	163,269,998.71	5.35
消费者常用品	40,175,705.56	1.32
能源	11,539,917.82	0.38
金融	248,990,874.47	8.16
医疗保健	54,331,033.89	1.78
工业	15,430,270.42	0.51
信息技术	52,250,788.11	1.71
电信服务	189,840,861.78	6.22
公用事业	29,044,374.80	0.95
地产建筑业	56,493,855.26	1.85
合计	861,367,680.82	28.23

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	00700	腾讯控股	360,800	175,325,246.98	5.75
2	600519	贵州茅台	66,700	137,181,890.00	4.50
3	601318	中国平安	1,151,800	74,037,704.00	2.43
3	02318	中国平安	400,500	25,343,513.44	0.83
4	03690	美团-W	328,400	87,550,925.07	2.87
5	600036	招商银行	1,316,300	71,330,297.00	2.34
5	03968	招商银行	247,000	13,615,949.10	0.45
6	300750	宁德时代	148,702	79,525,829.60	2.61
7	000858	五 粮 液	206,359	61,472,282.51	2.01
8	01299	友邦保险	650,000	52,192,218.00	1.71
9	00005	汇丰控股	1,115,200	41,617,912.38	1.36
10	601012	隆基股份	460,500	40,910,820.00	1.34
11	00939	建设银行	6,457,000	32,827,444.82	1.08
11	601939	建设银行	716,000	4,761,400.00	0.16
12	000333	美的集团	524,475	37,431,780.75	1.23
13	601398	工商银行	3,725,900	19,262,903.00	0.63
13	01398	工商银行	4,665,000	17,700,338.59	0.58
14	002594	比亚迪	96,400	24,196,400.00	0.79
14	01211	比亚迪股份	45,000	8,694,403.92	0.28
15	600276	恒瑞医药	476,058	32,357,662.26	1.06
16	002415	海康威视	496,700	32,037,150.00	1.05
17	601166	兴业银行	1,546,500	31,780,575.00	1.04
18	601888	中国中免	103,800	31,150,380.00	1.02
19	300760	迈瑞医疗	64,500	30,963,225.00	1.01
20	603259	药明康德	190,660	29,855,449.40	0.98
21	300059	东方财富	879,637	28,843,297.23	0.95
22	000651	格力电器	511,792	26,664,363.20	0.87
23	00388	香港交易所	68,100	26,224,399.09	0.86
24	600900	长江电力	1,209,300	24,959,952.00	0.82
25	01810	小米集团-W	1,077,400	24,205,040.78	0.79
26	002475	立讯精密	520,106	23,924,876.00	0.78
27	600887	伊利股份	647,000	23,829,010.00	0.78
28	000001	平安银行	1,032,000	23,343,840.00	0.77
29	600030	中信证券	907,300	22,628,062.00	0.74
30	000725	京东方 A	3,599,400	22,460,256.00	0.74
31	02269	药明生物	181,500	21,490,504.60	0.70
32	300015	爱尔眼科	287,080	20,376,938.40	0.67
33	601328	交通银行	2,919,300	14,304,570.00	0.47

33	03328	交通银行	940,000	4,082,850.14	0.13
34	000568	泸州老窖	77,800	18,356,132.00	0.60
35	600031	三一重工	631,200	18,348,984.00	0.60
36	600309	万华化学	166,700	18,140,294.00	0.59
37	603501	韦尔股份	55,500	17,871,000.00	0.59
38	603288	海天味业	134,512	17,345,322.40	0.57
39	03988	中国银行	4,490,000	10,423,549.37	0.34
39	601988	中国银行	2,239,900	6,898,892.00	0.23
40	000002	万 科 A	724,000	17,238,440.00	0.56
41	002714	牧原股份	279,581	17,004,116.42	0.56
42	600809	山西汾酒	37,100	16,620,800.00	0.54
43	300122	智飞生物	85,000	15,872,050.00	0.52
44	601919	中远海控	514,100	15,700,614.00	0.51
45	002142	宁波银行	382,920	14,922,392.40	0.49
46	600436	片仔癀	32,200	14,435,260.00	0.47
47	601899	紫金矿业	1,470,000	14,244,300.00	0.47
48	601601	中国太保	364,400	10,556,668.00	0.35
48	02601	中国太保	149,000	3,031,309.04	0.10
49	00941	中国移动	330,500	13,351,368.46	0.44
50	300782	卓胜微	24,760	13,308,500.00	0.44
51	002812	恩捷股份	56,700	13,273,470.00	0.44
52	002304	洋河股份	64,000	13,260,800.00	0.43
53	600690	海尔智家	403,000	10,441,730.00	0.34
53	06690	海尔智家	120,600	2,719,453.78	0.09
54	002352	顺丰控股	193,890	13,126,353.00	0.43
55	601288	农业银行	3,055,700	9,258,771.00	0.30
55	01288	农业银行	1,649,000	3,704,669.78	0.12
56	002230	科大讯飞	189,096	12,779,107.68	0.42
57	300014	亿纬锂能	120,638	12,537,907.34	0.41
58	600000	浦发银行	1,247,800	12,478,000.00	0.41
59	300274	阳光电源	108,400	12,472,504.00	0.41
60	600438	通威股份	287,220	12,428,009.40	0.41
61	300124	汇川技术	164,500	12,215,770.00	0.40
62	600837	海通证券	1,026,600	11,805,900.00	0.39
63	000661	长春高新	30,200	11,687,400.00	0.38
64	000100	TCL 科技	1,491,300	11,408,445.00	0.37
65	601628	中国人寿	177,200	6,005,308.00	0.20
65	02628	中国人寿	401,000	5,138,426.83	0.17
66	00669	创科实业	98,500	11,113,759.73	0.36
67	601816	京沪高铁	2,089,000	11,050,810.00	0.36
68	000063	中兴通讯	328,600	10,919,378.00	0.36
69	002241	歌尔股份	254,590	10,881,176.60	0.36

70	300347	泰格医药	55,600	10,747,480.00	0.35
71	600028	中国石化	1,421,200	6,196,432.00	0.20
71	00386	中国石油化工股份	1,372,000	4,486,542.08	0.15
72	603986	兆易创新	56,546	10,624,993.40	0.35
73	02331	李宁	134,000	10,570,078.66	0.35
74	600585	海螺水泥	254,900	10,463,645.00	0.34
75	002271	东方雨虹	187,800	10,389,096.00	0.34
76	601668	中国建筑	2,227,100	10,356,015.00	0.34
77	002460	赣锋锂业	85,365	10,336,847.85	0.34
78	603799	华友钴业	90,300	10,312,260.00	0.34
79	002027	分众传媒	1,092,700	10,282,307.00	0.34
80	300142	沃森生物	166,500	10,273,050.00	0.34
81	600016	民生银行	2,262,049	9,975,636.09	0.33
82	600763	通策医疗	23,857	9,805,227.00	0.32
83	600196	复星医药	128,500	9,268,705.00	0.30
84	600048	保利地产	764,100	9,199,764.00	0.30
85	600703	三安光电	285,900	9,163,095.00	0.30
86	000338	潍柴动力	504,133	9,008,856.71	0.30
87	600919	江苏银行	1,257,700	8,929,670.00	0.29
88	02020	安踏体育	58,000	8,822,044.99	0.29
89	002129	中环股份	225,400	8,700,440.00	0.29
90	601229	上海银行	1,056,352	8,662,086.40	0.28
91	601688	华泰证券	548,000	8,658,400.00	0.28
92	601658	邮储银行	1,156,400	5,805,128.00	0.19
92	01658	邮储银行	640,000	2,785,138.18	0.09
93	600050	中国联通	1,979,700	8,552,304.00	0.28
94	02382	舜宇光学科技	41,400	8,453,566.68	0.28
95	600660	福耀玻璃	149,144	8,329,692.40	0.27
96	600570	恒生电子	88,600	8,261,950.00	0.27
97	601211	国泰君安	480,100	8,228,914.00	0.27
98	600104	上汽集团	372,200	8,177,234.00	0.27
99	02313	申洲国际	48,600	7,930,105.16	0.26
100	06160	百济神州	45,100	7,925,661.85	0.26
101	601766	中国中车	1,291,900	7,854,752.00	0.26
102	688111	金山办公	19,600	7,738,080.00	0.25
103	601169	北京银行	1,572,500	7,658,075.00	0.25
104	00016	新鸿基地产	78,000	7,509,189.17	0.25
105	600999	招商证券	394,400	7,501,488.00	0.25
106	002371	北方华创	26,400	7,322,832.00	0.24
107	00001	长和	145,000	7,299,421.80	0.24
108	06098	碧桂园服务	104,000	7,260,397.25	0.24
109	600019	宝钢股份	946,800	7,233,552.00	0.24

110	002311	海大集团	88,385	7,212,216.00	0.24
111	00883	中国海洋石油	960,000	7,053,375.74	0.23
112	002049	紫光国微	45,200	6,969,388.00	0.23
113	00002	中电控股	109,000	6,965,508.10	0.23
114	002410	广联达	100,792	6,874,014.40	0.23
115	600406	国电南瑞	295,200	6,860,448.00	0.22
116	601088	中国神华	350,200	6,835,904.00	0.22
117	300498	温氏股份	473,900	6,809,943.00	0.22
118	601818	光大银行	1,758,800	6,648,264.00	0.22
119	300601	康泰生物	43,900	6,541,100.00	0.21
120	00175	吉利汽车	317,000	6,449,160.85	0.21
121	600745	闻泰科技	66,300	6,424,470.00	0.21
122	06618	京东健康	68,450	6,339,189.00	0.21
123	000625	长安汽车	241,059	6,335,030.52	0.21
124	000538	云南白药	54,200	6,272,024.00	0.21
125	01113	长实集团	137,500	6,132,429.60	0.20
126	09633	农夫山泉	189,200	6,131,880.43	0.20
127	300759	康龙化成	28,200	6,119,118.00	0.20
128	00027	银河娱乐	117,000	6,050,511.32	0.20
129	00003	香港中华煤气	601,550	6,036,484.95	0.20
130	600893	航发动力	113,455	6,034,671.45	0.20
131	01801	信达生物	78,500	5,914,570.25	0.19
132	600346	恒力石化	224,900	5,901,376.00	0.19
133	02319	蒙牛乳业	148,000	5,781,791.09	0.19
134	002821	凯莱英	15,500	5,775,300.00	0.19
135	600588	用友网络	173,543	5,772,040.18	0.19
136	300454	深信服	22,100	5,734,508.00	0.19
137	601390	中国中铁	1,082,900	5,674,396.00	0.19
138	601633	长城汽车	129,500	5,644,905.00	0.18
139	002493	荣盛石化	323,850	5,592,889.50	0.18
140	601009	南京银行	531,500	5,591,380.00	0.18
141	601857	中国石油	1,031,500	5,456,635.00	0.18
142	300896	爱美客	6,900	5,443,272.00	0.18
143	688036	传音控股	25,667	5,377,236.50	0.18
144	00011	恒生银行	41,100	5,304,185.49	0.17
145	02688	新奥能源	42,700	5,251,306.80	0.17
146	300413	芒果超媒	75,800	5,199,880.00	0.17
147	00981	中芯国际	257,000	5,110,884.98	0.17
148	00291	华润啤酒	88,000	5,107,307.04	0.17
149	601225	陕西煤业	425,600	5,043,360.00	0.17
150	01109	华润置地	192,000	5,024,431.87	0.16
151	600584	长电科技	132,700	5,000,136.00	0.16

152	02388	中银香港	228,000	4,998,970.22	0.16
153	600009	上海机场	102,241	4,920,859.33	0.16
154	01093	石药集团	516,000	4,825,930.87	0.16
155	000776	广发证券	315,300	4,773,642.00	0.16
156	601100	恒立液压	55,500	4,768,560.00	0.16
157	01928	金沙中国有限公司	174,000	4,734,368.78	0.16
158	688012	中微公司	28,376	4,708,145.92	0.15
159	002001	新 和 成	164,040	4,704,667.20	0.15
160	000895	双汇发展	147,500	4,690,500.00	0.15
161	300433	蓝思科技	159,100	4,679,131.00	0.15
162	600926	杭州银行	314,700	4,641,825.00	0.15
163	002179	中航光电	58,600	4,630,572.00	0.15
164	002050	三花智控	191,500	4,592,170.00	0.15
165	01177	中国生物制药	712,000	4,514,400.12	0.15
166	000166	申万宏源	959,300	4,489,524.00	0.15
167	600958	东方证券	445,200	4,447,548.00	0.15
168	002841	视源股份	35,600	4,424,724.00	0.15
169	600741	华域汽车	167,700	4,405,479.00	0.14
170	002007	华兰生物	116,160	4,260,748.80	0.14
171	000786	北新建材	107,500	4,219,375.00	0.14
172	000157	中联重科	452,300	4,179,252.00	0.14
173	601006	大秦铁路	630,200	4,146,716.00	0.14
174	002607	中公教育	196,700	4,109,063.00	0.13
175	601901	方正证券	438,604	4,105,333.44	0.13
176	00268	金蝶国际	187,000	4,100,032.60	0.13
177	601336	新华保险	88,500	4,063,035.00	0.13
178	600029	南方航空	671,400	4,041,828.00	0.13
179	002236	大华股份	191,400	4,038,540.00	0.13
180	600015	华夏银行	652,400	4,038,356.00	0.13
181	601155	新城控股	96,000	3,993,600.00	0.13
182	601989	中国重工	966,200	3,980,744.00	0.13
183	00968	信义光能	284,000	3,960,567.67	0.13
184	601138	工业富联	317,700	3,942,657.00	0.13
185	000768	中航西飞	147,300	3,871,044.00	0.13
186	603993	洛阳钼业	749,500	3,867,420.00	0.13
187	601877	正泰电器	113,894	3,801,781.72	0.12
188	600760	中航沈飞	62,820	3,788,046.00	0.12
189	601788	光大证券	208,500	3,730,065.00	0.12
190	600547	山东黄金	192,500	3,699,850.00	0.12
191	01997	九龙仓置业	98,000	3,681,704.38	0.12
192	001979	招商蛇口	335,800	3,677,010.00	0.12
193	601186	中国铁建	490,300	3,642,929.00	0.12

194	00066	港铁公司	99,500	3,580,752.27	0.12
195	00960	龙湖集团	97,500	3,529,059.30	0.12
196	000876	新 希 望	240,000	3,520,800.00	0.12
197	601916	浙商银行	885,500	3,515,435.00	0.12
198	00688	中国海外发展	236,500	3,471,321.27	0.11
199	300999	金龙鱼	40,500	3,440,880.00	0.11
200	06969	思摩尔国际	96,000	3,438,820.22	0.11
201	02007	碧桂园	473,000	3,424,092.41	0.11
202	002555	三七互娱	141,500	3,398,830.00	0.11
203	603899	晨光文具	39,700	3,357,032.00	0.11
204	01918	融创中国	151,000	3,348,414.73	0.11
205	06186	中国飞鹤	240,000	3,346,958.59	0.11
206	003816	中国广核	1,252,700	3,344,709.00	0.11
207	000938	紫光股份	152,674	3,340,507.12	0.11
208	002736	国信证券	305,400	3,283,050.00	0.11
209	00267	中信股份	471,000	3,280,284.02	0.11
210	601066	中信建投	103,800	3,262,434.00	0.11
211	600989	宝丰能源	234,300	3,205,224.00	0.11
212	00006	电能实业	80,500	3,191,713.27	0.10
213	603160	汇顶科技	24,300	3,150,009.00	0.10
214	600150	中国船舶	189,700	3,131,947.00	0.10
215	00241	阿里健康	218,000	3,123,595.04	0.10
216	688008	澜起科技	48,067	2,998,419.46	0.10
217	601238	广汽集团	231,200	2,994,040.00	0.10
218	000596	古井贡酒	12,200	2,921,900.00	0.10
219	09992	泡泡玛特	45,400	2,908,785.26	0.10
220	00992	联想集团	388,000	2,883,024.07	0.09
221	601985	中国核电	559,700	2,832,082.00	0.09
222	601360	三六零	229,000	2,796,090.00	0.09
223	002600	领益智造	301,600	2,771,704.00	0.09
224	00017	新世界发展	82,000	2,753,103.10	0.09
225	603833	欧派家居	19,300	2,739,828.00	0.09
226	002938	鹏鼎控股	74,000	2,655,120.00	0.09
227	300033	同花顺	22,800	2,571,384.00	0.08
228	688396	华润微	28,200	2,566,764.00	0.08
229	002602	世纪华通	395,400	2,538,468.00	0.08
230	01833	平安好医生	31,000	2,494,326.22	0.08
231	601111	中国国航	318,600	2,478,708.00	0.08
232	601800	中国交建	375,700	2,434,536.00	0.08
233	300628	亿联网络	28,700	2,405,060.00	0.08
234	00012	恒基地产	78,000	2,388,402.43	0.08
235	00384	中国燃气	120,200	2,370,379.58	0.08

236	601727	上海电气	543,700	2,305,288.00	0.08
237	002024	苏宁易购	409,700	2,290,223.00	0.08
238	00288	万洲国际	392,000	2,276,704.01	0.07
239	000708	中信特钢	107,600	2,242,384.00	0.07
240	01066	威高股份	148,000	2,231,438.86	0.07
241	600606	绿地控股	389,700	2,123,865.00	0.07
242	688363	华熙生物	7,600	2,111,736.00	0.07
243	00083	信和置业	200,000	2,036,931.84	0.07
244	00881	中升控股	37,500	2,015,713.80	0.07
245	00909	明源云	62,000	1,988,754.41	0.07
246	06862	海底捞	58,000	1,973,860.18	0.06
247	01193	华润燃气	50,000	1,938,746.40	0.06
248	601933	永辉超市	404,900	1,915,177.00	0.06
249	01876	百威亚太	92,700	1,889,778.49	0.06
250	00101	恒隆地产	120,000	1,883,163.46	0.06
251	603392	万泰生物	7,120	1,845,361.60	0.06
252	601696	中银证券	88,100	1,813,979.00	0.06
253	03692	翰森制药	64,000	1,810,606.08	0.06
254	600018	上港集团	368,000	1,755,360.00	0.06
255	601995	中金公司	27,800	1,709,700.00	0.06
256	01044	恒安国际	39,500	1,709,092.32	0.06
257	603195	公牛集团	8,300	1,676,600.00	0.05
258	00270	粤海投资	178,000	1,652,910.28	0.05
259	601998	中信银行	323,400	1,649,340.00	0.05
260	01209	华润万象生活	37,200	1,645,171.93	0.05
261	01038	长江基建集团	42,500	1,637,325.42	0.05
262	000617	中油资本	268,400	1,615,768.00	0.05
263	00322	康师傅控股	122,000	1,573,463.28	0.05
264	601319	中国人保	263,300	1,561,369.00	0.05
265	00285	比亚迪电子	36,500	1,548,916.92	0.05
266	688126	沪硅产业	53,000	1,546,540.00	0.05
267	601881	中国银河	138,000	1,487,640.00	0.05
268	603658	安图生物	18,880	1,430,537.60	0.05
269	00656	复星国际	136,500	1,269,812.33	0.04
270	01579	颐海国际	28,000	1,215,003.22	0.04
271	00813	世茂集团	76,000	1,204,053.04	0.04
272	01972	太古地产	62,400	1,201,989.48	0.04
273	00762	中国联通	330,000	1,164,246.34	0.04
274	002032	苏 泊 尔	17,300	1,103,567.00	0.04
275	600025	华能水电	188,800	1,093,152.00	0.04
276	601236	红塔证券	76,900	1,042,764.00	0.03
277	01929	周大福	59,800	882,713.73	0.03

278	600918	中泰证券	80,400	869,928.00	0.03
279	06993	蓝月亮集团	95,000	867,942.65	0.03
280	01128	永利澳门	84,000	854,113.48	0.03
281	601698	中国卫通	46,300	749,597.00	0.02
282	300866	安克创新	4,300	720,121.00	0.02
283	603087	甘李药业	6,700	714,086.00	0.02
284	300888	稳健医疗	5,500	679,910.00	0.02
285	06808	高鑫零售	103,500	497,775.22	0.02
286	688690	纳微科技	3,477	277,777.53	0.01
287	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
288	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.00
289	688097	博众精工	3,983	111,563.83	0.00
290	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.00
291	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
292	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00
293	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
294	688113	联测科技	1,415	69,745.35	0.00
295	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
296	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
297	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
298	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
299	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
300	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
301	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
302	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
303	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
304	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
305	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
306	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
307	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
308	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
309	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
310	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
311	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
312	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
313	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
314	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
315	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
316	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
317	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
318	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
319	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00

320	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
321	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
322	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
323	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
324	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
325	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
326	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
327	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
328	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
329	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
330	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
331	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
332	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
333	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
334	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
335	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
336	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
337	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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	275,812,728.65	9.04
2	600519	贵州茅台	214,597,182.86	7.03
3	601318	中国平安	127,613,214.63	4.18
3	02318	中国平安	38,743,694.12	1.27
4	03690	美团-W	121,349,104.27	3.98
5	600036	招商银行	102,201,790.81	3.35
5	03968	招商银行	16,341,232.42	0.54
6	000858	五 粮 液	92,338,789.41	3.03
7	300750	宁德时代	71,415,405.55	2.34
8	000333	美的集团	69,579,956.89	2.28
9	01299	友邦保险	69,022,063.03	2.26
10	002352	顺丰控股	66,843,363.10	2.19
11	600276	恒瑞医药	56,916,735.79	1.87
12	601166	兴业银行	55,683,473.86	1.82
13	00005	汇丰控股	52,373,374.71	1.72
14	601398	工商银行	26,710,678.80	0.88
14	01398	工商银行	24,873,535.21	0.82
15	601888	中国中免	51,101,897.58	1.67

16	00939	建设银行	42,000,072.31	1.38
16	601939	建设银行	6,950,058.00	0.23
17	601012	隆基股份	47,310,203.78	1.55
18	002594	比亚迪	33,294,097.97	1.09
18	01211	比亚迪股份	10,637,912.13	0.35
19	000651	格力电器	41,671,852.10	1.37
20	300760	迈瑞医疗	41,392,352.54	1.36

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	00700	腾讯控股	46,933,786.57	1.54
2	002352	顺丰控股	40,343,841.92	1.32
3	000858	五 粮 液	22,069,687.26	0.72
4	601318	中国平安	11,627,819.57	0.38
4	02318	中国平安	6,687,168.54	0.22
5	600036	招商银行	13,508,930.00	0.44
5	03968	招商银行	3,172,042.68	0.10
6	03690	美团-W	14,502,344.46	0.48
7	000333	美的集团	14,411,315.62	0.47
8	01299	友邦保险	13,779,543.47	0.45
9	300750	宁德时代	12,320,835.77	0.40
10	00005	汇丰控股	11,149,470.87	0.37
11	300760	迈瑞医疗	10,808,493.00	0.35
12	000651	格力电器	10,495,869.48	0.34
13	300059	东方财富	9,644,543.70	0.32
14	00939	建设银行	8,776,144.61	0.29
14	601939	建设银行	769,487.00	0.03
15	000001	平安银行	8,943,930.11	0.29
16	002594	比亚迪	7,492,277.00	0.25
16	01211	比亚迪股份	1,265,215.72	0.04
17	000568	泸州老窖	8,025,983.00	0.26
18	01398	工商银行	5,145,612.11	0.17
18	601398	工商银行	2,874,579.00	0.09
19	002415	海康威视	7,019,514.35	0.23
20	000002	万 科 A	6,968,293.00	0.23

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	4,338,514,714.18
卖出股票收入（成交）总额	782,874,571.10

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）	1,529,000.00	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,529,000.00	0.05

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	113050	南银转债	14,560	1,456,000.00	0.05
2	113049	长汽转债	730	73,000.00	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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 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	731,353.24
2	应收证券清算款	8,621,180.89
3	应收股利	3,699,363.04
4	应收利息	10,334.71
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,062,231.88

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限制的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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（%）
25,679	127,942.46	1,979,746,250.00	60.26	1,305,688,200.00	39.74

8.2 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	中国人寿保险股份有限公司	1,820,269,500.00	55.40
2	中国人寿保险（集团）公司企业年金计划－中国农业银行股份有限公司	40,004,900.00	1.22
3	宁波珑琪投资管理合伙企业（有限合伙）	30,460,000.00	0.93
4	中国人寿养老保险股份有限公司－国寿福盈今生个人养老保障管理产品开放式 4 号投资	20,002,200.00	0.61
5	都邦财产保险股份有限公司	15,000,000.00	0.46
6	国寿永诚企业年金集合计划－中国银行股份有限公司	10,000,850.00	0.30
7	孙华玲	10,000,000.00	0.30
8	宫福伟	5,000,000.00	0.15
9	交银施罗德基金－建设银行－交银施罗德固收增强 1 号集合资产管理计划	5,000,000.00	0.15
10	王会英	4,168,000.00	0.13

8.3 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	200,000.00	0.01

8.4 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

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
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（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额	3,936,434,450.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	654,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,285,434,450.00

§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的人事变动。

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普华永道中天会计师事务所（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，本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
天风证券	2	1,843,418,019.15	36.04%	1,148,230.52	45.33%	-
中信证券	2	1,660,157,426.37	32.45%	710,195.41	28.04%	-
华泰证券	2	1,611,874,098.49	31.51%	674,633.92	26.63%	-
华创证券	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。

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
天风证券	-	-	400,000,000.00	100.00%	-	-
中信证券	4,493,470.99	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-

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	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 15 日
2	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合同及招募说明书提示性公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 15 日
3	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合同	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 15 日
4	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式	上证报、证监会指定网	2021 年 1 月 15 日

	指数证券投资基金托管协议	站及公司网站	
5	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 15 日
6	国寿安保关于国泰君安证券股份有限公司暂停办理国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 27 日
7	关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 19 日
8	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购和赎回业务公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 19 日
9	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 19 日
10	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 19 日
11	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保沪港深 300ETF 变更基金经理的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 27 日
12	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产品资料概要更新	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 27 日
13	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招募说明书更新	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 27 日
14	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合同生效公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 5 日
15	国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 8 日
16	关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告 20210402	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
17	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产品资料概要更新	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
18	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合同	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
19	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 2 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 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	20210204~20210630	2,000,269,500.00	-	180,000,000.00	1,820,269,500.00	55.40
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中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《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合同》

12.1.3 《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数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 报告期内国寿安保中证沪港深 300 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

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司,地址:北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

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

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询：4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日