

国寿安保中证 500 交易型开放式  
指数证券投资基金  
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 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 2022 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	9
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	10
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
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.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	52
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.....	53

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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53
7.12 投资组合报告附注.....	53
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>54</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>55</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>55</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	55
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.....	55
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	57
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>58</b>
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.....	58
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	58
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>59</b>
12.1 备查文件目录.....	59
12.2 存放地点.....	59
12.3 查阅方式.....	59

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	国寿 500
基金主代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	174,318,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 3 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相近的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	95599
传真	010-50850776	010-68121816
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王军辉	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	321,418.23
本期利润	-32,102,991.40
加权平均基金份额本期利润	-0.1846
本期加权平均净值利润率	-13.15%
本期基金份额净值增长率	-11.40%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-126,450,041.25
期末可供分配基金份额利润	-0.7254
期末基金资产净值	250,022,500.26
期末基金份额净值	1.4343
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-33.59%

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

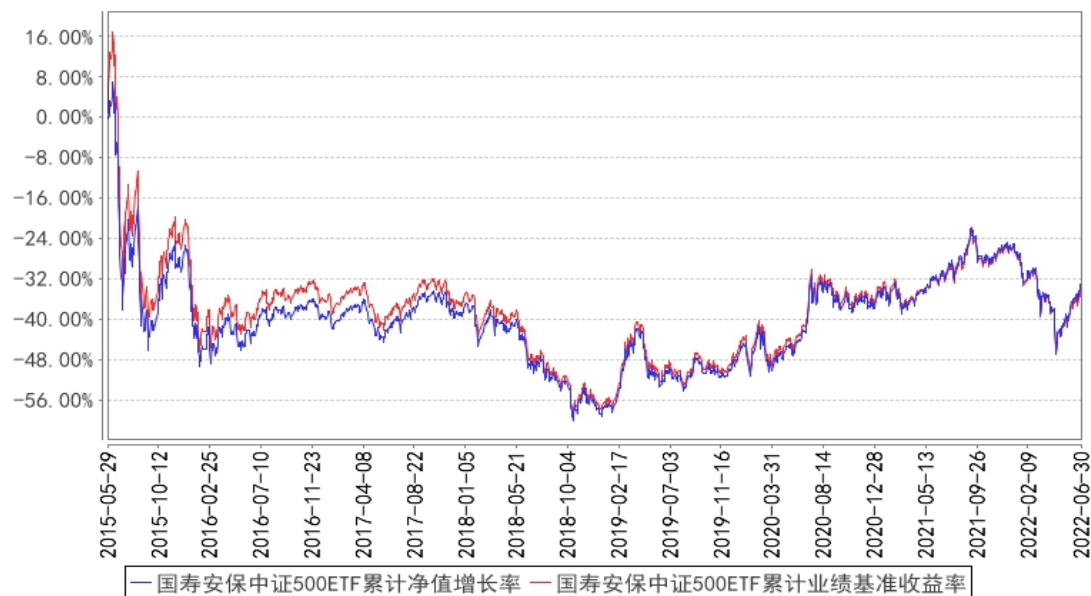
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	7.79%	1.10%	7.10%	1.10%	0.69%	0.00%
过去三个月	3.11%	1.74%	2.04%	1.75%	1.07%	-0.01%
过去六个月	-11.40%	1.62%	-12.30%	1.63%	0.90%	-0.01%
过去一年	-4.34%	1.32%	-5.20%	1.33%	0.86%	-0.01%
过去三年	35.18%	1.34%	30.37%	1.35%	4.81%	-0.01%

自基金合同生效起至今	-33.59%	1.66%	-34.60%	1.69%	1.01%	-0.03%
------------	---------	-------	---------	-------	-------	--------

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

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



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 05 月 29 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 05 月 29 日至 2022 年 06 月 30 日。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 93 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 3219.57 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2387.69 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 日	-	13 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，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、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数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联接基金基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不



存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内股票市场市场先抑后扬，阶段性结构分化和轮动明显，稳增长和科技是较为清晰的投资主线。一季度受欧洲地缘冲突和疫情反复影响整体表现较弱，至四月下旬 A 股触及低点，随着疫情有效控制和稳增长政策推进，投资者情绪和风险偏好修复，市场有所反弹。

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4343 元；本报告期基金份额净值增长率为 -11.40%，业绩比较基准收益率为 -12.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国民经济韧性十足，长期向好的趋势没有发生改变。政策面和宏观流动性将保持对权益资产友好，国内通胀呈现 CPI 整体可控，PPI 逐步回落的趋势。随着经济复苏进程逐步恢复，企业盈利逐步向好，居民收入恢复增长也将带来消费逐步改善，部分低估值细分板块存在配置机会，科技成长板块也有望持续景气向好，整个 A 股的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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人以及各相关投资部门负责人组成，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分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

#### 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，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 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 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	2,953,251.42	2,501,130.01
结算备付金		3,666.94	26,928.75
存出保证金		8,241.71	50,578.62
交易性金融资产	6.4.7.2	247,464,558.17	279,946,083.95
其中：股票投资		247,446,754.81	279,930,083.95
基金投资		-	-
债券投资		17,803.36	16,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	72,464.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	583.02
资产总计		250,429,718.24	282,597,768.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		99,035.31	118,761.17
应付托管费		19,807.06	23,752.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	288,375.61	274,256.17
负债合计		407,217.98	416,769.81
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	376,472,541.51	376,472,541.51
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-126,450,041.25	-94,291,542.96
净资产合计		250,022,500.26	282,180,998.55
负债和净资产总计		250,429,718.24	282,597,768.36

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4343 元，基金份额总额 174,318,687.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-31,221,211.35</b>	<b>56,209,767.75</b>
1. 利息收入		8,090.89	89,908.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,090.89	44,124.43
债券利息收入		-	164.43
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		-	45,619.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,180,056.94	123,837,793.09
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-1,582,606.92	119,935,658.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	23,351.21	121,438.36
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-

股利收益	6.4.7.19	2,739,312.65	3,780,696.34
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-32,424,409.63	-69,031,488.13
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	15,050.45	1,313,554.17
<b>减：二、营业总支出</b>		881,780.05	3,397,049.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	605,269.32	1,755,554.42
2. 托管费	6.4.10.2.2	121,053.94	351,110.88
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.10	164.55
8. 其他费用	6.4.7.23	155,456.69	1,290,219.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-32,102,991.40	52,812,718.70
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-32,102,991.40	52,812,718.70
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-32,102,991.40	52,812,718.70

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	376,472,541.51	-	-94,291,542.96	282,180,998.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	376,472,541.51	-	-94,291,542.96	282,180,998.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-32,158,498.29	-32,158,498.29
（一）、综合收益总额	-	-	-32,102,991.40	-32,102,991.40

(二)、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)	-	-	-55,506.89	-55,506.89
其中: 1.基金申购款	4,319,359.53	-	-1,390,285.19	2,929,074.34
2.基金赎回款	-4,319,359.53	-	1,334,778.30	-2,984,581.23
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	376,472,541.51	-	-126,450,041.25	250,022,500.26
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,270,579,965.54	-	-461,231,437.69	809,348,527.85
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,270,579,965.54	-	-461,231,437.69	809,348,527.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-902,746,143.09	-	348,781,857.52	-553,964,285.57
(一)、综合收益总额	-	-	52,812,718.70	52,812,718.70
(二)、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)	-902,746,143.09	-	295,969,138.82	-606,777,004.27
其中: 1.基金申购款	8,638,719.08	-	-2,787,816.12	5,850,902.96
2.基金赎回款	-911,384,862.17	-	298,756,954.94	-612,627,907.23
(三)、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)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	367,833,822.45	-	-112,449,580.17	255,384,242.28

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：

<u>左季庆</u>	<u>王文英</u>	<u>韩占锋</u>
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 500 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]485 号《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》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《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式,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 665,796,867.00 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(2015)验字第 61090605\_A03 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 05 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 665,869,631.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 72,764.00 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(以下简称“国寿安保”),基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“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 [2015]268 号核准,本基金 308,318,687.00 份基金份额于 2015 年 7 月 3 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《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市

场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在建仓完成后,本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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:标的指数,本基金标的指数为中证 500 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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿中证 500ETF 联接基金”)。国寿中证 500ETF 联接基金为交易型开放式基金,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于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

#### 6.4.2 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<年度报告和中期报告>》、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》、《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中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。

#### 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 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

除金融资产和金融负债的分类、金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认、收入/(损失)的确认和计量外,本报告期内所采用的会计政策、会计估计与



最近一期年度报告相一致。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

#### 6.4.5.1.1 金融资产和金融负债的分类

##### 新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

##### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

##### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

## (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

## (3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (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。

#### 6.4.5.1.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.5.1.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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相

关交易费用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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

#### 6.4.5.1.4 会计政策变更对财务报表的影响

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 2,501,130.01 元、26,928.75 元、50,578.62 元、583.02 元和 72,464.01 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 2,501,672.23 元、26,942.06 元、50,603.59 元、0.00 元和 72,464.01 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 279,946,083.95 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 279,946,086.47 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 118,761.17 元、23,752.21 元、69,256.17 元和 205,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 118,761.17 元、23,752.21 元、69,256.17 元和 205,000.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

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。

#### 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 2022年6月30日
活期存款	2,953,251.42
等于：本金	2,952,727.78
加：应计利息	523.64
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	2,953,251.42

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	248,979,365.22	-	247,446,754.81	-1,532,610.41
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	17,800.00	3.36	17,803.36
	银行间市场	-	-	-
	合计	17,800.00	3.36	17,803.36
资产支持证券	-	-	-	-



基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	248,997,165.22	3.36	247,464,558.17	-1,532,610.41

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于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 债权投资

本基金于本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	84,073.05
其中：交易所市场	84,073.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	134,302.56
应付指数使用费	70,000.00
合计	288,375.61

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,318,687.00	376,472,541.51
本期申购	2,000,000.00	4,319,359.53
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-4,319,359.53
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	174,318,687.00	376,472,541.51

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。

## 6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期无其他综合收益。

## 6.4.7.12 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
本期期初	-70,065,304.80	-24,226,238.16	-94,291,542.96
本期利润	321,418.23	-32,424,409.63	-32,102,991.40
本期基金份额交易产生的变动数	-1,092.45	-54,414.44	-55,506.89
其中：基金申购款	-803,459.67	-586,825.52	-1,390,285.19
基金赎回款	802,367.22	532,411.08	1,334,778.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-69,744,979.02	-56,705,062.23	-126,450,041.25

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
	活期存款利息收入
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	690.04
其他	77.23
合计	8,090.89

## 6.4.7.14 股票投资收益

## 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,621,442.03
股票投资收益——赎回差价收入	38,835.11
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	-1,582,606.92

## 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	45,043,022.04
减：卖出股票成本总额	46,528,078.15
减：交易费用	136,385.92
买卖股票差价收入	-1,621,442.03

## 6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	2,984,581.23
减：现金支付赎回款总额	1,496,020.23
减：赎回股票成本总额	1,449,725.89
减：交易费用	-
赎回差价收入	38,835.11

## 6.4.7.15 债券投资收益

## 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	31.33
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	23,319.88
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	23,351.21

## 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	155,355.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	132,000.00
减：应计利息总额	31.31
减：交易费用	4.66
买卖债券差价收入	23,319.88

## 6.4.7.16 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。

## 6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,739,312.65
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,739,312.65

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
1.交易性金融资产	-32,424,409.63
股票投资	-32,424,409.63
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	-32,424,409.63

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	15,050.45
合计	15,050.45

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,153.56
指数使用费	70,000.00
存托服务费	0.57
合计	155,456.69

#### 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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 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	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东

安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“国寿安保中证 500ETF 联接基金”）	本基金的联接基金

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。

#### 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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	605,269.32	1,755,554.42
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	121,053.94	351,110.88

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 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

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固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 2022年6月30日		上年度末 2021年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例（%）
国寿安保中证 500ETF 联接基 金	171,436,286.00	98.35	170,286,286.00	97.69

#### 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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,953,251.42	7,323.62	3,876,565.94	39,752.76

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2022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

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
127064	杭氧转债	2022年5月19日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.02	178	17,800.00	17,803.36	-

##### 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
002670	国盛金控	2022年6月1日	重大事项停牌	9.60	2022年7月14日	9.99	46,436	521,909.45	445,785.60	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金于本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了以董事会风险管理委员会为核心的，由董事会风险管理委员



会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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的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。

#### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

#### 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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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在基金运作过程中严格按照相关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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。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上述比例限制)。

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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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。

#### 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 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	2,953,251.42	-	-	-	2,953,251.42
结算备付金	3,666.94	-	-	-	3,666.94
存出保证金	8,241.71	-	-	-	8,241.71
交易性金融资产	-	-	17,803.36	247,446,754.81	247,464,558.17
资产总计	2,965,160.07	-	17,803.36	247,446,754.81	250,429,718.24
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	99,035.31	99,035.31
应付托管费	-	-	-	19,807.06	19,807.06
其他负债	-	-	-	288,375.61	288,375.61
负债总计	-	-	-	407,217.98	407,217.98
利率敏感度缺口	2,965,160.07	-	17,803.36	247,039,536.83	250,022,500.26
上年度末 2021 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	2,501,130.01	-	-	-	2,501,130.01
结算备付金	26,928.75	-	-	-	26,928.75
存出保证金	50,578.62	-	-	-	50,578.62
交易性金融资产	-	-	16,000.00	279,930,083.95	279,946,083.95
应收利息	-	-	-	583.02	583.02
应收证券清算款	-	-	-	72,464.01	72,464.01
资产总计	2,578,637.38	-	16,000.00	280,003,130.98	282,597,768.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	118,761.17	118,761.17
应付托管费	-	-	-	23,752.21	23,752.21
应付交易费用	-	-	-	69,256.17	69,256.17
应交税费	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	205,000.00	205,000.00
负债总计	-	-	-	416,769.81	416,769.81
利率敏感度缺口	2,578,637.38	-	16,000.00	279,586,361.17	282,180,998.55

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价

值占基金资产净值的比例为 0.0071%(2021 年 12 月 31 日: 0.0057%), 因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日: 同)。

#### 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。

#### 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或银行间同业市场交易的股票和债券, 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。

基金管理人通过对宏观经济和资本市场的深入分析, 采用主动的投资管理策略, 把握不同时期各金融市场的收益水平, 在约定的投资比例下, 合理配置股票、债券、货币市场工具等各类资产, 在严格控制下行风险的前提下, 力争实现基金资产的长期稳定增值。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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, 包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险, 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 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	247,446,754.81	98.97	279,930,083.95	99.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	17,803.36	0.01	16,000.00	0.01
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	247,464,558.17	98.98	279,946,083.95	99.21

#### 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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
分析	+5%	12,501,125.01	13,967,959.43
	-5%	-12,501,125.01	-13,967,959.43

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	247,000,969.21	279,375,927.51
第二层次	463,588.96	560,652.49
第三层次	-	9,503.95
合计	247,464,558.17	279,946,083.95

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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，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、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 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(2021 年 12 月 31 日：同)。

##### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 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	247,446,754.81	98.81
	其中：股票	247,446,754.81	98.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,803.36	0.01
	其中：债券	17,803.36	0.01
	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	2,956,918.36	1.18
8	其他各项资产	8,241.71	0.00
9	合计	250,429,718.24	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	2,261,061.60	0.90
B	采矿业	10,952,241.22	4.38
C	制造业	147,263,778.43	58.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,609,076.40	3.04
E	建筑业	3,189,613.86	1.28
F	批发和零售业	9,524,784.20	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	6,571,802.73	2.63
H	住宿和餐饮业	521,296.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,303,222.92	7.32
J	金融业	21,848,322.72	8.74
K	房地产业	5,829,670.90	2.33
L	租赁和商务服务业	3,008,926.00	1.20
M	科学研究和技术服务业	3,078,759.00	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	1,794,508.63	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	577,838.00	0.23

R	文化、体育和娱乐业	3,301,952.00	1.32
S	综合	1,809,900.20	0.72
	合计	247,446,754.81	98.97

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600522	中天科技	102,200	2,360,820.00	0.94
2	601615	明阳智能	63,000	2,129,400.00	0.85
3	600256	广汇能源	171,900	1,811,826.00	0.72
4	300769	德方纳米	4,200	1,716,456.00	0.69
5	600096	云天化	48,100	1,514,188.00	0.61
6	300012	华测检测	62,900	1,459,909.00	0.58
7	002497	雅化集团	43,100	1,407,215.00	0.56
8	002407	多氟多	28,700	1,403,717.00	0.56
9	002240	盛新锂能	22,700	1,370,172.00	0.55
10	300390	天华超净	15,400	1,345,960.00	0.54
11	002180	纳思达	26,500	1,341,430.00	0.54
12	600157	永泰能源	831,400	1,321,926.00	0.53
13	600885	宏发股份	31,276	1,308,900.60	0.52
14	000009	中国宝安	96,580	1,302,864.20	0.52
15	600141	兴发集团	29,080	1,279,229.20	0.51
16	300073	当升科技	13,300	1,201,522.00	0.48
17	600392	盛和资源	52,395	1,184,127.00	0.47
18	002384	东山精密	51,200	1,174,016.00	0.47
19	002756	永兴材料	7,600	1,156,796.00	0.46
20	603613	国联股份	13,020	1,153,572.00	0.46
21	600418	江淮汽车	65,400	1,122,264.00	0.45
22	300285	国瓷材料	30,000	1,077,600.00	0.43
23	600765	中航重机	33,080	1,064,514.40	0.43
24	600399	抚顺特钢	59,000	1,056,100.00	0.42
25	600233	圆通速递	51,400	1,048,046.00	0.42
26	600563	法拉电子	5,100	1,046,316.00	0.42
27	601555	东吴证券	149,930	1,039,014.90	0.42
28	601058	赛轮轮胎	91,600	1,032,332.00	0.41
29	600487	亨通光电	70,700	1,027,978.00	0.41
30	300037	新宙邦	19,500	1,024,920.00	0.41
31	000983	山西焦煤	76,520	1,024,602.80	0.41
32	600499	科达制造	49,500	1,021,680.00	0.41

33	600732	爱旭股份	30,500	1,007,110.00	0.40
34	603077	和邦生物	231,260	985,167.60	0.39
35	688180	君实生物	12,947	975,426.98	0.39
36	002385	大北农	123,900	967,659.00	0.39
37	603456	九洲药业	18,700	966,790.00	0.39
38	688122	西部超导	10,400	958,880.00	0.38
39	002013	中航机电	77,500	957,125.00	0.38
40	601108	财通证券	121,500	956,205.00	0.38
41	002268	卫士通	22,200	952,602.00	0.38
42	300363	博腾股份	12,200	951,478.00	0.38
43	688099	晶晨股份	9,200	929,200.00	0.37
44	603345	安井食品	5,500	923,285.00	0.37
45	600486	扬农化工	6,920	922,297.60	0.37
46	600298	安琪酵母	18,700	911,625.00	0.36
47	000519	中兵红箭	31,262	911,287.30	0.36
48	300144	宋城演艺	58,600	899,510.00	0.36
49	000630	铜陵有色	275,600	898,456.00	0.36
50	600862	中航高科	31,200	876,720.00	0.35
51	603605	珀莱雅	5,300	875,454.00	0.35
52	000988	华工科技	37,700	873,509.00	0.35
53	002353	杰瑞股份	21,500	866,450.00	0.35
54	000783	长江证券	144,700	858,071.00	0.34
55	601077	渝农商行	231,700	857,290.00	0.34
56	601168	西部矿业	71,366	844,259.78	0.34
57	002625	光启技术	48,400	835,868.00	0.33
58	601696	中银证券	62,400	829,920.00	0.33
59	300146	汤臣倍健	38,100	824,865.00	0.33
60	601162	天风证券	259,000	823,620.00	0.33
61	688777	中控技术	11,200	814,912.00	0.33
62	002028	思源电气	22,820	813,761.20	0.33
63	300724	捷佳伟创	9,100	813,085.00	0.33
64	002056	横店东磁	30,400	809,248.00	0.32
65	002797	第一创业	125,900	807,019.00	0.32
66	002507	涪陵榨菜	23,200	800,864.00	0.32
67	603517	绝味食品	13,800	797,916.00	0.32
68	600988	赤峰黄金	49,800	794,310.00	0.32
69	603589	口子窖	13,500	791,235.00	0.32
70	000932	华菱钢铁	154,980	788,848.20	0.32
71	002185	华天科技	83,900	786,982.00	0.31
72	601128	常熟银行	102,500	783,100.00	0.31
73	603026	石大胜华	5,300	770,355.00	0.31
74	601636	旗滨集团	60,300	768,825.00	0.31



75	600521	华海药业	33,600	762,720.00	0.31
76	002603	以岭药业	31,200	758,160.00	0.30
77	600039	四川路桥	71,962	757,759.86	0.30
78	605117	德业股份	2,700	755,703.00	0.30
79	002326	永太科技	22,900	754,097.00	0.30
80	601607	上海医药	41,600	752,128.00	0.30
81	600109	国金证券	83,500	751,500.00	0.30
82	000830	鲁西化工	43,100	745,199.00	0.30
83	002078	太阳纸业	60,400	743,524.00	0.30
84	600153	建发股份	55,800	729,306.00	0.29
85	002624	完美世界	50,700	728,559.00	0.29
86	600546	山煤国际	37,000	720,020.00	0.29
87	603939	益丰药房	13,500	713,205.00	0.29
88	688390	固德威	2,240	701,142.40	0.28
89	002422	科伦药业	37,400	699,380.00	0.28
90	601872	招商轮船	121,400	699,264.00	0.28
91	603267	鸿远电子	5,200	698,516.00	0.28
92	600348	华阳股份	44,900	694,154.00	0.28
93	600705	中航产融	200,000	692,000.00	0.28
94	600497	驰宏锌锗	133,200	691,308.00	0.28
95	000738	航发控制	24,600	691,260.00	0.28
96	601990	南京证券	82,800	690,552.00	0.28
97	600177	雅戈尔	103,800	688,194.00	0.28
98	600549	厦门钨业	31,800	687,516.00	0.27
99	000831	五矿稀土	22,000	687,500.00	0.27
100	600875	东方电气	41,600	684,320.00	0.27
101	000970	中科三环	36,425	684,061.50	0.27
102	300699	光威复材	11,600	682,892.00	0.27
103	603127	昭衍新药	6,000	682,800.00	0.27
104	300088	长信科技	92,000	682,640.00	0.27
105	300676	华大基因	9,300	666,810.00	0.27
106	000999	华润三九	14,800	666,000.00	0.27
107	600160	巨化股份	50,520	664,338.00	0.27
108	600859	王府井	25,375	659,242.50	0.26
109	000998	隆平高科	39,500	658,070.00	0.26
110	002138	顺络电子	24,100	656,725.00	0.26
111	002673	西部证券	100,200	655,308.00	0.26
112	002572	索菲亚	23,800	654,500.00	0.26
113	601699	潞安环能	44,700	653,514.00	0.26
114	600516	方大炭素	85,400	649,040.00	0.26
115	002557	洽洽食品	11,400	649,002.00	0.26
116	600143	金发科技	67,500	642,600.00	0.26

117	000807	云铝股份	65,000	642,200.00	0.26
118	002508	老板电器	17,700	637,731.00	0.26
119	601997	贵阳银行	109,400	635,614.00	0.25
120	600482	中国动力	40,400	634,684.00	0.25
121	000039	中集集团	45,822	634,634.70	0.25
122	002030	达安基因	36,744	631,629.36	0.25
123	002273	水晶光电	52,029	630,071.19	0.25
124	000960	锡业股份	37,500	628,875.00	0.25
125	002465	海格通信	69,000	627,210.00	0.25
126	603444	吉比特	1,600	620,800.00	0.25
127	300357	我武生物	11,800	613,954.00	0.25
128	000629	攀钢钒钛	161,000	611,800.00	0.24
129	000728	国元证券	98,000	609,560.00	0.24
130	300058	蓝色光标	93,300	609,249.00	0.24
131	300136	信维通信	36,100	608,285.00	0.24
132	000975	银泰黄金	62,272	606,529.28	0.24
133	600170	上海建工	200,000	606,000.00	0.24
134	600536	中国软件	14,770	599,514.30	0.24
135	600704	物产中大	116,800	599,184.00	0.24
136	002092	中泰化学	77,102	598,311.52	0.24
137	601577	长沙银行	75,200	596,336.00	0.24
138	002409	雅克科技	10,700	593,957.00	0.24
139	002294	信立泰	20,900	587,290.00	0.23
140	600079	人福医药	36,700	587,200.00	0.23
141	603198	迎驾贡酒	9,000	586,260.00	0.23
142	600739	辽宁成大	40,000	583,200.00	0.23
143	300474	景嘉微	8,500	581,315.00	0.23
144	300244	迪安诊断	18,580	577,838.00	0.23
145	002223	鱼跃医疗	22,450	576,067.00	0.23
146	000547	航天发展	48,000	573,120.00	0.23
147	300418	昆仑万维	35,800	572,800.00	0.23
148	600415	小商品城	102,800	572,596.00	0.23
149	002372	伟星新材	23,800	572,152.00	0.23
150	002506	协鑫集成	153,500	571,020.00	0.23
151	002739	万达电影	41,800	570,570.00	0.23
152	000636	风华高科	30,300	569,337.00	0.23
153	300558	贝达药业	9,300	565,440.00	0.23
154	300253	卫宁健康	64,200	563,676.00	0.23
155	600699	均胜电子	35,860	563,360.60	0.23
156	600372	中航电子	28,900	560,371.00	0.22
157	300308	中际旭创	17,900	555,795.00	0.22
158	300296	利亚德	76,000	554,800.00	0.22

159	600637	东方明珠	76,500	546,975.00	0.22
160	002439	启明星辰	27,400	546,082.00	0.22
161	002683	广东宏大	19,600	545,468.00	0.22
162	600867	通化东宝	52,600	543,884.00	0.22
163	600315	上海家化	12,700	542,925.00	0.22
164	600985	淮北矿业	37,100	540,176.00	0.22
165	601016	节能风电	112,500	540,000.00	0.22
166	601198	东兴证券	60,500	538,450.00	0.22
167	600236	桂冠电力	88,400	538,356.00	0.22
168	000887	中鼎股份	29,500	538,080.00	0.22
169	600026	中远海能	51,959	536,736.47	0.21
170	002156	通富微电	34,800	535,920.00	0.21
171	002299	圣农发展	27,900	535,122.00	0.21
172	600171	上海贝岭	21,300	533,139.00	0.21
173	300832	新产业	11,800	532,298.00	0.21
174	002065	东华软件	83,900	530,248.00	0.21
175	600380	健康元	42,796	528,530.60	0.21
176	600879	航天电子	81,200	526,988.00	0.21
177	600642	申能股份	92,000	522,560.00	0.21
178	600258	首旅酒店	21,020	521,296.00	0.21
179	300026	红日药业	67,600	520,520.00	0.21
180	000750	国海证券	142,620	517,710.60	0.21
181	688185	康希诺	2,600	517,608.00	0.21
182	002936	郑州银行	192,276	517,222.44	0.21
183	002408	齐翔腾达	63,693	516,550.23	0.21
184	000623	吉林敖东	34,800	513,648.00	0.21
185	002203	海亮股份	44,200	510,510.00	0.20
186	000729	燕京啤酒	52,700	509,082.00	0.20
187	000513	丽珠集团	14,053	508,859.13	0.20
188	000400	许继电气	26,500	508,800.00	0.20
189	600673	东阳光	56,400	507,036.00	0.20
190	000878	云南铜业	44,500	506,855.00	0.20
191	600820	隧道股份	82,500	504,900.00	0.20
192	600529	山东药玻	17,800	497,510.00	0.20
193	601717	郑煤机	34,500	497,145.00	0.20
194	600801	华新水泥	25,472	496,958.72	0.20
195	600580	卧龙电驱	34,400	496,048.00	0.20
196	600038	中直股份	10,969	495,798.80	0.20
197	600369	西南证券	124,000	492,280.00	0.20
198	300017	网宿科技	91,500	490,440.00	0.20
199	002131	利欧股份	252,609	490,061.46	0.20
200	603568	伟明环保	14,679	489,838.23	0.20

201	300383	光环新网	47,000	489,740.00	0.20
202	002183	怡亚通	67,900	489,559.00	0.20
203	600166	福田汽车	172,400	487,892.00	0.20
204	600316	洪都航空	16,100	486,864.00	0.19
205	600848	上海临港	35,800	485,448.00	0.19
206	002444	巨星科技	25,700	484,188.00	0.19
207	688256	寒武纪	7,473	483,503.10	0.19
208	002958	青农商行	145,200	482,064.00	0.19
209	002195	二三四五	214,085	481,691.25	0.19
210	600027	华电国际	122,300	480,639.00	0.19
211	600325	华发股份	63,470	480,467.90	0.19
212	600909	华安证券	105,590	480,434.50	0.19
213	601005	重庆钢铁	250,700	478,837.00	0.19
214	600008	首创环保	164,820	477,978.00	0.19
215	300001	特锐德	27,300	472,563.00	0.19
216	300618	寒锐钴业	8,100	469,152.00	0.19
217	300024	机器人	46,500	468,720.00	0.19
218	000825	太钢不锈	85,300	464,885.00	0.19
219	002500	山西证券	80,590	462,586.60	0.19
220	002926	华西证券	59,000	462,560.00	0.19
221	002373	千方科技	41,500	461,480.00	0.18
222	603218	日月股份	18,100	459,740.00	0.18
223	002430	杭氧股份	14,700	459,522.00	0.18
224	688521	芯原股份	9,300	459,420.00	0.18
225	000050	深天马 A	46,000	458,620.00	0.18
226	000027	深圳能源	71,120	455,879.20	0.18
227	000739	普洛药业	22,000	454,080.00	0.18
228	600271	航天信息	41,500	454,010.00	0.18
229	002250	联化科技	27,700	453,449.00	0.18
230	002212	天融信	44,300	449,645.00	0.18
231	600863	内蒙华电	122,300	446,395.00	0.18
232	601866	中远海发	148,600	445,800.00	0.18
233	002670	国盛金控	46,436	445,785.60	0.18
234	600208	新湖中宝	161,100	444,636.00	0.18
235	603233	大参林	14,180	443,834.00	0.18
236	600118	中国卫星	22,100	443,768.00	0.18
237	688009	中国通号	96,800	438,504.00	0.18
238	300677	英科医疗	17,220	436,699.20	0.17
239	000060	中金岭南	97,800	436,188.00	0.17
240	002985	北摩高科	7,443	436,010.94	0.17
241	002249	大洋电机	70,800	434,712.00	0.17
242	300009	安科生物	42,932	434,042.52	0.17

243	601992	金隅集团	155,900	431,843.00	0.17
244	603156	养元饮品	19,000	431,680.00	0.17
245	000778	新兴铸管	89,500	431,390.00	0.17
246	600066	宇通客车	49,800	430,770.00	0.17
247	603658	安图生物	8,800	430,232.00	0.17
248	002152	广电运通	46,400	430,128.00	0.17
249	300182	捷成股份	77,200	424,600.00	0.17
250	300070	碧水源	81,300	423,573.00	0.17
251	603858	步长制药	21,400	421,794.00	0.17
252	300168	万达信息	44,412	419,249.28	0.17
253	600998	九州通	35,100	418,041.00	0.17
254	000401	冀东水泥	39,700	417,644.00	0.17
255	002966	苏州银行	68,460	417,606.00	0.17
256	300251	光线传媒	44,000	416,680.00	0.17
257	002191	劲嘉股份	38,600	413,792.00	0.17
258	600056	中国医药	27,860	412,885.20	0.17
259	002128	电投能源	28,740	411,556.80	0.16
260	002831	裕同科技	13,920	411,336.00	0.16
261	600390	五矿资本	84,100	411,249.00	0.16
262	600970	中材国际	42,300	409,887.00	0.16
263	000997	新大陆	30,919	408,439.99	0.16
264	000021	深科技	35,000	407,400.00	0.16
265	600667	太极实业	55,200	407,376.00	0.16
266	300482	万孚生物	9,990	406,692.90	0.16
267	002505	鹏都农牧	119,370	404,664.30	0.16
268	002244	滨江集团	46,700	403,955.00	0.16
269	600528	中铁工业	49,947	402,073.35	0.16
270	600021	上海电力	39,200	401,800.00	0.16
271	002221	东华能源	43,100	401,261.00	0.16
272	600062	华润双鹤	15,632	401,117.12	0.16
273	000656	金科股份	140,000	400,400.00	0.16
274	600839	四川长虹	138,000	397,440.00	0.16
275	688002	睿创微纳	10,000	397,200.00	0.16
276	000987	越秀金控	56,430	396,702.90	0.16
277	600297	广汇汽车	151,900	396,459.00	0.16
278	600827	百联股份	30,000	396,300.00	0.16
279	002396	星网锐捷	17,500	396,200.00	0.16
280	603885	吉祥航空	22,000	395,780.00	0.16
281	603707	健友股份	14,020	395,364.00	0.16
282	002127	南极电商	73,400	391,956.00	0.16
283	600598	北大荒	26,500	391,140.00	0.16
284	002019	亿帆医药	27,600	385,848.00	0.15

285	600155	华创阳安	45,500	385,840.00	0.15
286	600201	生物股份	42,114	385,764.24	0.15
287	600498	烽火通信	26,600	385,168.00	0.15
288	002266	浙富控股	80,380	385,020.20	0.15
289	002155	湖南黄金	31,504	382,458.56	0.15
290	600259	广晟有色	7,500	379,875.00	0.15
291	000012	南玻 A	51,175	379,718.50	0.15
292	600409	三友化工	46,200	378,378.00	0.15
293	000930	中粮科技	41,800	377,872.00	0.15
294	600511	国药股份	14,100	377,598.00	0.15
295	000883	湖北能源	73,700	376,607.00	0.15
296	002153	石基信息	23,600	374,532.00	0.15
297	600718	东软集团	32,500	374,075.00	0.15
298	600755	厦门国贸	49,500	371,250.00	0.15
299	002124	天邦食品	55,180	370,809.60	0.15
300	688188	柏楚电子	1,680	369,667.20	0.15
301	002511	中顺洁柔	29,400	368,088.00	0.15
302	000686	东北证券	52,500	366,975.00	0.15
303	600060	海信视像	29,300	366,250.00	0.15
304	600959	江苏有线	111,900	364,794.00	0.15
305	603712	七一二	11,500	362,250.00	0.14
306	600282	南钢股份	114,900	361,935.00	0.14
307	000581	威孚高科	18,800	361,900.00	0.14
308	600782	新钢股份	71,800	361,872.00	0.14
309	600566	济川药业	13,300	361,228.00	0.14
310	600895	张江高科	29,000	361,050.00	0.14
311	601880	辽港股份	211,840	360,128.00	0.14
312	000709	河钢股份	159,000	359,340.00	0.14
313	601179	中国西电	76,700	358,956.00	0.14
314	600064	南京高科	32,420	356,620.00	0.14
315	000690	宝新能源	81,400	356,532.00	0.14
316	600022	山东钢铁	204,870	356,473.80	0.14
317	600535	天士力	33,800	355,238.00	0.14
318	002939	长城证券	34,800	353,568.00	0.14
319	300376	易事特	43,400	352,408.00	0.14
320	601778	晶科科技	65,000	351,000.00	0.14
321	002701	奥瑞金	67,180	349,336.00	0.14
322	002002	鸿达兴业	93,408	346,543.68	0.14
323	600216	浙江医药	25,300	345,345.00	0.14
324	300630	普利制药	9,813	344,926.95	0.14
325	600500	中化国际	51,820	344,603.00	0.14
326	600037	歌华有线	36,500	342,735.00	0.14

327	600808	马钢股份	90,236	341,994.44	0.14
328	000598	兴蓉环境	66,900	341,859.00	0.14
329	600728	佳都科技	52,800	341,088.00	0.14
330	002468	申通快递	28,600	340,912.00	0.14
331	002532	天山铝业	52,100	340,213.00	0.14
332	600663	陆家嘴	32,800	339,808.00	0.14
333	002595	豪迈科技	15,000	335,100.00	0.13
334	600567	山鹰国际	120,600	334,062.00	0.13
335	600517	国网英大	64,200	333,198.00	0.13
336	688208	道通科技	10,105	332,656.60	0.13
337	603225	新凤鸣	28,640	330,505.60	0.13
338	002004	华邦健康	59,150	330,057.00	0.13
339	300463	迈克生物	16,100	329,889.00	0.13
340	603866	桃李面包	19,863	328,732.65	0.13
341	601456	国联证券	26,700	327,609.00	0.13
342	000785	居然之家	73,500	327,075.00	0.13
343	002429	兆驰股份	84,900	326,016.00	0.13
344	600597	光明乳业	25,802	325,879.26	0.13
345	300115	长盈精密	31,556	325,342.36	0.13
346	688289	圣湘生物	10,955	324,377.55	0.13
347	002745	木林森	33,200	324,364.00	0.13
348	601958	金钼股份	36,300	320,892.00	0.13
349	300888	稳健医疗	4,800	319,200.00	0.13
350	300166	东方国信	34,478	317,887.16	0.13
351	002390	信邦制药	45,700	315,787.00	0.13
352	688006	杭可科技	4,499	315,199.94	0.13
353	601106	中国一重	102,600	314,982.00	0.13
354	601860	紫金银行	109,300	313,691.00	0.13
355	603927	中科软	13,400	312,488.00	0.12
356	300072	海新能科	61,500	311,190.00	0.12
357	600572	康恩贝	69,854	309,453.22	0.12
358	600398	海澜之家	64,800	307,800.00	0.12
359	601118	海南橡胶	64,000	305,920.00	0.12
360	601718	际华集团	98,400	305,040.00	0.12
361	600507	方大特钢	43,496	304,037.04	0.12
362	000540	中天金融	157,000	303,010.00	0.12
363	600737	中粮糖业	39,900	300,048.00	0.12
364	000089	深圳机场	38,500	297,220.00	0.12
365	603883	老百姓	8,740	296,111.20	0.12
366	600582	天地科技	61,800	295,404.00	0.12
367	002010	传化智联	45,900	295,137.00	0.12
368	000937	冀中能源	39,500	294,670.00	0.12

369	000559	万向钱潮	49,400	293,436.00	0.12
370	002048	宁波华翔	18,200	291,564.00	0.12
371	002368	太极股份	15,158	291,185.18	0.12
372	600967	内蒙一机	31,797	289,988.64	0.12
373	000898	鞍钢股份	89,700	288,834.00	0.12
374	600435	北方导航	33,500	288,770.00	0.12
375	600871	石化油服	152,100	287,469.00	0.11
376	002690	美亚光电	13,240	287,043.20	0.11
377	601000	唐山港	110,946	286,240.68	0.11
378	001914	招商积余	15,800	283,926.00	0.11
379	601568	北元集团	44,470	281,939.80	0.11
380	600195	中牧股份	22,900	280,754.00	0.11
381	002110	三钢闽光	45,750	278,617.50	0.11
382	000959	首钢股份	58,500	278,460.00	0.11
383	002281	光迅科技	15,800	277,764.00	0.11
384	002233	塔牌集团	31,320	277,182.00	0.11
385	601333	广深铁路	126,500	275,770.00	0.11
386	000156	华数传媒	34,600	275,762.00	0.11
387	600556	天下秀	33,300	274,059.00	0.11
388	002705	新宝股份	12,400	272,676.00	0.11
389	000537	广宇发展	20,800	270,192.00	0.11
390	600811	东方集团	95,430	270,066.90	0.11
391	688321	微芯生物	10,700	269,533.00	0.11
392	003035	南网能源	42,400	269,240.00	0.11
393	600764	中国海防	10,600	267,544.00	0.11
394	002174	游族网络	27,300	266,721.00	0.11
395	000402	金融街	44,700	265,965.00	0.11
396	600329	达仁堂	10,800	265,464.00	0.11
397	300212	易华录	15,040	261,696.00	0.10
398	600120	浙江东方	64,698	259,438.98	0.10
399	000488	晨鸣纸业	45,950	259,158.00	0.10
400	603638	艾迪精密	12,620	258,710.00	0.10
401	002416	爱施德	27,780	258,354.00	0.10
402	600126	杭钢股份	50,330	257,689.60	0.10
403	600446	金证股份	24,700	256,386.00	0.10
404	000990	诚志股份	23,400	256,230.00	0.10
405	601200	上海环境	25,170	255,727.20	0.10
406	600167	联美控股	34,080	255,259.20	0.10
407	601098	中南传媒	27,000	254,880.00	0.10
408	600373	中文传媒	25,500	254,745.00	0.10
409	002867	周大生	16,400	254,692.00	0.10
410	002081	金螳螂	50,100	254,508.00	0.10



411	000685	中山公用	33,100	254,208.00	0.10
412	002925	盈趣科技	11,720	252,214.40	0.10
413	002382	蓝帆医疗	26,400	252,120.00	0.10
414	600707	彩虹股份	53,700	251,316.00	0.10
415	000158	常山北明	41,770	250,620.00	0.10
416	601611	中国核建	29,700	249,183.00	0.10
417	002146	荣盛发展	81,400	246,642.00	0.10
418	001965	招商公路	32,300	246,449.00	0.10
419	600095	湘财股份	32,000	246,080.00	0.10
420	601608	中信重工	64,900	245,971.00	0.10
421	002399	海普瑞	13,900	244,362.00	0.10
422	603317	天味食品	8,564	243,817.08	0.10
423	688029	南微医学	2,793	243,549.60	0.10
424	002387	维信诺	36,100	242,592.00	0.10
425	600131	国网信通	17,900	240,755.00	0.10
426	000967	盈峰环境	47,500	240,350.00	0.10
427	688088	虹软科技	7,600	240,084.00	0.10
428	002948	青岛银行	66,310	240,042.20	0.10
429	000528	柳工	36,599	238,259.49	0.10
430	600376	首开股份	48,400	237,644.00	0.10
431	601187	厦门银行	39,600	236,016.00	0.09
432	600623	华谊集团	28,400	235,720.00	0.09
433	603000	人民网	20,700	231,840.00	0.09
434	002423	中粮资本	34,500	231,495.00	0.09
435	000563	陕国投 A	73,900	230,568.00	0.09
436	600901	江苏租赁	44,700	229,311.00	0.09
437	601598	中国外运	59,000	228,920.00	0.09
438	600006	东风汽车	30,000	226,500.00	0.09
439	600307	酒钢宏兴	116,700	226,398.00	0.09
440	601991	大唐发电	92,400	224,532.00	0.09
441	603228	景旺电子	9,568	223,221.44	0.09
442	300257	开山股份	14,900	222,904.00	0.09
443	000961	中南建设	71,800	218,990.00	0.09
444	600906	财达证券	24,300	218,457.00	0.09
445	603650	彤程新材	6,700	218,286.00	0.09
446	600717	天津港	53,858	215,970.58	0.09
447	002242	九阳股份	11,526	211,617.36	0.08
448	002434	万里扬	24,600	210,330.00	0.08
449	000718	苏宁环球	57,100	210,128.00	0.08
450	601928	凤凰传媒	28,700	205,205.00	0.08
451	000671	阳光城	93,300	204,327.00	0.08
452	000415	渤海租赁	92,600	200,942.00	0.08

453	000553	安道麦 A	16,300	197,393.00	0.08
454	601969	海南矿业	22,900	196,711.00	0.08
455	600968	海油发展	76,100	196,338.00	0.08
456	000031	大悦城	47,900	191,600.00	0.08
457	600648	外高桥	13,900	189,040.00	0.08
458	600787	中储股份	32,700	186,063.00	0.07
459	600928	西安银行	50,100	183,867.00	0.07
460	600339	中油工程	62,700	181,203.00	0.07
461	002563	森马服饰	30,300	179,376.00	0.07
462	300869	康泰医学	6,000	169,560.00	0.07
463	601228	广州港	46,100	169,187.00	0.07
464	002815	崇达技术	13,100	167,811.00	0.07
465	000028	国药一致	5,600	166,824.00	0.07
466	600835	上海机电	12,000	164,760.00	0.07
467	688819	天能股份	4,700	162,526.00	0.07
468	600377	宁沪高速	18,600	159,402.00	0.06
469	000717	韶钢松山	45,200	158,200.00	0.06
470	002945	华林证券	10,100	154,025.00	0.06
471	603056	德邦股份	11,400	153,102.00	0.06
472	603379	三美股份	6,840	152,190.00	0.06
473	000869	张裕 A	5,100	151,674.00	0.06
474	601139	深圳燃气	21,700	150,598.00	0.06
475	000062	深圳华强	11,810	149,987.00	0.06
476	600299	安迪苏	15,100	144,658.00	0.06
477	601298	青岛港	26,100	142,767.00	0.06
478	601869	长飞光纤	4,600	142,232.00	0.06
479	603868	飞科电器	1,800	136,350.00	0.05
480	001872	招商港口	8,400	131,040.00	0.05
481	601156	东航物流	6,600	130,680.00	0.05
482	002653	海思科	8,100	130,491.00	0.05
483	300741	华宝股份	4,600	127,972.00	0.05
484	600823	世茂股份	41,900	124,862.00	0.05
485	601828	美凯龙	20,200	122,412.00	0.05
486	600350	山东高速	23,300	122,325.00	0.05
487	600927	永安期货	6,000	121,020.00	0.05
488	001227	兰州银行	23,400	115,128.00	0.05
489	603355	莱克电气	4,260	107,479.80	0.04
490	603786	科博达	1,700	104,669.00	0.04
491	603515	欧普照明	5,620	98,069.00	0.04
492	001203	大中矿业	8,400	94,920.00	0.04
493	601665	齐鲁银行	18,900	92,232.00	0.04
494	603719	良品铺子	3,000	85,890.00	0.03

495	002946	新乳业	6,400	83,136.00	0.03
496	601003	柳钢股份	18,900	76,545.00	0.03
497	002901	大博医疗	1,700	66,538.00	0.03
498	600956	新天绿能	5,300	65,296.00	0.03
499	603983	丸美股份	2,000	53,600.00	0.02
500	600917	重庆燃气	6,600	47,652.00	0.02
501	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.01
502	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300769	德方纳米	1,527,769.00	0.54
2	600096	云天化	1,527,427.00	0.54
3	300012	华测检测	1,398,761.00	0.50
4	002497	雅化集团	1,383,396.00	0.49
5	002240	盛新锂能	1,348,443.00	0.48
6	300390	天华超净	1,168,907.00	0.41
7	002407	多氟多	1,151,887.00	0.41
8	688180	君实生物	1,104,414.73	0.39
9	300073	当升科技	1,065,943.00	0.38
10	002756	永兴材料	1,032,839.00	0.37
11	601058	赛轮轮胎	1,013,989.00	0.36
12	688122	西部超导	946,686.74	0.34
13	601108	财通证券	929,694.00	0.33
14	688777	中控技术	889,051.23	0.32
15	000783	长江证券	849,575.00	0.30
16	601696	中银证券	838,239.00	0.30
17	601162	天风证券	836,159.00	0.30
18	600499	科达制造	834,767.00	0.30
19	603345	安井食品	775,695.00	0.27
20	002625	光启技术	766,194.00	0.27

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000733	振华科技	1,834,453.00	0.65
2	002340	格林美	1,594,122.74	0.56

3	600188	兖矿能源	1,516,576.00	0.54
4	300751	迈为股份	1,313,870.00	0.47
5	000723	美锦能源	1,263,052.00	0.45
6	601117	中国化学	1,245,033.00	0.44
7	600884	杉杉股份	1,156,552.10	0.41
8	688005	容百科技	1,151,183.42	0.41
9	601689	拓普集团	1,068,852.40	0.38
10	605358	立昂微	1,003,172.80	0.36
11	300763	锦浪科技	996,804.00	0.35
12	600754	锦江酒店	945,832.00	0.34
13	300223	北京君正	712,137.00	0.25
14	600733	北汽蓝谷	699,541.00	0.25
15	603290	斯达半导	680,572.00	0.24
16	688536	思瑞浦	662,838.88	0.23
17	002080	中材科技	642,212.00	0.23
18	600803	新奥股份	629,203.00	0.22
19	601975	招商南油	563,044.90	0.20
20	603893	瑞芯微	538,113.00	0.19

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	46,434,511.53
卖出股票收入（成交）总额	45,043,022.04

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）	17,803.36	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	17,803.36	0.01
----	----	-----------	------

## 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	127064	杭氧转债	178	17,803.36	0.01

## 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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江苏中天科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚，深圳市德方纳米科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅、国家市场监督管理总局的处罚，云南云天化股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到安全生产监督管理局、地方应急管理厅的处罚，华测检测认证集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚，盛新锂能集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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	8,241.71
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,241.71

### 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(%)
358	486,923.71	172,599,259.00	99.01	1,719,428.00	0.99

#### 8.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

### 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	中信证券股份有限公司	1,162,873.00	0.67
2	姜晓平	235,683.00	0.14

3	张红艳	197,700.00	0.11
4	陈妙琴	139,373.00	0.08
5	朱庆芳	115,758.00	0.07
6	李淑清	69,455.00	0.04
7	钮冰融	46,303.00	0.03
8	刘秀珍	46,303.00	0.03
9	王巍	37,200.00	0.02
10	黄子祺	36,200.00	0.02
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	171,436,286.00	98.35

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

### 8.3 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。

### 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、基金投资和研发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

注：本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015 年 5 月 29 日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	174,318,687.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	174,318,687.00

## § 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

本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2021 年 10 月 20 日起，改聘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，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对其采取责令改正的监管措施，公司高度重视，已制定并实施相关整改措施。

### 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(%)	
海通证券	2	43,723,322.75	47.94	40,720.64	48.43	-
中信证券	2	41,633,977.69	45.65	38,769.06	46.11	-
国泰君安	2	2,959,703.67	3.24	2,755.93	3.28	-
中银国际	2	2,894,661.72	3.17	1,827.42	2.17	-
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	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，本公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

(1)综合实力较强、市场信誉良好；



- (2)财务状况良好，经营状况稳健；
- (3)经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4)研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5)具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6)具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7)从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

## 2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
海通证券	155,355.85	100.00	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-

### 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 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 1 月 24 日

2	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 3 月 31 日
3	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
4	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 1 号)	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 22 日
6	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新(2022 年第 2 号)	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
7	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 20 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20220101~20220630	170,286,286.00	1,150,000.00	0.00	171,436,286.00	98.35

#### 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 500 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 500 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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

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](http://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

2022 年 8 月 31 日