

国寿安保中证 500 交易型开放式
指数证券投资基金
2023 年中期报告

2023 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：2023 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 2023 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 2023 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	10
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	12
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	15
§7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况.....	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	33
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.....	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	47
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.....	47

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	47
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	47
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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末上市基金前十名持有人	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	49
§9 开放式基金份额变动	49
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	50
10.4 基金投资策略的改变	50
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
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	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.8 其他重大事件	52
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
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	52
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§ 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	140,318,687.00 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	韩占锋	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(2023年1月1日-2023年6月30日)
本期已实现收益	-2,096,195.56
本期利润	5,914,787.89
加权平均基金份额本期利润	0.0426
本期加权平均净值利润率	3.07%
本期基金份额净值增长率	3.25%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	-113,122,001.86
期末可供分配基金份额利润	-0.8062
期末基金资产净值	189,921,427.54
期末基金份额净值	1.3535
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-37.33%

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

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

3.2 基金净值表现

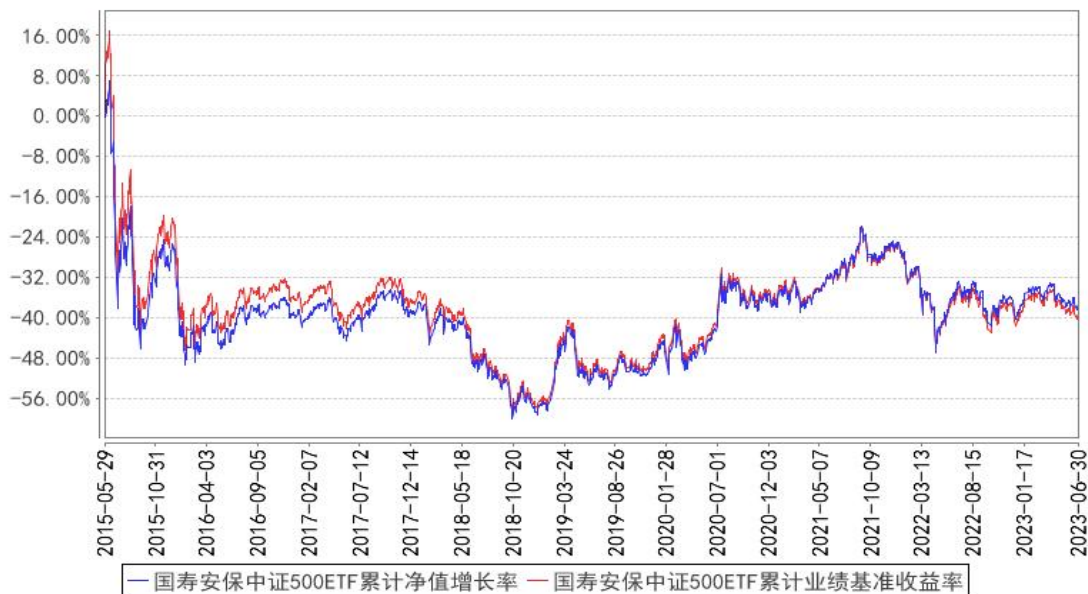
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.10%	0.93%	-0.81%	0.93%	0.71%	0.00%
过去三个月	-4.31%	0.82%	-5.38%	0.83%	1.07%	-0.01%
过去六个月	3.25%	0.78%	2.29%	0.79%	0.96%	-0.01%
过去一年	-5.63%	0.95%	-7.06%	0.96%	1.43%	-0.01%

过去三年	7.33%	1.18%	2.29%	1.19%	5.04%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-37.33%	1.59%	-39.21%	1.62%	1.88%	-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 2023 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（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2023 年 6 月 30 日，公司共管理 94 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 3226.04 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2507.58 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和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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 1.3535 元；本报告期基金份额净值增长率为 3.25%，业绩比较基准收益率为 2.29%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年 A 股市场区间震荡，年初疫情放松后经济修复预期明显，一季度市场震荡上涨，但进入二季度，强预期弱实现的宏观经济状态对权益市场走势有所扰动，市场出现回调。行业方面分化显著，新能源板块一月有所表现之后大幅下跌，半导体、TMT 和顺周期等板块交替有所表现。展望后市，二季度以来虽然主要宏观经济指标走低，但全年经济增长目标压力不大，预期政策层面以精准实施在新旧动能转换方向为主，大概率不会进行强刺激。货币政策方面考虑到上半年国内温和通胀的背景，预计将大概率延续中性偏宽松的基调。外部美国通胀有所缓和加息接近尾声，全球权益市场整体回暖，有望逐步走出加息带来的估值压力，叠加经济改善带来的业绩增长预期，下半年的权益市场有望在渐进式的经济复苏中有所表现。

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、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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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

《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中期报告中的财务指标、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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	2,379,885.13	1,832,598.11
结算备付金		13,786.95	-
存出保证金		12,122.72	2,044.90
交易性金融资产	6.4.7.2	187,799,192.41	179,929,906.55
其中：股票投资		187,799,192.41	179,894,906.09
基金投资		-	-
债券投资		-	35,000.46
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		190,204,987.21	181,764,549.56
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	35,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		78,227.15	87,018.20
应付托管费		15,645.43	17,403.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	189,687.09	298,199.47
负债合计		283,559.67	437,621.34
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	303,043,429.40	298,724,069.86
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-113,122,001.86	-117,397,141.64
净资产合计		189,921,427.54	181,326,928.22
负债和净资产总计		190,204,987.21	181,764,549.56

注：报告截止日 2023 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3535 元，基金份额总额 140,318,687.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		6,642,297.85	-31,221,211.35
1. 利息收入		7,058.39	8,090.89
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,058.39	8,090.89
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-1,384,847.42	1,180,056.94
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,606,627.69	-1,582,606.92
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	26,462.23	23,351.21

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	2,195,318.04	2,739,312.65
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	8,010,983.45	-32,424,409.63
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	9,103.43	15,050.45
减：二、营业总支出		727,509.96	881,780.05
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	476,867.09	605,269.32
2. 托管费	6.4.10.2.2	95,373.45	121,053.94
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
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		0.07	0.10
8. 其他费用	6.4.7.23	155,269.35	155,456.69
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,914,787.89	-32,102,991.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,914,787.89	-32,102,991.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,914,787.89	-32,102,991.40

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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）	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22
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）	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,319,359.54	-	4,275,139.78	8,594,499.32
（一）、综合收益总额	-	-	5,914,787.89	5,914,787.89
（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）	4,319,359.54	-	-1,639,648.11	2,679,711.43
其中：1. 基金申购款	4,319,359.54	-	-1,639,648.11	2,679,711.43
2. 基金赎回款	-	-	-	-
（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）	303,043,429.40	-	-113,122,001.86	189,921,427.54
项目	上年度可比期间			
	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
-----------------	----------------	---	-----------------	----------------

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：

鄂华

王文英

于晓树

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》注册,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于 2023 年 08 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、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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 2023年6月30日
活期存款	2,379,885.13
等于：本金	2,379,378.50
加：应计利息	506.63
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	2,379,885.13

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	198,178,777.00	-	187,799,192.41	-10,379,584.59
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	198,178,777.00	-	187,799,192.41	-10,379,584.59

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 2023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	35,384.53
其中：交易所市场	35,384.53
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,302.56
应付指数使用费	70,000.00
合计	189,687.09

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	138,318,687.00	298,724,069.86
本期申购	2,000,000.00	4,319,359.54
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
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	140,318,687.00	303,043,429.40

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期末无其他综合收益。

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
上年度末	-57,606,069.55	-59,791,072.09	-117,397,141.64
本期利润	-2,096,195.56	8,010,983.45	5,914,787.89
本期基金份额交易产生的变动数	-826,792.94	-812,855.17	-1,639,648.11
其中：基金申购款	-826,792.94	-812,855.17	-1,639,648.11
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-60,529,058.05	-52,592,943.81	-113,122,001.86

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	6,381.03
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	582.86
其他	94.50
合计	7,058.39

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 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,606,627.69
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-3,606,627.69

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	23,740,013.89
减：卖出股票成本总额	27,284,602.46
减：交易费用	62,039.12
买卖股票差价收入	-3,606,627.69

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 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	18.99
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	26,443.24
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	26,462.23

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 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	123,468.36
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	97,000.00
减：应计利息总额	20.18
减：交易费用	4.94
买卖债券差价收入	26,443.24

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,195,318.04
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	2,195,318.04

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	8,010,983.45
股票投资	8,010,983.45
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	8,010,983.45

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	9,103.43
合计	9,103.43

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 2023年1月1日至2023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	966.79
指数使用费	70,000.00
合计	155,269.35

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

6.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	476,867.09	605,269.32
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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	95,373.45	121,053.94

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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。

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 2023年6月30日		上年度末 2022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	136,766,786.00	97.47	136,246,286.00	98.50

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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	2,379,885.13	6,381.03	2,953,251.42	7,323.62

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金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（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
001328	登康口腔	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	20.68	25.49	82	1,695.76	2,090.18	-
603135	中重科技	2023年3月29日	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	199	3,542.20	3,560.11	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

3、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

4、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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
601298	青岛港	2023年6月28日	重大事项停牌	6.97	2023年7月3日	7.40	19,400	116,832.91	135,218.00	-
000540	*ST中天	2023年5月19日	深市终止上市	0.40	-	-	138,400	422,919.64	55,360.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末参与转融通证券出借业务。

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。

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。本基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，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，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并

进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业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(净资产)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期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 2023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	2,379,885.13	-	-	-	2,379,885.13
结算备付金	13,786.95	-	-	-	13,786.95
存出保证金	12,122.72	-	-	-	12,122.72
交易性金融资产	-	-	-	-187,799,192.41	187,799,192.41
资产总计	2,405,794.80	-	-	-187,799,192.41	190,204,987.21
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	78,227.15	78,227.15
应付托管费	-	-	-	15,645.43	15,645.43
其他负债	-	-	-	189,687.09	189,687.09
负债总计	-	-	-	283,559.67	283,559.67
利率敏感度缺口	2,405,794.80	-	-	-187,515,632.74	189,921,427.54
上年度末 2022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	1,832,598.11	-	-	-	1,832,598.11
存出保证金	2,044.90	-	-	-	2,044.90
交易性金融资产	-	-	35,000.46	179,894,906.09	179,929,906.55
资产总计	1,834,643.01	-	35,000.46	179,894,906.09	181,764,549.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	87,018.20	87,018.20
应付托管费	-	-	-	17,403.65	17,403.65
应付清算款	-	-	-	35,000.00	35,000.00
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	298,199.47	298,199.47
负债总计	-	-	-	437,621.34	437,621.34
利率敏感度缺口	1,834,643.01	-	35,000.46	179,457,284.75	181,326,928.22

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 2023 年 6 月 30 日，本基金持有未持有的交易性债券投资和资产支持证券投资（2022 年 12 月 31 日，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 0.0193%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2022 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 2023年6月30日		上年度末 2022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	187,799,192.41	98.88	179,894,906.09	99.21
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	35,000.46	0.02
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	187,799,192.41	98.88	179,929,906.55	99.23

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。		
分析	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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	+5%	9,399,555.37	8,885,019.48
	-5%	-9,399,555.37	-8,885,019.48

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

6.4.14 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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	187,602,964.12	179,212,773.80
第二层次	190,578.00	717,132.75
第三层次	5,650.29	-
合计	187,799,192.41	179,929,906.55

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2023年06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(2022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和以摊余成本计量的金融负债，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	187,799,192.41	98.74
	其中：股票	187,799,192.41	98.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	2,393,672.08	1.26
8	其他各项资产	12,122.72	0.01
9	合计	190,204,987.21	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,318,559.00	0.69
B	采矿业	6,941,318.16	3.65
C	制造业	117,543,177.80	61.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,493,766.80	3.42
E	建筑业	2,091,594.00	1.10
F	批发和零售业	5,947,432.49	3.13
G	交通运输、仓储和邮政业	2,836,770.78	1.49
H	住宿和餐饮业	352,849.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,470,457.07	8.15
J	金融业	16,120,806.08	8.49
K	房地产业	2,605,900.50	1.37
L	租赁和商务服务业	2,313,760.00	1.22
M	科学研究和技术服务业	2,117,335.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	1,047,944.73	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	944,644.40	0.50
R	文化、体育和娱乐业	2,662,543.00	1.40
S	综合	990,333.60	0.52
	合计	187,799,192.41	98.88

7.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

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	300308	中际旭创	17,800	2,624,610.00	1.38
2	688256	寒武纪	5,873	1,104,124.00	0.58
3	000988	华工科技	27,900	1,060,479.00	0.56
4	002340	格林美	142,300	983,293.00	0.52
5	002384	东山精密	37,900	981,610.00	0.52
6	002422	科伦药业	32,600	967,568.00	0.51
7	600372	中航电子	62,114	942,890.52	0.50
8	300418	昆仑万维	23,200	934,496.00	0.49
9	300012	华测检测	46,600	908,700.00	0.48
10	600157	永泰能源	615,700	874,294.00	0.46
11	300724	捷佳伟创	7,700	865,095.00	0.46
12	600079	人福医药	31,600	851,304.00	0.45
13	600489	中金黄金	80,700	833,631.00	0.44
14	688777	中控技术	13,166	826,561.48	0.44
15	300003	乐普医疗	36,500	825,265.00	0.43
16	002738	中矿资源	15,780	803,833.20	0.42
17	600487	亨通光电	54,700	801,902.00	0.42
18	002028	思源电气	16,920	790,502.40	0.42
19	600536	中国软件	16,681	782,005.28	0.41
20	601058	赛轮轮胎	67,900	773,381.00	0.41
21	002463	沪电股份	36,900	772,686.00	0.41
22	601555	东吴证券	110,930	769,854.20	0.41
23	600765	中航重机	28,580	757,655.80	0.40
24	300037	新宙邦	14,500	752,405.00	0.40
25	000066	中国长城	53,600	741,288.00	0.39
26	600885	宏发股份	23,176	738,155.60	0.39
27	000807	云铝股份	57,700	734,521.00	0.39
28	600482	中国动力	29,900	700,856.00	0.37
29	000009	中国宝安	57,080	688,955.60	0.36
30	000423	东阿阿胶	12,700	678,815.00	0.36
31	300146	汤臣倍健	28,300	678,634.00	0.36
32	688099	晶晨股份	8,000	674,560.00	0.36
33	600352	浙江龙盛	72,100	674,135.00	0.35
34	300058	蓝色光标	69,100	668,197.00	0.35
35	002966	苏州银行	101,460	664,563.00	0.35
36	002156	通富微电	29,400	664,440.00	0.35
37	002185	华天科技	71,100	654,120.00	0.34

38	601108	财通证券	90,000	651,600.00	0.34
39	600415	小商品城	76,000	648,280.00	0.34
40	002625	光启技术	41,800	637,868.00	0.34
41	002624	完美世界	37,700	636,753.00	0.34
42	600027	华电国际	94,400	631,536.00	0.33
43	300144	宋城演艺	50,700	628,680.00	0.33
44	600109	国金证券	72,300	626,841.00	0.33
45	000783	长江证券	107,200	621,760.00	0.33
46	600988	赤峰黄金	46,100	620,506.00	0.33
47	600161	天坛生物	22,800	619,020.00	0.33
48	601233	桐昆股份	46,700	618,775.00	0.33
49	601077	渝农商行	171,500	615,685.00	0.32
50	600418	江淮汽车	48,500	610,615.00	0.32
51	002008	大族激光	23,300	610,460.00	0.32
52	300568	星源材质	35,500	610,245.00	0.32
53	600298	安琪酵母	16,800	608,328.00	0.32
54	300285	国瓷材料	22,200	608,280.00	0.32
55	600096	云天化	35,500	605,985.00	0.32
56	002385	大北农	91,600	604,560.00	0.32
57	002223	鱼跃医疗	16,650	599,233.50	0.32
58	000630	铜陵有色	204,500	591,005.00	0.31
59	603444	吉比特	1,200	589,332.00	0.31
60	603882	金域医学	7,800	588,900.00	0.31
61	002407	多氟多	29,640	588,650.40	0.31
62	600862	中航高科	23,200	587,192.00	0.31
63	300390	天华新能	16,240	581,392.00	0.31
64	002409	雅克科技	7,900	575,752.00	0.30
65	601162	天风证券	192,300	573,054.00	0.30
66	300024	机器人	34,300	571,781.00	0.30
67	603688	石英股份	5,000	569,200.00	0.30
68	002497	雅化集团	32,000	568,960.00	0.30
69	000933	神火股份	43,700	568,100.00	0.30
70	300474	景嘉微	6,300	566,937.00	0.30
71	002240	盛新锂能	17,700	564,099.00	0.30
72	300073	当升科技	11,200	563,696.00	0.30
73	600705	中航产融	146,900	562,627.00	0.30
74	300395	菲利华	11,400	560,880.00	0.30
75	300604	长川科技	11,800	560,382.00	0.30
76	601168	西部矿业	52,866	555,621.66	0.29
77	605358	立昂微	15,000	550,950.00	0.29
78	002439	启明星辰	18,500	550,560.00	0.29
79	000932	华菱钢铁	114,880	547,977.60	0.29
80	603596	伯特利	6,900	546,894.00	0.29

81	600066	宇通客车	36,800	542,432.00	0.29
82	000975	银泰黄金	46,172	540,212.40	0.28
83	002600	领益智造	78,100	539,671.00	0.28
84	300136	信维通信	26,800	538,144.00	0.28
85	600060	海信视像	21,700	537,075.00	0.28
86	002138	顺络电子	22,300	533,193.00	0.28
87	002797	第一创业	93,000	531,960.00	0.28
88	002465	海格通信	51,100	528,374.00	0.28
89	002568	百润股份	14,500	527,075.00	0.28
90	603816	顾家家居	13,700	522,655.00	0.28
91	601128	常熟银行	76,100	519,002.00	0.27
92	603939	益丰药房	14,020	518,740.00	0.27
93	000021	深科技	25,900	517,741.00	0.27
94	600839	四川长虹	102,200	516,110.00	0.27
95	002850	科达利	3,900	515,775.00	0.27
96	600160	巨化股份	37,420	515,647.60	0.27
97	300253	卫宁健康	47,600	515,032.00	0.27
98	000591	太阳能	75,800	513,924.00	0.27
99	300832	新产业	8,700	513,300.00	0.27
100	688169	石头科技	1,600	513,088.00	0.27
101	600879	航天电子	60,200	511,098.00	0.27
102	688567	孚能科技	23,600	509,524.00	0.27
103	600873	梅花生物	57,000	509,010.00	0.27
104	600563	法拉电子	3,700	508,010.00	0.27
105	000683	远兴能源	70,400	506,176.00	0.27
106	601990	南京证券	61,300	501,434.00	0.26
107	600392	盛和资源	38,895	500,578.65	0.26
108	002368	太极股份	12,058	496,427.86	0.26
109	688521	芯原股份	6,900	496,248.00	0.26
110	300699	光威复材	16,080	496,068.00	0.26
111	002078	太阳纸业	46,400	496,016.00	0.26
112	600497	驰宏锌锗	98,600	494,972.00	0.26
113	603589	口子窖	10,000	493,500.00	0.26
114	601696	中银证券	46,200	492,492.00	0.26
115	300866	安克创新	5,600	490,000.00	0.26
116	300118	东方日升	19,000	486,970.00	0.26
117	000729	燕京啤酒	39,000	486,330.00	0.26
118	002025	航天电器	7,600	484,880.00	0.26
119	600177	雅戈尔	76,800	484,608.00	0.26
120	600516	方大炭素	78,000	483,600.00	0.25
121	000831	中国稀土	16,300	482,480.00	0.25
122	002294	信立泰	15,400	480,326.00	0.25
123	600141	兴发集团	21,580	479,507.60	0.25

124	300017	网宿科技	67,400	479,214.00	0.25
125	688390	固德威	2,856	476,552.16	0.25
126	600642	申能股份	68,000	475,320.00	0.25
127	000728	国元证券	72,400	472,048.00	0.25
128	002673	西部证券	74,200	471,170.00	0.25
129	002430	杭氧股份	13,700	470,732.00	0.25
130	688072	拓荆科技	1,100	468,567.00	0.25
131	600699	均胜电子	26,560	468,518.40	0.25
132	000629	钒钛股份	119,000	465,290.00	0.24
133	600170	上海建工	172,500	464,025.00	0.24
134	002532	天山铝业	77,300	463,027.00	0.24
135	600325	华发股份	46,970	462,654.50	0.24
136	600118	中国卫星	16,400	462,644.00	0.24
137	002273	水晶光电	38,529	460,036.26	0.24
138	002195	二三四五	158,985	459,466.65	0.24
139	002268	电科网安	16,400	457,068.00	0.24
140	601966	玲珑轮胎	20,500	455,510.00	0.24
141	600521	华海药业	24,700	454,727.00	0.24
142	002739	万达电影	36,200	453,948.00	0.24
143	002372	伟星新材	22,100	453,934.00	0.24
144	600153	建发股份	41,600	453,856.00	0.24
145	600166	福田汽车	132,900	451,860.00	0.24
146	600143	金发科技	51,600	450,468.00	0.24
147	300595	欧普康视	14,900	449,831.00	0.24
148	000400	许继电气	19,500	449,475.00	0.24
149	000998	隆平高科	29,200	448,220.00	0.24
150	600486	扬农化工	5,120	447,590.40	0.24
151	600549	厦门钨业	23,500	447,205.00	0.24
152	603000	人民网	15,300	446,760.00	0.24
153	600399	抚顺特钢	43,700	445,740.00	0.23
154	600637	东方明珠	56,800	444,176.00	0.23
155	000738	航发控制	18,200	444,080.00	0.23
156	002065	东华软件	62,200	439,132.00	0.23
157	688002	睿创微纳	9,800	439,040.00	0.23
158	002444	巨星科技	20,000	437,600.00	0.23
159	688220	翱捷科技	5,800	437,262.00	0.23
160	300487	蓝晓科技	7,000	436,940.00	0.23
161	688536	思瑞浦	2,000	436,000.00	0.23
162	600859	王府井	21,975	434,885.25	0.23
163	600481	双良节能	31,100	434,778.00	0.23
164	300438	鹏辉能源	9,000	432,360.00	0.23
165	601577	长沙银行	55,700	432,232.00	0.23
166	000997	新大陆	22,819	431,279.10	0.23

167	601198	东兴证券	53,700	430,674.00	0.23
168	002131	利欧股份	187,209	430,580.70	0.23
169	600499	科达制造	37,900	430,544.00	0.23
170	002353	杰瑞股份	17,100	429,723.00	0.23
171	300383	光环新网	39,900	428,925.00	0.23
172	600704	物产中大	86,500	427,310.00	0.22
173	000960	锡业股份	27,400	426,070.00	0.22
174	300682	朗新科技	18,200	423,696.00	0.22
175	600271	航天信息	30,800	421,652.00	0.22
176	600021	上海电力	39,000	420,030.00	0.22
177	300001	特锐德	20,200	419,756.00	0.22
178	000519	中兵红箭	23,162	419,000.58	0.22
179	601997	贵阳银行	81,200	418,992.00	0.22
180	002373	千方科技	30,600	417,384.00	0.22
181	603077	和邦生物	171,260	416,161.80	0.22
182	688009	中国通号	71,500	414,700.00	0.22
183	300676	华大基因	6,900	413,931.00	0.22
184	000703	恒逸石化	60,900	412,902.00	0.22
185	000623	吉林敖东	25,700	412,228.00	0.22
186	002507	涪陵榨菜	22,430	410,693.30	0.22
187	300088	长信科技	68,000	410,040.00	0.22
188	002056	横店东磁	22,500	409,725.00	0.22
189	600380	健康元	31,996	406,669.16	0.21
190	600511	国药股份	10,400	404,040.00	0.21
191	600867	通化东宝	38,700	404,028.00	0.21
192	002152	广电运通	34,400	403,168.00	0.21
193	000513	丽珠集团	10,353	402,835.23	0.21
194	600498	烽火通信	19,700	401,289.00	0.21
195	600998	九州通	38,591	400,574.58	0.21
196	002281	光迅科技	10,800	400,572.00	0.21
197	600529	山东药玻	14,700	400,134.00	0.21
198	600546	山煤国际	27,500	397,925.00	0.21
199	002203	海亮股份	33,100	397,531.00	0.21
200	600348	华阳股份	50,150	396,686.50	0.21
201	688516	奥特维	2,100	395,640.00	0.21
202	688301	奕瑞科技	1,400	395,402.00	0.21
203	002299	圣农发展	20,600	394,490.00	0.21
204	601016	节能风电	107,440	394,304.80	0.21
205	000636	风华高科	25,700	394,238.00	0.21
206	603338	浙江鼎力	7,000	392,070.00	0.21
207	600739	辽宁成大	29,700	390,555.00	0.21
208	603517	绝味食品	10,500	390,075.00	0.21
209	002595	豪迈科技	11,100	389,943.00	0.21

210	002192	融捷股份	5,800	387,614.00	0.20
211	603712	七一二	12,800	386,688.00	0.20
212	601636	旗滨集团	44,500	383,590.00	0.20
213	603737	三棵树	5,840	382,052.80	0.20
214	603927	中科软	9,900	381,744.00	0.20
215	002080	中材科技	18,600	381,672.00	0.20
216	002531	天顺风能	25,000	380,750.00	0.20
217	002432	九安医疗	10,800	380,268.00	0.20
218	002506	协鑫集成	129,600	379,728.00	0.20
219	603885	吉祥航空	24,500	378,035.00	0.20
220	688772	珠海冠宇	18,700	376,805.00	0.20
221	600863	内蒙华电	90,600	375,990.00	0.20
222	600970	中材国际	29,200	372,300.00	0.20
223	600580	卧龙电驱	25,400	371,094.00	0.20
224	600655	豫园股份	54,000	370,440.00	0.20
225	300182	捷成股份	58,600	369,766.00	0.19
226	002092	中泰化学	57,302	369,597.90	0.19
227	000878	云南铜业	33,400	369,070.00	0.19
228	600820	隧道股份	61,100	367,211.00	0.19
229	300296	利亚德	56,200	366,986.00	0.19
230	300212	易华录	11,040	366,859.20	0.19
231	688385	复旦微电	7,300	365,730.00	0.19
232	002683	广东宏大	12,400	365,056.00	0.19
233	600528	中铁工业	36,947	365,036.36	0.19
234	600909	华安证券	77,990	364,213.30	0.19
235	002939	长城证券	44,600	362,598.00	0.19
236	002926	华西证券	43,600	362,316.00	0.19
237	600535	天士力	24,900	361,299.00	0.19
238	300244	迪安诊断	13,880	355,744.40	0.19
239	000893	亚钾国际	15,500	355,570.00	0.19
240	600329	达仁堂	7,900	354,631.00	0.19
241	000750	国海证券	105,820	354,497.00	0.19
242	603233	大参林	12,656	354,494.56	0.19
243	000547	航天发展	35,400	354,000.00	0.19
244	300748	金力永磁	11,800	353,056.00	0.19
245	600258	首旅酒店	18,620	352,849.00	0.19
246	603160	汇顶科技	7,600	351,500.00	0.19
247	600008	首创环保	122,020	351,417.60	0.19
248	600416	湘电股份	18,400	351,256.00	0.18
249	000039	中集集团	50,933	350,928.37	0.18
250	002557	洽洽食品	8,400	349,020.00	0.18
251	603156	养元饮品	14,000	345,800.00	0.18
252	000970	中科三环	26,925	345,178.50	0.18

253	002429	兆驰股份	62,700	344,850.00	0.18
254	000060	中金岭南	72,500	344,375.00	0.18
255	603456	九洲药业	12,500	342,250.00	0.18
256	601991	大唐发电	103,200	341,592.00	0.18
257	000830	鲁西化工	31,900	336,864.00	0.18
258	688200	华峰测控	2,200	336,600.00	0.18
259	603658	安图生物	6,500	336,245.00	0.18
260	600390	五矿资本	62,300	335,174.00	0.18
261	603893	瑞芯微	4,600	335,110.00	0.18
262	600369	西南证券	91,800	335,070.00	0.18
263	600435	北方导航	29,100	334,359.00	0.18
264	002500	山西证券	59,690	333,070.20	0.18
265	300558	贝达药业	6,900	331,407.00	0.17
266	002508	老板电器	13,100	331,299.00	0.17
267	600398	海澜之家	47,900	329,552.00	0.17
268	002936	郑州银行	142,876	328,614.80	0.17
269	002128	电投能源	24,840	328,384.80	0.17
270	601880	辽港股份	208,540	325,322.40	0.17
271	300009	安科生物	32,532	325,320.00	0.17
272	600038	中直股份	8,169	325,289.58	0.17
273	300070	碧水源	60,400	323,744.00	0.17
274	002153	石基信息	22,720	318,080.00	0.17
275	600985	淮北矿业	27,600	317,952.00	0.17
276	601717	郑煤机	25,500	317,475.00	0.17
277	603858	步长制药	15,400	317,086.00	0.17
278	688188	柏楚电子	1,680	316,780.80	0.17
279	600848	上海临港	26,500	316,675.00	0.17
280	300026	红日药业	58,300	315,986.00	0.17
281	000050	深天马 A	34,100	313,038.00	0.16
282	300529	健帆生物	13,400	310,612.00	0.16
283	002572	索菲亚	17,700	308,334.00	0.16
284	603127	昭衍新药	7,500	306,750.00	0.16
285	601179	中国西电	56,700	306,747.00	0.16
286	300373	扬杰科技	7,500	304,275.00	0.16
287	002244	滨江集团	34,400	303,408.00	0.16
288	002408	齐翔腾达	47,393	301,893.41	0.16
289	600673	东阳光	41,800	301,378.00	0.16
290	601456	国联证券	33,100	301,210.00	0.16
291	688779	长远锂科	26,700	300,909.00	0.16
292	601958	金钼股份	26,900	299,935.00	0.16
293	002266	浙富控股	72,480	299,342.40	0.16
294	600895	张江高科	21,500	299,280.00	0.16
295	003035	南网能源	42,000	299,040.00	0.16

296	002019	亿帆医药	20,400	297,840.00	0.16
297	688116	天奈科技	6,500	297,375.00	0.16
298	600827	百联股份	22,200	296,814.00	0.16
299	600566	济川药业	10,200	296,208.00	0.16
299	600667	太极实业	40,800	296,208.00	0.16
300	000155	川能动力	20,500	295,200.00	0.16
301	603267	鸿远电子	4,500	293,850.00	0.15
302	688538	和辉光电	115,400	293,116.00	0.15
303	002958	青农商行	107,700	292,944.00	0.15
304	600208	新湖中宝	118,100	292,888.00	0.15
305	300357	我武生物	8,700	292,581.00	0.15
306	601666	平煤股份	38,600	291,044.00	0.15
307	601000	唐山港	82,246	290,328.38	0.15
308	000739	普洛药业	16,300	289,162.00	0.15
309	600171	上海贝岭	15,800	288,350.00	0.15
310	600282	南钢股份	85,200	287,124.00	0.15
311	600378	昊华科技	7,600	286,064.00	0.15
312	600755	厦门国贸	36,900	285,606.00	0.15
313	000887	中鼎股份	21,800	285,362.00	0.15
314	002155	湖南黄金	23,304	284,308.80	0.15
315	002670	国盛金控	32,136	282,154.08	0.15
316	600959	江苏有线	82,900	280,202.00	0.15
317	300677	英科医疗	12,720	279,840.00	0.15
318	600316	洪都航空	11,900	279,055.00	0.15
319	300115	长盈精密	23,356	278,169.96	0.15
320	300888	稳健医疗	6,580	274,188.60	0.14
321	601231	环旭电子	18,300	273,768.00	0.14
322	600315	上海家化	9,400	272,694.00	0.14
323	002030	达安基因	27,244	271,622.68	0.14
324	002487	大金重工	8,800	271,392.00	0.14
325	000778	新兴铸管	66,500	271,320.00	0.14
325	600517	国网英大	47,600	271,320.00	0.14
326	601866	中远海发	109,800	271,206.00	0.14
327	000598	兴蓉环境	49,800	270,414.00	0.14
328	603218	日月股份	14,200	269,658.00	0.14
329	600056	中国医药	20,760	269,464.80	0.14
330	300363	博腾股份	9,100	269,269.00	0.14
331	600131	国网信通	13,300	268,527.00	0.14
332	600582	天地科技	45,800	267,014.00	0.14
333	603026	胜华新材	4,500	266,625.00	0.14
334	688082	盛美上海	2,400	264,960.00	0.14
335	002221	东华能源	30,600	264,690.00	0.14
336	000987	越秀资本	41,630	264,350.50	0.14

337	300251	光线传媒	32,500	262,925.00	0.14
338	002249	大洋电机	46,100	262,770.00	0.14
339	600598	北大荒	19,700	262,601.00	0.14
340	000027	深圳能源	39,520	260,436.80	0.14
341	601005	重庆钢铁	186,000	260,400.00	0.14
342	002518	科士达	6,500	260,065.00	0.14
343	002326	永太科技	17,000	259,930.00	0.14
344	600906	财达证券	36,000	259,200.00	0.14
345	000709	河钢股份	114,500	258,770.00	0.14
346	002183	怡亚通	50,500	257,550.00	0.14
347	601106	中国一重	76,000	255,360.00	0.13
348	002831	裕同科技	10,320	251,704.80	0.13
349	600718	东软集团	23,600	251,576.00	0.13
350	601992	金隅集团	115,300	251,354.00	0.13
351	002690	美亚光电	9,740	250,805.00	0.13
352	600373	中文传媒	18,700	249,084.00	0.13
353	000883	湖北能源	54,500	248,520.00	0.13
354	601665	齐鲁银行	63,300	248,136.00	0.13
355	002511	中顺洁柔	22,200	247,530.00	0.13
356	603568	伟明环保	14,083	246,593.33	0.13
357	000825	太钢不锈	63,700	246,519.00	0.13
358	300776	帝尔激光	3,780	245,322.00	0.13
359	002985	北摩高科	5,543	244,557.16	0.13
360	601778	晶科科技	49,300	243,542.00	0.13
361	603883	老百姓	8,140	242,979.00	0.13
362	601928	凤凰传媒	21,200	241,680.00	0.13
363	600663	陆家嘴	24,400	240,828.00	0.13
364	603228	景旺电子	9,368	240,289.20	0.13
365	600967	内蒙一机	23,697	239,339.70	0.13
366	600737	中粮糖业	29,700	239,085.00	0.13
367	600155	华创阳安	37,700	234,494.00	0.12
368	600297	广汇汽车	112,600	234,208.00	0.12
369	603225	新凤鸣	21,140	233,597.00	0.12
370	600801	华新水泥	18,872	233,069.20	0.12
371	002791	坚朗五金	3,600	232,956.00	0.12
372	601098	中南传媒	20,000	232,000.00	0.12
373	300482	万孚生物	8,690	231,414.70	0.12
374	002468	申通快递	21,300	230,466.00	0.12
375	300861	美畅股份	5,300	229,861.00	0.12
376	603529	爱玛科技	7,100	228,762.00	0.12
377	688208	道通科技	7,505	227,476.55	0.12
378	002745	木林森	24,700	227,240.00	0.12
379	688778	厦钨新能	4,590	227,205.00	0.12

380	000012	南玻 A	38,075	226,927.00	0.12
381	002032	苏泊尔	4,500	225,000.00	0.12
382	001227	兰州银行	78,600	224,796.00	0.12
383	000156	华数传媒	25,800	224,460.00	0.12
384	603866	桃李面包	22,056	223,206.72	0.12
385	600871	石化油服	112,600	222,948.00	0.12
386	688281	华秦科技	1,100	222,750.00	0.12
387	600500	中化国际	39,920	221,955.20	0.12
388	000581	威孚高科	13,900	218,925.00	0.12
389	688690	纳微科技	5,600	217,560.00	0.11
390	000401	冀东水泥	29,500	217,415.00	0.11
391	002867	周大生	12,200	216,916.00	0.11
392	301029	怡合达	4,840	216,251.20	0.11
393	002250	联化科技	20,500	214,430.00	0.11
394	601118	海南橡胶	47,600	213,248.00	0.11
395	688276	百克生物	3,400	212,840.00	0.11
396	600556	天下秀	30,000	212,700.00	0.11
397	688029	南微医学	2,593	211,485.08	0.11
398	600022	山东钢铁	148,800	211,296.00	0.11
399	601611	中国核建	25,000	211,250.00	0.11
400	688520	神州细胞	3,700	209,938.00	0.11
401	000930	中粮科技	25,800	208,980.00	0.11
402	002010	传化智联	39,000	207,480.00	0.11
403	000785	居然之家	54,400	207,264.00	0.11
404	688006	杭可科技	6,779	206,556.13	0.11
405	300850	新强联	5,500	205,590.00	0.11
406	002423	中粮资本	25,500	204,000.00	0.11
407	601598	中国外运	43,700	203,642.00	0.11
408	601608	中信重工	48,100	202,501.00	0.11
409	600259	广晟有色	5,600	202,384.00	0.11
410	600062	华润双鹤	11,532	200,887.44	0.11
411	002505	鹏都农牧	106,270	200,850.30	0.11
412	000559	万向钱潮	36,600	199,470.00	0.11
413	002081	金螳螂	44,000	198,440.00	0.10
414	600597	光明乳业	19,002	197,620.80	0.10
415	000089	深圳机场	28,400	197,380.00	0.10
416	600782	新钢股份	52,800	195,888.00	0.10
417	603826	坤彩科技	3,900	195,000.00	0.10
418	300618	寒锐钴业	6,000	194,460.00	0.10
419	000958	电投产融	44,800	193,984.00	0.10
420	603638	艾迪精密	9,320	191,246.40	0.10
421	600901	江苏租赁	46,200	190,806.00	0.10
422	600707	彩虹股份	39,600	188,496.00	0.10

423	600339	中油工程	46,300	188,441.00	0.10
424	600409	三友化工	34,400	187,480.00	0.10
425	000937	冀中能源	29,300	186,934.00	0.10
426	600095	湘财股份	23,700	184,860.00	0.10
427	000898	鞍钢股份	66,400	184,592.00	0.10
428	601187	厦门银行	36,500	183,230.00	0.10
429	688107	安路科技	3,300	182,787.00	0.10
430	603707	健友股份	13,526	182,601.00	0.10
431	002761	浙江建投	12,000	182,160.00	0.10
432	000415	渤海租赁	86,100	180,810.00	0.10
433	601718	际华集团	60,700	180,279.00	0.09
434	600507	方大特钢	38,896	180,088.48	0.09
435	000537	广宇发展	15,400	179,718.00	0.09
436	000967	盈峰环境	35,300	178,265.00	0.09
437	600167	联美控股	25,380	176,898.60	0.09
438	001914	招商积余	11,700	176,085.00	0.09
439	601568	北元集团	33,170	174,805.90	0.09
440	688052	纳芯微	1,100	174,207.00	0.09
441	600968	海油发展	56,300	172,841.00	0.09
442	000563	陕国投 A	56,600	172,630.00	0.09
443	600808	马钢股份	66,936	172,025.52	0.09
444	601156	东航物流	13,200	171,600.00	0.09
445	688234	天岳先进	2,298	169,914.12	0.09
446	002925	盈趣科技	8,620	167,228.00	0.09
447	300257	开山股份	11,000	166,870.00	0.09
448	002705	新宝股份	9,200	165,876.00	0.09
449	600195	中牧股份	14,100	164,688.00	0.09
450	603650	彤程新材	5,000	164,000.00	0.09
451	300442	润泽科技	5,300	163,028.00	0.09
452	688185	康希诺	2,000	163,000.00	0.09
453	600126	杭钢股份	37,430	162,446.20	0.09
454	600764	中国海防	5,900	160,598.00	0.08
455	002608	江苏国信	21,000	158,970.00	0.08
456	603379	三美股份	6,740	158,457.40	0.08
457	000959	首钢股份	43,400	151,900.00	0.08
458	000402	金融街	32,900	148,708.00	0.08
459	603786	科博达	2,200	144,540.00	0.08
460	601828	美凯龙	30,100	144,179.00	0.08
461	002653	海思科	6,100	143,960.00	0.08
462	002110	三钢闽光	33,750	142,425.00	0.07
463	001203	大中矿业	12,600	139,986.00	0.07
464	002563	森马服饰	22,300	138,706.00	0.07
465	688289	圣湘生物	8,155	137,330.20	0.07

466	688819	天能股份	3,700	136,308.00	0.07
467	601228	广州港	42,000	135,660.00	0.07
468	600377	宁沪高速	13,800	135,654.00	0.07
469	601298	青岛港	19,400	135,218.00	0.07
470	603056	德邦股份	8,600	132,612.00	0.07
471	600927	永安期货	8,100	131,706.00	0.07
472	000031	大悦城	35,600	130,296.00	0.07
473	600623	华谊集团	20,900	130,207.00	0.07
474	603317	天味食品	8,909	130,160.49	0.07
475	600928	西安银行	36,700	129,184.00	0.07
476	601869	长飞光纤	3,400	125,834.00	0.07
477	600350	山东高速	18,700	119,119.00	0.06
478	601136	首创证券	8,400	119,028.00	0.06
479	002399	海普瑞	10,300	118,141.00	0.06
480	000869	张裕 A	3,800	116,508.00	0.06
481	601139	深圳燃气	15,900	115,911.00	0.06
482	601969	海南矿业	17,000	111,860.00	0.06
483	001872	招商港口	6,400	110,528.00	0.06
484	600995	南网储能	9,800	107,898.00	0.06
485	000553	安道麦 A	12,200	102,968.00	0.05
486	002945	华林证券	7,400	101,232.00	0.05
487	688105	诺唯赞	3,300	100,617.00	0.05
488	600299	安迪苏	11,200	89,264.00	0.05
489	601158	重庆水务	16,000	88,960.00	0.05
490	688248	南网科技	2,300	88,297.00	0.05
491	603868	飞科电器	1,300	82,017.00	0.04
492	688295	中复神鹰	2,200	80,696.00	0.04
493	603355	莱克电气	3,160	80,295.60	0.04
494	600032	浙江新能	6,000	75,360.00	0.04
495	600956	新天绿能	8,400	73,248.00	0.04
496	300741	华宝股份	3,400	72,828.00	0.04
497	000540	*ST 中天	138,400	55,360.00	0.03
498	002901	大博医疗	1,600	49,728.00	0.03
499	603135	中重科技	199	3,560.11	0.00
500	001328	登康口腔	82	2,090.18	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	600372	中航电子	842,879.00	0.46
2	002463	沪电股份	797,632.00	0.44
3	000066	中国长城	746,689.00	0.41

4	000423	东阿阿胶	649,037.00	0.36
5	002240	盛新锂能	609,961.00	0.34
6	000933	神火股份	606,951.00	0.33
7	002008	大族激光	570,221.00	0.31
8	603882	金城医学	564,140.00	0.31
9	688169	石头科技	526,320.66	0.29
10	300395	菲利华	503,151.00	0.28
11	002600	领益智造	496,005.00	0.27
12	688220	翱捷科技	483,977.84	0.27
13	688536	思瑞浦	482,102.89	0.27
14	688072	拓荆科技	462,868.00	0.26
15	300118	东方日升	444,127.99	0.24
16	601966	玲珑轮胎	441,592.00	0.24
17	300487	蓝晓科技	440,060.00	0.24
18	002432	九安医疗	434,770.00	0.24
19	300595	欧普康视	430,165.00	0.24
20	300438	鹏辉能源	411,781.00	0.23

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	002013	中航机电	835,450.00	0.46
2	688122	西部超导	763,966.44	0.42
3	603345	安井食品	762,797.00	0.42
4	601607	上海医药	747,881.00	0.41
5	000999	华润三九	716,457.00	0.40
6	002603	以岭药业	644,864.00	0.36
7	603605	珀莱雅	622,069.00	0.34
8	603606	东方电缆	601,818.00	0.33
9	601699	潞安环能	576,555.00	0.32
10	300168	万达信息	565,839.08	0.31
11	601872	招商轮船	561,629.00	0.31
12	603613	国联股份	556,433.00	0.31
13	688063	派能科技	515,589.58	0.28
14	600026	中远海能	485,450.44	0.27
15	601333	广深铁路	385,326.00	0.21
16	002212	天融信	359,905.00	0.20
17	600201	生物股份	323,467.56	0.18
18	600728	佳都科技	318,529.00	0.18
19	002396	星网锐捷	292,470.00	0.16
20	688088	虹软科技	275,407.32	0.15

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	25,812,441.53
卖出股票收入（成交）总额	23,740,013.89

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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，昆仑万维科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚。

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	12,122.72
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	12,122.72

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限制的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
313	448,302.51	138,901,720.00	98.99	1,416,967.00	1.01

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	2,134,834.00	1.52
2	姜晓平	235,683.00	0.17

3	张红艳	197,700.00	0.14
4	陈妙琴	139,373.00	0.10
5	李淑清	69,455.00	0.05
6	钮冰融	46,303.00	0.03
7	刘秀珍	46,303.00	0.03
8	黄子祺	46,200.00	0.03
9	王巍	41,200.00	0.03
10	冯进	27,782.00	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	136,766,786.00	97.47

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

§ 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	138,318,687.00
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	-
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	140,318,687.00

§ 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，基金管理人于 2023 年 1 月 4 日发布公告，鄂华先生自 2023 年 1 月 3 日起任公司总经理、董事，左季庆先生于 2023 年 1 月 3 日离任公司总经理、董事；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，韩占锋先生自 2023 年 1 月 5 日起任公司督察长，申梦玉先生于 2023 年

1 月 5 日离任公司督察长；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，董瑞倩女士于 2023 年 1 月 5 日离任公司固定收益投资总监。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	2	44,382,740.54	93.17	32,457.13	91.73	-
中信证券	2	2,305,833.39	4.84	2,147.25	6.07	-
招商证券	2	522,907.48	1.10	382.24	1.08	-
海通证券	2	427,219.90	0.90	397.91	1.12	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-

中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

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(%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	72,665.51	58.85	-	-	-	-
招商证券	50,802.85	41.15	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-

太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

无。

§ 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	20230101~20230630	136,246,286.00	2,000,000.00	1,479,500.00	136,766,786.00	97.47
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>							

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.gsfoods.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2023 年 8 月 31 日