

国寿安保沪深 300 交易型开放式 指数证券投资基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录	
§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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	11
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	12
§6 审计报告	13
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	19
§8 投资组合报告	45
8.1 期末基金资产组合情况	45
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	56
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
8.12 投资组合报告附注	57
§9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末上市基金前十名持有人	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	58
§10 开放式基金份额变动	59
§11 重大事件揭示	59
11.1 基金份额持有人大会决议	59
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	59
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	59
11.4 基金投资策略的改变	59
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	59
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	59
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	59
11.8 其他重大事件	61
§12 影响投资者决策的其他重要信息	62
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	63
§13 备查文件目录	63
13.1 备查文件目录	63
13.2 存放地点	63
13.3 查阅方式	63

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保沪深 300ETF
场内简称	国寿 300
基金主代码	510380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,672,802,400.00 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	2018 年 2 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。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。
业绩比较基准	沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	秦一楠
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850776	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈	北京市西城区复兴门内大街 28

	泰商务中心 2 号楼 11 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王军辉	周慕冰

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座 普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2020 年	2019 年	2018 年 1 月 19 日(基金合同生效日) - 2018 年 12 月 31 日
本期已实现收益	347,127,874.50	39,923,025.74	-2,087,955.13
本期利润	1,353,814,267.98	380,820,367.30	-54,864,262.37
加权平均基金份额本期利润	0.3078	0.1016	-0.2330
本期加权平均净值利润率	27.31%	10.36%	-27.11%
本期基金份额净值增长率	29.12%	38.18%	-23.58%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	359,556,613.41	72,881,332.49	-173,519,597.78
期末可供分配基金份额利润	0.0979	0.0154	-0.2358

期末基金资产净值	5,007,716,083.53	4,993,679,906.51	562,282,802.22
期末基金份额净值	1.3635	1.0560	0.7642
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	36.35%	5.60%	-23.58%

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

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

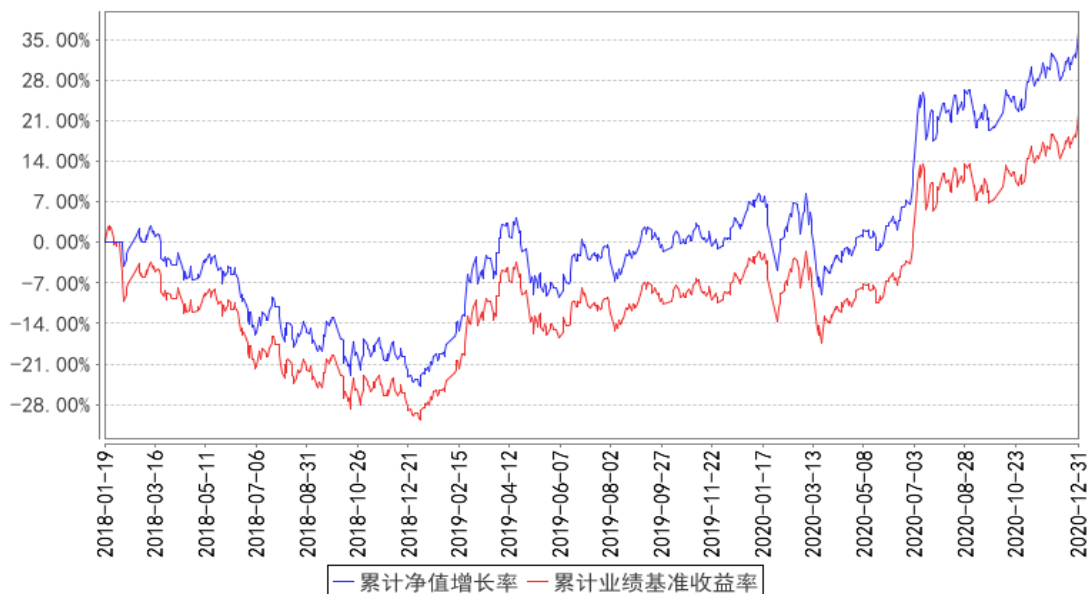
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	13.73%	0.98%	13.60%	0.99%	0.13%	-0.01%
过去六个月	26.34%	1.32%	25.15%	1.35%	1.19%	-0.03%
过去一年	29.12%	1.42%	27.21%	1.43%	1.91%	-0.01%
自基金合同生效起至今	36.35%	1.32%	22.00%	1.35%	14.35%	-0.03%

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

国寿安保沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

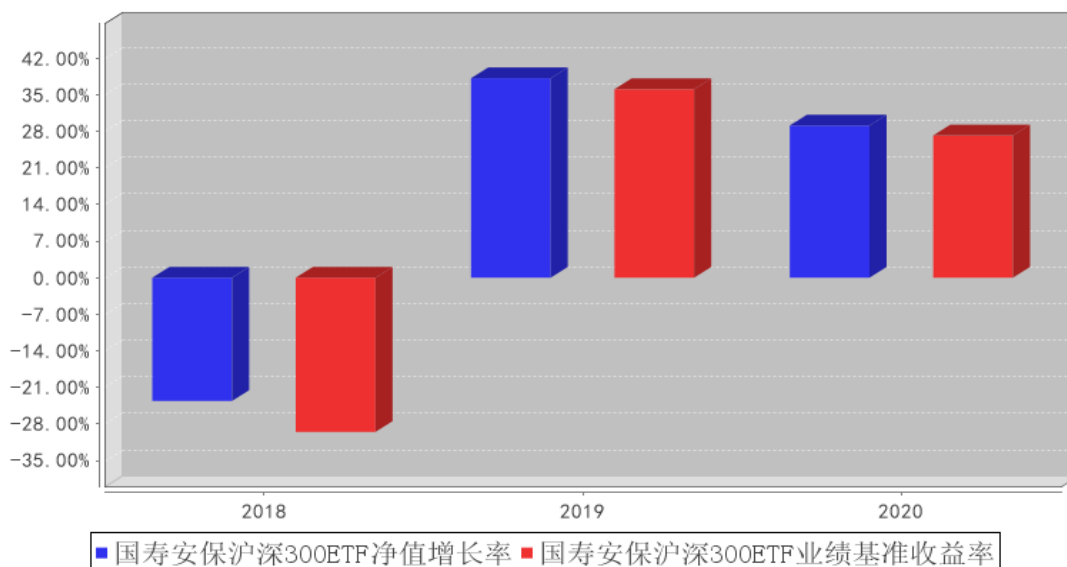


注：本基金的基金合同于 2018 年 01 月 19 日生效，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。

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 2018 年 01 月 19 日至 2020 年 12 月 31 日。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保沪深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。截至 2020 年 12 月 31 日，公司共管理 71 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 2996.65 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2296.27 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2018 年 1 月 19 日	-	10 年	李康先生，博士研究生。2009 年 10 月至 2012 年 12 月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

注：任职日期为基金合同生效日。证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3635 元；本报告期基金份额净值增长率为 29.12%，业绩比较基准收益率为 27.12%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内，本基金自 2020 年 11 月 3 日至 2020 年 12 月 31 日存在连续 20 个工作日持有人数量低于 200 户的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组

合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 24795 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“国寿安保沪深 300ETF 基金”)的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年度 的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了国寿安保沪深 300ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国寿安保沪深 300ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
其他信息	<p>国寿安保沪深 300ETF 基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括国寿安保沪深 300ETF 基金 2020 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责	基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中

<p>任</p>	<p>国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国寿安保沪深 300ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国寿安保沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国寿安保沪深 300ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国寿安保沪深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国寿安保沪深 300ETF 基金不能持续经营。</p> <p>（五）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
<p>会计师事务所的名称</p>	<p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>

注册会计师的姓名	张勇	周祎
会计师事务所的地址	中国 上海市	
审计报告日期	2021 年 03 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	66,645,272.17	45,764,359.89
结算备付金		70,014.38	86,679.04
存出保证金		238,105.58	34,849.49
交易性金融资产	7.4.7.2	4,944,719,638.02	4,951,164,588.98
其中：股票投资		4,943,722,790.32	4,951,000,688.98
基金投资		-	-
债券投资		996,847.70	163,900.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		605,927.27	99,303.00
应收利息	7.4.7.5	15,448.30	10,045.87
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		5,012,294,405.72	4,997,159,826.27
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,125,007.48	2,047,652.96
应付托管费		425,001.52	409,530.56
应付销售服务费		-	-

应付交易费用	7.4.7.7	1,403,488.05	420,952.29
应交税费		3,075.99	3.86
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	621,749.15	601,780.09
负债合计		4,578,322.19	3,479,919.76
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	3,672,802,400.00	4,728,802,400.00
未分配利润	7.4.7.10	1,334,913,683.53	264,877,506.51
所有者权益合计		5,007,716,083.53	4,993,679,906.51
负债和所有者权益总计		5,012,294,405.72	4,997,159,826.27

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3635 元，基金份额总额 3,672,802,400.00 份。

7.2 利润表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		1,387,785,748.43	406,823,274.27
1. 利息收入		1,173,212.05	341,341.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	400,421.28	340,466.23
债券利息收入		1,230.99	875.73
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		771,559.78	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		377,368,574.46	69,450,066.98
其中：股票投资收益	7.4.7.12	267,243,543.81	-30,442,519.70
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	2,071,007.62	605,468.49
资产支持证券投资	7.4.7.13.5	-	-
收益			
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	108,054,023.03	99,287,118.19

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,006,686,393.48	340,897,341.56
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	2,557,568.44	-3,865,476.23
减：二、费用		33,971,480.45	26,002,906.97
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	24,744,339.81	18,228,187.63
2. 托管费	7.4.10.2.2	4,948,867.87	3,645,637.57
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	2,542,530.42	2,724,592.46
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,781.56	0.78
7. 其他费用	7.4.7.20	1,732,960.79	1,404,488.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,353,814,267.98	380,820,367.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,353,814,267.98	380,820,367.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,728,802,400.00	264,877,506.51	4,993,679,906.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,353,814,267.98	1,353,814,267.98
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）	-1,056,000,000.00	-283,778,090.96	-1,339,778,090.96
其中：1. 基金申购款	36,000,000.00	256,568.75	36,256,568.75
2. 基金赎回	-1,092,000,000.00	-284,034,659.71	-1,376,034,659.71

回款			
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）	3,672,802,400.00	1,334,913,683.53	5,007,716,083.53
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	735,802,400.00	-173,519,597.78	562,282,802.22
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	380,820,367.30	380,820,367.30
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）	3,993,000,000.00	57,576,736.99	4,050,576,736.99
其中：1. 基金申购款	4,215,000,000.00	47,326,118.41	4,262,326,118.41
2. 基金赎回款	-222,000,000.00	10,250,618.58	-211,749,381.42
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）	4,728,802,400.00	264,877,506.51	4,993,679,906.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

王文英

韩占锋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2166 号《关于准予国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 294,788,000.00 元(含募集股票市值),业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61090605_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 294,802,400.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,400.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]19 号文审核同意,本基金 294,802,400.00 份基金份额于 2018 年 2 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,权证及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿安保沪深 300ETF 联接基金”)。国寿安保沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金,投

资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司于 2021 年 3 月 30 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金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；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场

交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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损益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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴

纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准

日(即收益评价日)的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资

基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《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》、财税[2015]101 号《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》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%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。

(4)基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2020 年 12 月 31 日	2019 年 12 月 31 日
活期存款	66,645,272.17	45,764,359.89
定期存款	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
合计	66,645,272.17	45,764,359.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末		
	2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,649,052,210.22	4,943,722,790.32	1,294,670,580.10
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	860,000.00	996,847.70
	银行间市场	-	-

	合计	860,000.00	996,847.70	136,847.70
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		3,649,912,210.22	4,944,719,638.02	1,294,807,427.80
项目	上年度末 2019年12月31日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票		4,662,879,654.66	4,951,000,688.98	288,121,034.32
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	163,900.00	163,900.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	163,900.00	163,900.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		4,663,043,554.66	4,951,164,588.98	288,121,034.32

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	13,722.08	9,977.08
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	34.65	42.90
应收债券利息	74.97	8.62
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	1,498.68	-
其他	117.92	17.27
合计	15,448.30	10,045.87

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,403,488.05	420,952.29
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,403,488.05	420,952.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	240,000.00	240,000.00
应付指数使用费	381,749.15	361,780.09
合计	621,749.15	601,780.09

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	4,728,802,400.00	4,728,802,400.00
本期申购	36,000,000.00	36,000,000.00
本期赎回(以“-”号填列)	-1,092,000,000.00	-1,092,000,000.00
- 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	3,672,802,400.00	3,672,802,400.00

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	72,881,332.49	191,996,174.02	264,877,506.51
本期利润	347,127,874.50	1,006,686,393.48	1,353,814,267.98
本期基金份额交易	-60,452,593.58	-223,325,497.38	-283,778,090.96

产生的变动数			
其中：基金申购款	507,868.80	-251,300.05	256,568.75
基金赎回款	-60,960,462.38	-223,074,197.33	-284,034,659.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	359,556,613.41	975,357,070.12	1,334,913,683.53

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	388,093.98	314,555.81
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	10,549.75	21,503.04
其他	1,777.55	4,407.38
合计	400,421.28	340,466.23

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	142,779,645.00	-33,150,017.56
股票投资收益——赎回差价收入	124,463,898.81	2,707,497.86
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	267,243,543.81	-30,442,519.70

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	977,789,850.19	560,241,218.60

减：卖出股票成本总额	835,010,205.19	593,391,236.16
买卖股票差价收入	142,779,645.00	-33,150,017.56

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,376,034,659.71	211,749,381.42
减：现金支付赎回款总额	500,578,579.71	62,931,244.42
减：赎回股票成本总额	750,992,181.19	146,110,639.14
赎回差价收入	124,463,898.81	2,707,497.86

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	10,343,905.13	10,219,842.18
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	8,271,700.00	9,613,500.00
减：应收利息总额	1,197.51	873.69
买卖债券差价收入	2,071,007.62	605,468.49

7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无买卖衍生工具差价收入。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	108,054,023.03	99,287,118.19

其中：证券出借权益补偿收入	1,385,344.81	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	108,054,023.03	99,287,118.19

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019 年12月31日
1. 交易性金融资产	1,006,686,393.48	340,897,341.56
股票投资	1,006,549,545.78	340,897,341.56
债券投资	136,847.70	-
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	1,006,686,393.48	340,897,341.56

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	2,557,568.44	-3,865,476.23
合计	2,557,568.44	-3,865,476.23

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。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	2,542,530.42	2,724,592.46
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,542,530.42	2,724,592.46

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
审计费用	120,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	8,300.47	10,797.33
指数使用费	1,484,660.32	1,093,691.20
上市费	-	60,000.00
合计	1,732,960.79	1,404,488.53

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”）	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）	基金托管人
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
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
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“国寿安保沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	24,744,339.81	18,228,187.63
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人国寿安保基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数。}$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,948,867.87	3,645,637.57

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数。}$$

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生转融通证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
国寿安保沪深 300ETF联接基金	3,638,649,800.00	99.07	4,721,750,100.00	99.85

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	66,645,272.17	388,093.98	45,764,359.89	314,555.81

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于2020年12月31日，本基金持有8,457,500股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币31,256,355.61元，估值总额为人民币26,556,550.00元，占基金资产净值的比例为0.53%（2019年12月31日：本基金持有13,783,200股中国农业银行的A股普通股，成本总额为人民币51,035,469.10元，估值总额为人民币50,860,008.00元，占基金资产净值的比例为1.02%）。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未进行利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
003030	祖名股份	2020年12	2021年1月	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-

		月 25 日	6 日							
003031	中瓷 电子	2020 年 12 月 24 日	2021 年 1 月 4 日	新股未 上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300886	华业 香料	2020 年 9 月 8 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	2
300887	谱尼 测试	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	44.47	74.52	210	9,338.70	15,649.20	2
300888	稳健 医疗	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 17 日	新股流 通受限	74.30	156.39	10,265	762,689.50	1,605,343.35	2
300889	爱克 股份	2020 年 9 月 9 日	2021 年 3 月 16 日	新股流 通受限	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	2
300890	翔丰 华	2020 年 9 月 10 日	2021 年 3 月 18 日	新股流 通受限	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	2
300893	松原 股份	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	13.47	35.08	276	3,717.72	9,682.08	2
300894	火星 人	2020 年 12 月 24 日	2021 年 6 月 30 日	新股流 通受限	14.07	36.97	628	8,835.96	23,217.16	2
300895	铜牛 信息	2020 年 9 月 17 日	2021 年 3 月 24 日	新股流 通受限	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90	2
300896	爱美 客	2020 年 9 月 21 日	2021 年 3 月 29 日	新股流 通受限	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	2
300898	熊猫 乳品	2020 年 10 月 9 日	2021 年 4 月 16 日	新股流 通受限	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88	2
300900	广联 航空	2020 年 10 月 19 日	2021 年 4 月 29 日	新股流 通受限	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64	2
300902	国安 达	2020 年 10 月 22	2021 年 4 月 29 日	新股流 通受限	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26	2

		日								
300907	康平科技	2020年11月11日	2021年5月18日	新股流通受限	14.30	26.85	473	6,763.90	12,700.05	2
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股流通受限	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	2
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股流通受限	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	2
300913	兆龙互连	2020年11月27日	2021年6月7日	新股流通受限	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	2
300917	特发服务	2020年12月14日	2021年6月21日	新股流通受限	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	2
300918	南山智尚	2020年12月15日	2021年6月22日	新股流通受限	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	2
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股流通受限	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	2
300922	天秦装备	2020年12月18日	2021年6月25日	新股流通受限	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	2
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股流通受限	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	2
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00	
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84	2

		日								
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新股未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94	
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63	2
600919	江苏银行	2020年12月17日	2021年1月14日	配股未上市	4.59	5.46	805,470	3,697,107.30	4,397,866.20	-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新股未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65	-
688063	派能科技	2020年12月22日	2021年6月30日	新股流通受限	56.00	189.24	5,499	307,944.00	1,040,630.76	1
688156	路德环境	2020年9月14日	2021年3月22日	新股流通受限	15.91	20.07	2,602	41,397.82	52,222.14	1
688551	科威尔	2020年9月1日	2021年3月10日	新股流通受限	37.94	33.34	2,211	83,885.34	73,714.74	1
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新股未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688678	福立旺	2020年12月15日	2021年6月23日	新股流通受限	18.05	19.25	4,198	75,773.90	80,811.50	1
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股流通受限	78.49	170.53	2,330	182,881.70	397,334.90	1

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113616	韦尔	2020	2021	新债未	100.00	100.00	1,010	101,000.00	101,000.00	-

	转债	年 12 月 28 日	年 1 月 22 日	上市					
--	----	-------------------	---------------	----	--	--	--	--	--

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导意见》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
2020122500000893	000002	万科A	2020年12月25日	2021年1月4日	28.70	200,000	5,740,000.00
合计	-	-	-	-	-	200,000	5,740,000.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金主要投资于标的指数成份股、备

选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析相结合的风险管理方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来

控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，本基金的基金管理人于开放日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。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

债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 0.17%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	66,645,272.17	-	-	-	66,645,272.17
结算备付金	70,014.38	-	-	-	70,014.38

存出保证金	238,105.58	-	-	-	238,105.58
交易性金融资产	-	-	996,847.70	4,943,722,790.32	4,944,719,638.02
应收利息	-	-	-	15,448.30	15,448.30
应收证券清算款	-	-	-	605,927.27	605,927.27
资产总计	66,953,392.13	-	996,847.70	4,944,344,165.89	5,012,294,405.72
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,125,007.48	2,125,007.48
应付托管费	-	-	-	425,001.52	425,001.52
应付交易费用	-	-	-	1,403,488.05	1,403,488.05
应交税费	-	-	-	3,075.99	3,075.99
其他负债	-	-	-	621,749.15	621,749.15
负债总计	-	-	-	4,578,322.19	4,578,322.19
利率敏感度缺口	66,953,392.13	-	996,847.70	4,939,765,843.70	5,007,716,083.53
上年度末 2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	45,764,359.89	-	-	-	45,764,359.89
结算备付金	86,679.04	-	-	-	86,679.04
存出保证金	34,849.49	-	-	-	34,849.49
交易性金融资产	-	-	163,900.00	4,951,000,688.98	4,951,164,588.98
应收证券清算款	-	-	-	99,303.00	99,303.00
应收利息	-	-	-	10,045.87	10,045.87
资产总计	45,885,888.42	-	163,900.00	4,951,110,037.85	4,997,159,826.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,047,652.96	2,047,652.96
应付托管费	-	-	-	409,530.56	409,530.56
应付交易费用	-	-	-	420,952.29	420,952.29
应交税费	-	-	-	3.86	3.86
其他负债	-	-	-	601,780.09	601,780.09
负债总计	-	-	-	3,479,919.76	3,479,919.76
利率敏感度缺口	45,885,888.42	-	163,900.00	4,947,630,118.09	4,993,679,906.51

注:表中所示为本基金资产及负债的账面价值,并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年12月31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0.02%(2019年12月31日:0.00%),因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日:同)。

7.4.13.4.2 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而发生波动

的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,943,722,790.32	98.72	4,951,000,688.98	99.15
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	996,847.70	0.02	163,900.00	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	4,944,719,638.02	98.74	4,951,164,588.98	99.15

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是报告期内所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020 年 12 月 31 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
分析	+5%	257,897,378.30	262,562,695.80
	-5%	-257,897,378.30	-262,562,695.80

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。上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。

7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.14.1 公允价值

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：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：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 4,936,182,595.83 元，属于第二层次的余额为 8,537,042.19 元，无属于第三层次的余额（2019 年 12 月 31 日：第一层次 4,951,000,688.98 元，第二层次 163,900.00 元，无第三层次）。

(ii) 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，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债券的公允价值列入第一层次；并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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(2019 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 基金申购款

于 2020 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 36,256,568.75 元(2019 年度：4,262,326,118.41 元)，其中包括以股票支付的申购款 23,848,943.00 元和以现金支付的申购款 12,407,625.75 元(2019 年度：其中包括以股票支付的申购款 2,905,377,391.09 元和以现金支付的申购款 1,356,948,727.32 元)。

7.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金除公允价值和基金申购款外，无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,943,722,790.32	98.63
	其中：股票	4,943,722,790.32	98.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	996,847.70	0.02
	其中：债券	996,847.70	0.02
	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	66,715,286.55	1.33
8	其他各项资产	859,481.15	0.02
9	合计	5,012,294,405.72	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	53,328,422.40	1.06
B	采矿业	116,208,568.86	2.32
C	制造业	2,568,059,562.46	51.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,310,631.76	1.64
E	建筑业	78,374,790.30	1.57
F	批发和零售业	37,714,492.76	0.75
G	交通运输、仓储和邮政业	119,863,594.35	2.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	146,858,542.05	2.93
J	金融业	1,337,949,465.55	26.72
K	房地产业	150,450,700.25	3.00
L	租赁和商务服务业	103,240,194.75	2.06
M	科学研究和技术服务业	40,248,781.52	0.80
N	水利、环境和公共设施管理业	52,222.14	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	6,650,109.00	0.13
Q	卫生和社会工作	77,772,749.37	1.55
R	文化、体育和娱乐业	24,639,962.80	0.49
S	综合	-	-
	合计	4,943,722,790.32	98.72

8.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	139,018	277,757,964.00	5.55
2	601318	中国平安	2,939,607	255,687,016.86	5.11
3	000858	五粮液	531,201	155,031,011.85	3.10
4	000333	美的集团	1,327,100	130,639,724.00	2.61

5	600036	招商银行	2,774,576	121,942,615.20	2.44
6	600276	恒瑞医药	1,010,657	112,647,829.22	2.25
7	000651	格力电器	1,303,014	80,708,687.16	1.61
8	601888	中国中免	267,951	75,682,759.95	1.51
9	600887	伊利股份	1,652,501	73,321,469.37	1.46
10	601166	兴业银行	3,510,625	73,266,743.75	1.46
11	600030	中信证券	2,263,765	66,554,691.00	1.33
12	601012	隆基股份	711,707	65,619,385.40	1.31
13	002475	立讯精密	1,138,805	63,909,736.60	1.28
14	300059	东方财富	1,824,892	56,571,652.00	1.13
15	600031	三一重工	1,605,100	56,146,398.00	1.12
16	603288	海天味业	266,917	53,527,535.18	1.07
17	000002	万科A	1,783,500	51,186,450.00	1.02
18	000001	平安银行	2,642,000	51,096,280.00	1.02
19	002415	海康威视	1,017,500	49,358,925.00	0.99
20	002594	比亚迪	246,400	47,875,520.00	0.96
21	600900	长江电力	2,392,240	45,835,318.40	0.92
22	000568	泸州老窖	191,900	43,400,104.00	0.87
23	601398	工商银行	8,609,600	42,961,904.00	0.86
24	000725	京东方A	7,127,400	42,764,400.00	0.85
25	002304	洋河股份	170,000	40,118,300.00	0.80
26	300015	爱尔眼科	530,576	39,734,836.64	0.79
27	600309	万华化学	434,298	39,538,489.92	0.79
28	603259	药明康德	280,227	37,752,181.44	0.75
29	601899	紫金矿业	3,736,686	34,713,812.94	0.69
30	601328	交通银行	7,471,600	33,472,768.00	0.67
31	600585	海螺水泥	628,154	32,425,309.48	0.65
32	600837	海通证券	2,466,100	31,714,046.00	0.63
33	600016	民生银行	6,021,100	31,309,720.00	0.63
34	000661	长春高新	69,600	31,244,136.00	0.62
35	002714	牧原股份	404,964	31,222,724.40	0.62
36	600000	浦发银行	3,190,398	30,883,052.64	0.62
37	600048	保利地产	1,941,800	30,719,276.00	0.61
38	600690	海尔智家	1,035,012	30,232,700.52	0.60
39	601601	中国太保	761,109	29,226,585.60	0.58
40	002352	顺丰控股	321,300	28,348,299.00	0.57
41	601668	中国建筑	5,701,600	28,336,952.00	0.57
42	002142	宁波银行	799,400	28,250,796.00	0.56
43	002027	分众传媒	2,792,040	27,557,434.80	0.55
44	601688	华泰证券	1,499,660	27,008,876.60	0.54
45	300124	汇川技术	286,600	26,739,780.00	0.53
46	601288	农业银行	8,457,500	26,556,550.00	0.53

47	000100	TCL 科技	3,668,500	25,972,980.00	0.52
48	300122	智飞生物	168,900	24,981,999.00	0.50
49	600438	通威股份	648,100	24,912,964.00	0.50
50	000063	中兴通讯	707,800	23,817,470.00	0.48
51	600809	山西汾酒	63,313	23,760,735.77	0.47
52	300347	泰格医药	145,309	23,483,387.49	0.47
53	600570	恒生电子	223,626	23,458,367.40	0.47
54	600999	招商证券	1,001,650	23,378,511.00	0.47
55	600104	上汽集团	950,737	23,236,012.28	0.46
56	002241	歌尔股份	616,100	22,992,852.00	0.46
57	300498	温氏股份	1,212,600	22,105,698.00	0.44
58	601211	国泰君安	1,226,749	21,504,909.97	0.43
59	000338	潍柴动力	1,299,300	20,515,947.00	0.41
60	002460	赣锋锂业	202,550	20,498,060.00	0.41
61	600436	片仔癀	75,700	20,250,507.00	0.40
62	600009	上海机场	263,863	19,963,874.58	0.40
63	601229	上海银行	2,505,735	19,644,962.40	0.39
64	601169	北京银行	4,017,524	19,444,816.16	0.39
65	600588	用友网络	439,451	19,278,715.37	0.38
66	600919	江苏银行	3,435,370	18,757,120.20	0.37
67	600660	福耀玻璃	381,700	18,340,685.00	0.37
68	601988	中国银行	5,730,400	18,222,672.00	0.36
69	002410	广联达	229,100	18,039,334.00	0.36
70	300014	亿纬锂能	213,300	17,383,950.00	0.35
71	601628	中国人寿	452,300	17,363,797.00	0.35
72	601818	光大银行	4,327,900	17,268,321.00	0.34
73	002230	科大讯飞	418,400	17,100,008.00	0.34
74	600703	三安光电	620,959	16,772,102.59	0.33
75	600406	国电南瑞	628,242	16,692,389.94	0.33
76	601766	中国中车	3,138,800	16,667,028.00	0.33
77	002271	东方雨虹	428,850	16,639,380.00	0.33
78	601088	中国神华	898,962	16,190,305.62	0.32
79	000538	云南白药	140,900	16,006,240.00	0.32
80	600346	恒力石化	572,220	16,004,993.40	0.32
81	603986	兆易创新	80,149	15,829,427.50	0.32
82	300142	沃森生物	402,300	15,512,688.00	0.31
83	601919	中远海控	1,244,500	15,195,345.00	0.30
84	600028	中国石化	3,639,100	14,665,573.00	0.29
85	600893	航发动力	244,100	14,487,335.00	0.29
86	600019	宝钢股份	2,416,596	14,378,746.20	0.29
87	603799	华友钴业	180,820	14,339,026.00	0.29
88	002493	荣盛石化	514,300	14,199,823.00	0.28

89	000157	中联重科	1,419,400	14,052,060.00	0.28
90	000768	中航西飞	377,000	13,828,360.00	0.28
91	002311	海大集团	210,200	13,768,100.00	0.27
92	601009	南京银行	1,630,901	13,177,680.08	0.26
93	000776	广发证券	802,000	13,056,560.00	0.26
94	601336	新华保险	223,400	12,950,498.00	0.26
95	300413	芒果超媒	178,212	12,920,370.00	0.26
96	000166	申万宏源	2,446,100	12,915,408.00	0.26
97	002007	华兰生物	304,345	12,855,532.80	0.26
98	000895	双汇发展	273,600	12,842,784.00	0.26
99	300601	康泰生物	72,980	12,735,010.00	0.25
100	000876	新希望	565,700	12,671,680.00	0.25
101	600741	华域汽车	436,300	12,574,166.00	0.25
102	600176	中国巨石	616,700	12,309,332.00	0.25
103	601633	长城汽车	323,500	12,231,535.00	0.24
104	002050	三花智控	486,638	11,995,626.70	0.24
105	603993	洛阳钼业	1,918,500	11,990,625.00	0.24
106	002179	中航光电	152,110	11,908,691.90	0.24
107	002001	新和成	347,600	11,707,168.00	0.23
108	601877	正泰电器	298,600	11,693,176.00	0.23
109	601901	方正证券	1,117,494	11,588,412.78	0.23
110	601390	中国中铁	2,190,300	11,542,881.00	0.23
111	601939	建设银行	1,822,300	11,444,044.00	0.23
112	001979	招商蛇口	858,100	11,404,149.00	0.23
113	000625	长安汽车	521,100	11,401,668.00	0.23
114	600050	中国联通	2,537,000	11,315,020.00	0.23
115	600958	东方证券	963,200	11,202,016.00	0.22
116	002129	中环股份	433,400	11,051,700.00	0.22
117	600109	国金证券	678,500	11,039,195.00	0.22
118	601377	兴业证券	1,270,700	11,029,676.00	0.22
119	600547	山东黄金	466,832	11,026,571.84	0.22
120	601857	中国石油	2,645,700	10,979,655.00	0.22
121	300408	三环集团	288,500	10,746,625.00	0.21
122	002202	金风科技	750,006	10,687,585.50	0.21
123	601006	大秦铁路	1,619,300	10,460,678.00	0.21
124	600015	华夏银行	1,668,833	10,430,206.25	0.21
125	601989	中国重工	2,481,600	10,397,904.00	0.21
126	601225	陕西煤业	1,086,900	10,151,646.00	0.20
127	002555	三七互娱	324,400	10,131,012.00	0.20
128	002736	国信证券	738,600	10,074,504.00	0.20
129	601788	光大证券	535,200	9,911,904.00	0.20
130	601100	恒立液压	87,563	9,894,619.00	0.20

131	601186	中国铁建	1,250,200	9,876,580.00	0.20
132	002008	大族激光	229,900	9,828,225.00	0.20
133	300433	蓝思科技	318,199	9,740,071.39	0.19
134	002236	大华股份	488,200	9,710,298.00	0.19
135	600352	浙江龙盛	706,400	9,621,168.00	0.19
136	603019	中科曙光	276,140	9,452,272.20	0.19
137	600926	杭州银行	618,766	9,231,988.72	0.18
138	000786	北新建材	227,100	9,095,355.00	0.18
139	000860	顺鑫农业	122,300	8,871,642.00	0.18
140	600745	闻泰科技	89,510	8,861,490.00	0.18
141	000783	长江证券	1,052,600	8,841,840.00	0.18
142	600760	中航沈飞	112,859	8,823,316.62	0.18
143	002371	北方华创	48,800	8,820,112.00	0.18
144	601108	财通证券	690,000	8,728,500.00	0.17
145	603369	今世缘	152,000	8,721,760.00	0.17
146	300003	乐普医疗	320,600	8,713,908.00	0.17
147	603899	晨光文具	98,100	8,687,736.00	0.17
148	600183	生益科技	308,500	8,687,360.00	0.17
149	601155	新城控股	245,100	8,536,833.00	0.17
150	002601	龙蟠佰利	274,600	8,449,442.00	0.17
151	002044	美年健康	745,228	8,443,433.24	0.17
152	601555	东吴证券	845,429	8,335,929.94	0.17
153	601985	中国核电	1,688,200	8,305,944.00	0.17
154	603501	韦尔股份	35,800	8,273,380.00	0.17
155	600383	金地集团	611,495	8,255,182.50	0.16
156	601669	中国电建	2,076,724	8,057,689.12	0.16
157	000069	华侨城 A	1,113,000	7,891,170.00	0.16
158	002024	苏宁易购	1,013,800	7,816,398.00	0.16
159	000066	中国长城	405,600	7,702,344.00	0.15
160	600111	北方稀土	588,300	7,700,847.00	0.15
161	300144	宋城演艺	433,540	7,682,328.80	0.15
162	000938	紫光股份	370,518	7,577,093.10	0.15
163	601933	永辉超市	1,045,800	7,508,844.00	0.15
164	002624	完美世界	252,800	7,457,600.00	0.15
165	300136	信维通信	205,100	7,358,988.00	0.15
166	600522	中天科技	672,300	7,287,732.00	0.15
167	601138	工业富联	531,100	7,270,759.00	0.15
168	600010	宝钢股份	6,197,040	7,250,536.80	0.14
169	600795	国电电力	3,200,200	7,200,450.00	0.14
170	600029	南方航空	1,191,118	7,099,063.28	0.14
171	002812	恩捷股份	48,900	6,933,042.00	0.14
172	000425	徐工机械	1,280,800	6,877,896.00	0.14

173	600886	国投电力	782,300	6,759,072.00	0.13
174	002456	欧菲光	512,100	6,749,478.00	0.13
175	002607	中公教育	189,300	6,650,109.00	0.13
176	601878	浙商证券	433,700	6,635,610.00	0.13
177	601600	中国铝业	1,780,100	6,461,763.00	0.13
178	600705	中航资本	1,463,000	6,407,940.00	0.13
179	000977	浪潮信息	237,441	6,382,414.08	0.13
180	601800	中国交建	876,400	6,362,664.00	0.13
181	600061	国投资本	454,100	6,280,203.00	0.13
182	002049	紫光国微	46,900	6,275,689.00	0.13
183	000963	华东医药	236,059	6,269,727.04	0.13
184	000728	国元证券	694,420	6,222,003.20	0.12
185	600763	通策医疗	22,100	6,111,092.00	0.12
186	300033	同花顺	49,100	6,087,418.00	0.12
187	600066	宇通客车	359,200	6,077,664.00	0.12
188	000703	恒逸石化	474,610	6,075,008.00	0.12
189	601111	中国国航	808,400	6,054,916.00	0.12
190	601607	上海医药	310,536	5,962,291.20	0.12
191	601838	成都银行	558,500	5,959,195.00	0.12
192	002841	视源股份	51,300	5,901,039.00	0.12
193	600177	雅戈尔	804,821	5,786,662.99	0.12
194	600606	绿地控股	988,300	5,761,789.00	0.12
195	600362	江西铜业	286,500	5,715,675.00	0.11
196	600115	东方航空	1,218,400	5,702,112.00	0.11
197	002602	世纪华通	791,201	5,625,439.11	0.11
198	603160	汇顶科技	35,982	5,597,000.10	0.11
199	600340	华夏幸福	430,877	5,571,239.61	0.11
200	601066	中信建投	129,800	5,451,600.00	0.11
201	600584	长电科技	127,400	5,423,418.00	0.11
202	601727	上海电气	991,368	5,353,387.20	0.11
203	600118	中国卫星	166,200	5,348,316.00	0.11
204	600011	华能国际	1,192,482	5,342,319.36	0.11
205	601021	春秋航空	96,153	5,329,760.79	0.11
206	002508	老板电器	129,900	5,297,322.00	0.11
207	601618	中国中冶	1,937,100	5,288,283.00	0.11
208	002422	科伦药业	267,000	5,190,480.00	0.10
209	600487	亨通光电	368,860	5,160,351.40	0.10
210	002463	沪电股份	274,100	5,150,339.00	0.10
211	601198	东兴证券	374,800	4,992,336.00	0.10
212	600637	东方明珠	555,540	4,966,527.60	0.10
213	000596	古井贡酒	18,200	4,950,400.00	0.10
214	600068	葛洲坝	750,471	4,938,099.18	0.10

215	002157	正邦科技	286,400	4,880,256.00	0.10
216	603833	欧派家居	35,796	4,814,562.00	0.10
217	002673	西部证券	473,000	4,796,220.00	0.10
218	600369	西南证券	874,800	4,706,424.00	0.09
219	600018	上港集团	1,020,800	4,665,056.00	0.09
220	601216	君正集团	937,800	4,642,110.00	0.09
221	600332	白云山	157,400	4,603,950.00	0.09
222	002120	韵达股份	291,491	4,576,408.70	0.09
223	600498	烽火通信	188,700	4,543,896.00	0.09
224	000961	中南建设	504,700	4,456,501.00	0.09
225	601162	天风证券	728,560	4,444,216.00	0.09
226	600489	中金黄金	495,366	4,364,174.46	0.09
227	601881	中国银河	346,800	4,338,468.00	0.09
228	601998	中信银行	832,800	4,255,608.00	0.08
229	600872	中炬高新	63,300	4,218,945.00	0.08
230	002739	万达电影	223,300	4,037,264.00	0.08
231	002252	上海莱士	543,600	4,022,640.00	0.08
232	300628	亿联网络	54,700	3,999,664.00	0.08
233	000656	金科股份	562,900	3,990,961.00	0.08
234	601117	中国化学	676,600	3,971,642.00	0.08
235	600004	白云机场	278,500	3,935,205.00	0.08
236	600271	航天信息	311,100	3,919,860.00	0.08
237	601816	京沪高铁	687,400	3,890,684.00	0.08
238	600600	青岛啤酒	38,500	3,826,900.00	0.08
239	600655	豫园股份	429,000	3,813,810.00	0.08
240	002600	领益智造	315,000	3,776,850.00	0.08
241	002821	凯莱英	12,500	3,739,250.00	0.07
242	688008	澜起科技	45,000	3,729,600.00	0.07
243	003816	中国广核	1,303,400	3,675,588.00	0.07
244	600085	同仁堂	153,100	3,659,090.00	0.07
245	600208	新湖中宝	1,174,400	3,640,640.00	0.07
246	603156	养元饮品	139,444	3,603,232.96	0.07
247	002384	东山精密	137,000	3,562,000.00	0.07
248	601360	三六零	226,500	3,558,315.00	0.07
249	600390	五矿资本	489,840	3,419,083.20	0.07
250	601238	广汽集团	253,100	3,363,699.00	0.07
251	600233	圆通速递	291,848	3,356,252.00	0.07
252	600998	九州通	184,607	3,352,463.12	0.07
253	600482	中国动力	185,800	3,329,536.00	0.07
254	601319	中国人保	504,300	3,313,251.00	0.07
255	002958	青农商行	607,500	3,092,175.00	0.06
256	600848	上海临港	154,100	3,085,082.00	0.06

257	601231	环旭电子	159,200	3,078,928.00	0.06
258	002773	康弘药业	63,728	3,068,503.20	0.06
259	002146	荣盛发展	468,800	3,061,264.00	0.06
260	002414	高德红外	73,300	3,060,275.00	0.06
261	600027	华电国际	886,900	3,015,460.00	0.06
262	002938	鹏鼎控股	60,700	3,014,969.00	0.06
263	600161	天坛生物	72,080	3,005,736.00	0.06
264	600297	广汇汽车	1,045,790	2,990,959.40	0.06
265	300529	健帆生物	43,700	2,963,734.00	0.06
266	601658	邮储银行	616,400	2,946,392.00	0.06
267	000671	阳光城	441,900	2,881,188.00	0.06
268	002558	巨人网络	165,100	2,877,693.00	0.06
269	002916	深南电路	26,400	2,852,784.00	0.06
270	688012	中微公司	17,600	2,773,584.00	0.06
271	002939	长城证券	212,400	2,733,588.00	0.05
272	603658	安图生物	18,800	2,729,384.00	0.05
273	601577	长沙银行	283,400	2,697,968.00	0.05
274	688036	传音控股	17,600	2,677,664.00	0.05
275	000627	天茂集团	542,100	2,640,027.00	0.05
276	002032	苏泊尔	33,402	2,605,021.98	0.05
277	002153	石基信息	81,900	2,546,271.00	0.05
278	600989	宝丰能源	215,400	2,520,180.00	0.05
279	300676	华大基因	19,298	2,480,950.88	0.05
280	600025	华能水电	488,000	2,176,480.00	0.04
281	000723	美锦能源	323,200	2,158,976.00	0.04
282	601808	中海油服	166,500	2,126,205.00	0.04
283	601990	南京证券	165,500	2,030,685.00	0.04
284	601916	浙商银行	489,800	1,998,384.00	0.04
285	601698	中国卫通	106,900	1,939,166.00	0.04
286	601236	红塔证券	101,300	1,883,167.00	0.04
287	600845	宝信软件	26,500	1,827,970.00	0.04
288	603195	公牛集团	8,800	1,806,552.00	0.04
289	603392	万泰生物	8,800	1,773,464.00	0.04
290	688009	中国通号	291,700	1,709,362.00	0.03
291	300888	稳健医疗	10,265	1,605,343.35	0.03
292	000708	中信特钢	72,100	1,571,059.00	0.03
293	600918	中泰证券	83,800	1,550,300.00	0.03
294	600150	中国船舶	77,300	1,367,437.00	0.03
295	601872	招商轮船	227,600	1,285,940.00	0.03
296	603087	甘李药业	8,820	1,166,180.40	0.02
297	601077	渝农商行	253,400	1,140,300.00	0.02
298	688063	派能科技	5,499	1,040,630.76	0.02

299	002945	华林证券	65,800	991,606.00	0.02
300	601696	中银证券	32,100	888,528.00	0.02
301	600299	安迪苏	73,200	842,532.00	0.02
302	688686	奥普特	2,330	397,334.90	0.01
303	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
304	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
305	688678	福立旺	4,198	80,811.50	0.00
306	688551	科威尔	2,211	73,714.74	0.00
307	688156	路德环境	2,602	52,222.14	0.00
308	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
309	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
310	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
311	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
312	300894	火星人	628	23,217.16	0.00
313	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
314	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
315	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
316	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
317	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
318	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
319	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
320	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
321	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
322	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
323	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
324	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
325	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
326	300907	康平科技	473	12,700.05	0.00
327	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
328	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
329	300893	松原股份	276	9,682.08	0.00
330	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
331	300922	天秦装备	287	9,063.46	0.00
332	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
333	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
334	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
335	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
336	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300601	康泰生物	19,788,087.62	0.40
2	601398	工商银行	17,748,051.00	0.36
3	600745	闻泰科技	15,695,993.00	0.31
4	002371	北方华创	14,054,051.00	0.28
5	300014	亿纬锂能	13,902,192.00	0.28
6	002129	中环股份	12,259,499.00	0.25
7	000977	浪潮信息	11,668,156.22	0.23
8	000860	顺鑫农业	9,393,579.00	0.19
9	603658	安图生物	8,802,389.00	0.18
10	002463	沪电股份	8,769,945.49	0.18
11	002352	顺丰控股	8,562,018.00	0.17
12	000066	中国长城	8,264,422.00	0.17
13	603369	今世缘	7,772,356.00	0.16
14	601688	华泰证券	7,686,740.00	0.15
15	601100	恒立液压	7,215,271.41	0.14
16	002157	正邦科技	7,080,765.00	0.14
17	600763	通策医疗	6,868,344.00	0.14
18	000002	万科A	6,225,435.00	0.12
19	002841	视源股份	6,182,100.21	0.12
20	002812	恩捷股份	6,039,707.00	0.12

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000858	五粮液	41,280,109.51	0.83
2	000333	美的集团	33,438,017.61	0.67
3	000651	格力电器	28,168,987.11	0.56
4	002475	立讯精密	22,003,275.32	0.44
5	000661	长春高新	15,993,641.20	0.32
6	000002	万科A	15,819,875.72	0.32
7	300059	东方财富	15,544,228.04	0.31
8	600519	贵州茅台	15,404,266.00	0.31
9	000001	平安银行	14,791,384.78	0.30
10	002415	海康威视	13,970,319.00	0.28

11	601318	中国平安	13,812,585.00	0.28
12	601166	兴业银行	13,094,092.00	0.26
13	002714	牧原股份	11,506,199.80	0.23
14	000568	泸州老窖	11,415,484.85	0.23
15	000725	京东方 A	11,230,155.00	0.22
16	601288	农业银行	10,571,886.00	0.21
17	002594	比亚迪	9,969,195.94	0.20
18	300498	温氏股份	9,652,779.56	0.19
19	002466	天齐锂业	9,015,976.31	0.18
20	000100	TCL 科技	8,860,512.00	0.18

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	548,325,998.94
卖出股票收入（成交）总额	977,789,850.19

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	996,847.70	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	996,847.70	0.02

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113043	财通转债	7,590	895,847.70	0.02
2	113616	韦尔转债	1,010	101,000.00	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	238,105.58
2	应收证券清算款	605,927.27
3	应收股利	-
4	应收利息	15,448.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	859,481.15

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限制的情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
177	20,750,296.05	3,671,545,600.00	99.97	1,256,800.00	0.03

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	友邦保险有限公司江苏分公司 — 传统—普通保险产品	30,226,200.00	0.82
2	中信证券股份有限公司	2,669,600.00	0.07
3	方忱	200,000.00	0.01
4	王新红	115,000.00	—
5	黄庭兰	100,000.00	—
6	卢新英	80,000.00	—
7	姜广君	76,000.00	—
8	黄志强	70,000.00	—
9	骆莉	50,000.00	—
10	王振河	50,000.00	—
11	中国农业银行股份有限公司— 国寿安保沪深 300 交易型开放 式指数证券投资基金联接基	3,638,649,800.00	99.07

注：表中前十名持有人为除国寿安保沪深 300ETF 联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018年1月19日） 基金份额总额	294,802,400.00
本报告期期初基金份额总额	4,728,802,400.00
本报告期基金总申购份额	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,092,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	3,672,802,400.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人未发生重大的人事变动。

2020年8月，中国农业银行总行决定刘琳任托管业务部副总裁。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人于2018年12月28日发布公告，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。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元数量	成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	899,866,115.73	59.71%	838,041.81	59.71%	-
国泰君安	2	488,112,996.23	32.39%	454,581.50	32.39%	-
海通证券	2	119,042,228.65	7.90%	110,864.74	7.90%	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	6,082,318.74	58.80%	-	-	-	-
国泰君安	167,282.24	1.62%	-	-	-	-
海通证券	4,094,304.15	39.58%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保基金管理有限公司关于调整旗下部分 ETF 基金交易结算模式的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 15 日
2	国寿安保沪深 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	2020 年 1 月 15 日
3	国寿安保沪深 300ETF 托管协议	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 15 日
4	国寿安保沪深 300ETF 更新招募说明书（2020 年第 1 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 15 日
5	国寿安保沪深 300ETF 更新招募说明书（摘要）（2020 年第 1 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 15 日
6	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 18 日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下 4 只基金增加扩位证券简称的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 14 日

8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分交易型开放式指数证券投资基金指数许可使用费调整的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年3月18日
9	国寿安保沪深 300ETF 更新招募说明书（摘要）（2020 年第 2 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年3月18日
10	国寿安保沪深 300ETF 更新招募说明书（2020 年第 2 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年3月18日
11	国寿安保沪深 300ETF 场内交易价格波动等风险提示公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年3月20日
12	国寿安保沪深 300ETF 场内交易价格波动的第二次风险提示公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年3月23日
13	国寿安保基金关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年3月25日
14	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年4月22日
15	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2019 年度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年4月30日
16	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 2020 年第 2 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年7月21日
17	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年中期报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年8月29日
18	国寿安保沪深 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	2020年8月31日
19	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 3 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2020年10月28日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20200101~20201231	4,721,750.00	9,001,000.00	1,092,101.30	3,638,649.800.00	99.07

产品特有风险

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

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 13.1.1 中国证监会批准国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 13.1.2 《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- 13.1.3 《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- 13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 13.1.5 报告期内国寿安保沪深 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
- 13.1.6 中国证监会要求的其他文件

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

- 13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅
- 13.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: www.gsfunds.com.cn
- 13.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2021 年 3 月 31 日