

# 国寿安保智慧生活股票型证券投资基金 2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

## 1.2 目录

<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
<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.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
<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.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
<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 所有者权益（基金净值）变动表.....	13
6.4 报表附注.....	14
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	43

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.....	43
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.....	43
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	43
7.12 投资组合报告附注.....	43
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>44</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	44
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	44
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>44</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>45</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
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.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
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.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	46
10.8 其他重大事件.....	47
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>48</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.....	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>48</b>
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	49

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保智慧生活股票型证券投资基金
基金简称	国寿安保智慧生活股票
基金主代码	001672
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015 年 9 月 1 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	111,733,016.23 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在深入研究的基础上，自下而上精选开拓和建设智慧生活的上市公司，在严格控制投资风险的前提下，力求获得长期稳定的投资回报。
投资策略	在大类资产配置上，在具备足够多本基金所定义的投资标的时，优先考虑股票类资产的配置，剩余资产将配置于债券和现金等大类资产上。除主要的股票投资策略外，本基金还可通过债券投资策略以及衍生工具投资策略，进一步为基金组合规避风险、增强收益。本基金通过定量与定性相结合的方法分析宏观经济和证券市场发展趋势，评估市场的系统性风险和各类资产的预期收益与风险，据此合理制定和调整股票、债券等各类资产的比例，在保持总体风险水平相对稳定的基础上，力争投资组合的稳定增值。在债券类资产的投资上，将深入分析宏观经济、货币政策和利率变化趋势以及不同债券品种的收益率水平、流动性和信用风险等因素，以价值发现为基础，力求获取高于业绩基准的投资回报。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 X 80%+中债综合指数收益率（全价） X 20%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，属于证券投资基金中的高风险/高收益品种。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	李申
	联系电话	010-50850744	021-60637102
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		4009-258-258	021-60637111
传真		010-50850776	021-60635778
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100033	100033
法定代表人		王军辉	田国立

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

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	74,624,507.65
本期利润	16,612,486.80
加权平均基金份额本期利润	0.0927
本期加权平均净值利润率	5.16%
本期基金份额净值增长率	10.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	80,779,769.09
期末可供分配基金份额利润	0.7230
期末基金资产净值	219,035,601.55
期末基金份额净值	1.960
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	132.44%

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

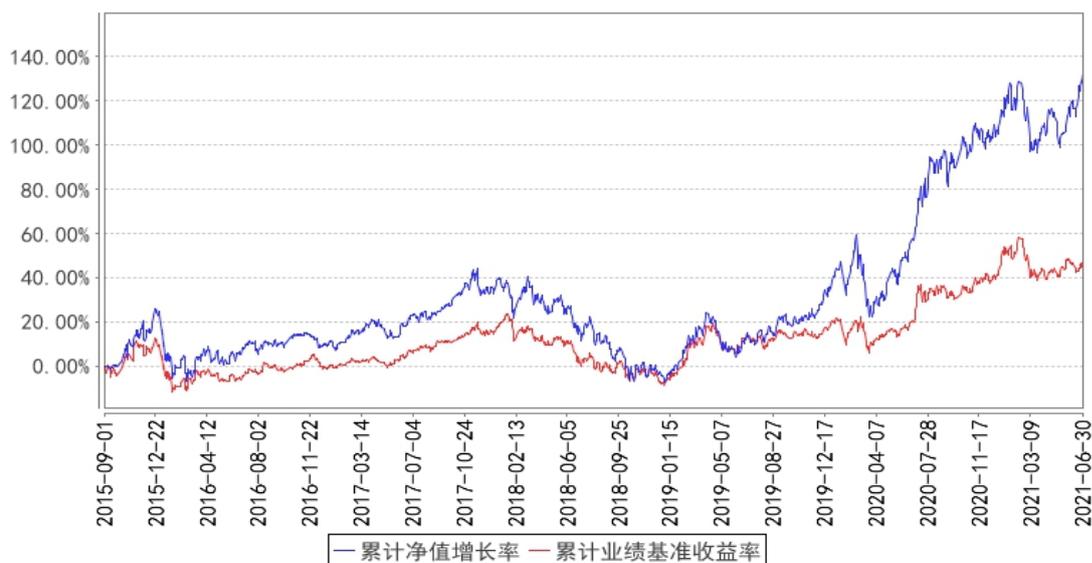
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	8.11%	1.23%	-1.62%	0.64%	9.73%	0.59%
过去三个月	13.89%	1.15%	2.91%	0.78%	10.98%	0.37%
过去六个月	10.30%	1.41%	0.49%	1.05%	9.81%	0.36%
过去一年	44.16%	1.44%	20.27%	1.06%	23.89%	0.38%

过去三年	96.16%	1.53%	40.23%	1.09%	55.93%	0.44%
自基金合同生效起至今	132.44%	1.44%	45.92%	1.03%	86.52%	0.41%

### 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

国寿安保智慧生活股票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 09 月 01 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。

本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 09 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 6 月 30 日，公司共管理 81 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 3175.94 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为

2371.90 亿元。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张琦	股票投资总监、股票投资部总监及基金经理	2015年9月23日	-	16年	2005年1月至2015年5月，任职中银基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理等职，2015年6月加入国寿安保基金管理有限公司，现任国寿安保基金管理有限公司股票投资总监、股票投资部总监，国寿安保智慧生活股票型证券投资基金、国寿安保成长优选股票型证券投资基金、国寿安保目标策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、国寿安保健康科学混合型证券投资基金、国寿安保消费新蓝海灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保华兴灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金和国寿安保高股息混合型证券投资基金基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年上半年，从海外的情况来看，新冠疫情持续反复增加了全球经济复苏的不确定性，印度疫情爆发带动了东南亚和英国疫情反复。美国消费数据继续复苏，通胀有所走高，就业数据伴随疫苗接种率的提升有所恢复。美联储维持了低利率水平和货币政策导向。

从国内的情况来看，一方面，新冠疫情防控措施得当有力，疫苗接种有序铺开；另一方面，社会生产和需求保持稳定发展，出口整体偏强，消费、投资数据有所改善，经济新、旧动能转换，高质量发展格局基本确立。

报告期内，A 股市场震荡上行，分化明显。创业板指数上涨 17.22%，中证 500 指数上涨 6.93%，上证综指上涨 3.40%，沪深 300 指数上涨 0.24%，上证 50 指数下跌 3.90%。行业方面，电气设备、钢铁、化工、采掘、有色金属等行业涨幅明显，而家电、非银金融、国防军工、房地产、农林牧渔等行业表现落后。

报告期内，在市场较为剧烈波动的过程中，国寿安保智慧生活基金维持了中高权益仓位配置，围绕科技制造和新消费两大方向进行个股选择，行业配置以电新、电子、机械、化工、轻工等行业为主。

##### 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 1.960 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.30%，业绩比较基准收益率为 0.49%。

#### 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，由于新冠病毒出现新的变异，全球疫情可能会面临新的反复。由于疫苗接种率的逐步提升，新冠疫情的影响总体可控。基于这个判断，全球产业链和供应链的再平衡仍需要一段时间。在未来某一时点，一旦疫情的影响得到全面控制，全球经济相应进入复苏通道，全球流动性的拐点可能会出现。

从 A 股市场的演绎来看，春节之后，市场先抑后扬，出现了风格均衡化的变化，中小盘股的表现整体优于大盘股的表现。顺应新发展格局，科技创新逐步成为市场运行的主线，风险偏好出现了积极的变化，以新能源、电动车、芯片制造产业链相关的

行业和个股出现了较大幅度的上涨。特别是，部分长期不被关注的细分行业以“专精特新”为特点的中小市值公司，重新获得了市场资金的青睐。

未来一段时间，我们会顺应新发展格局的大趋势，围绕科技制造和新消费两大方向进行行业布局，深度挖掘相应的投资机会，寻找具备中长期成长潜力的优质公司进行配置。我们将一如既往的依靠团队智慧，为基金持有人创造较好的中长期回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

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

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人

利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

## 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

本托管人复核审查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。

## § 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：国寿安保智慧生活股票型证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	22,770,133.53	27,636,476.63
结算备付金		61,790.85	296,514.16
存出保证金		44,526.44	31,028.80
交易性金融资产	6.4.7.2	196,776,884.38	339,954,570.33
其中：股票投资		196,776,884.38	336,409,420.33
基金投资		-	-
债券投资		-	3,545,150.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		456,285.55	532,542.10
应收利息	6.4.7.5	2,260.66	16,260.02
应收股利		-	-
应收申购款		49,419.41	20,786.34
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-

资产总计		220,161,300.82	368,488,178.38
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
<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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		614,490.42	193,126.15
应付管理人报酬		257,557.47	454,670.55
应付托管费		42,926.23	75,778.41
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	120,036.84	42,100.12
应交税费		-	77.42
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	90,688.31	180,291.85
负债合计		1,125,699.27	946,044.50
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	111,733,016.23	206,829,232.10
未分配利润	6.4.7.10	107,302,585.32	160,712,901.78
所有者权益合计		219,035,601.55	367,542,133.88
负债和所有者权益总计		220,161,300.82	368,488,178.38

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.960 元，基金份额总额 111,733,016.23 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保智慧生活股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年1月1日至2021年 6月30日	2020年1月1日至2020 年6月30日
一、收入		19,951,287.02	53,500,526.48
1. 利息收入		63,807.02	111,124.79
其中：存款利息收入	6.4.7.11	53,891.17	97,643.49
债券利息收入		9,915.85	13,481.30
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）		77,811,008.57	33,375,798.10
其中：股票投资收益	6.4.7.12	75,698,530.62	31,142,711.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	122,677.62	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,989,800.33	2,233,086.21
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-58,012,020.85	19,929,487.22
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	88,492.28	84,116.37
减：二、费用		3,338,800.22	2,874,820.54
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,415,023.47	2,071,100.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	402,503.88	345,183.39
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	429,392.87	362,092.76
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		35.58	48.42
7. 其他费用	6.4.7.20	91,844.42	96,395.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,612,486.80	50,625,705.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,612,486.80	50,625,705.94

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保智慧生活股票型证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	206,829,232.10	160,712,901.78	367,542,133.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	16,612,486.80	16,612,486.80
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-95,096,215.87	-70,022,803.26	-165,119,019.13

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	5,393,796.37	4,417,853.17	9,811,649.54
2.基金赎回款	-100,490,012.24	-74,440,656.43	-174,930,668.67
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	111,733,016.23	107,302,585.32	219,035,601.55
项目	上年度可比期间		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	260,761,496.09	51,743,276.86	312,504,772.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	50,625,705.94	50,625,705.94
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-59,947,003.28	-16,839,756.18	-76,786,759.46
其中：1.基金申购款	41,454,526.70	11,597,882.57	53,052,409.27
2.基金赎回款	-101,401,529.98	-28,437,638.75	-129,839,168.73
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	200,814,492.81	85,529,226.62	286,343,719.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆	王文英	韩占锋
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

国寿安保智慧生活股票型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]1469号文《关于准予国寿安保智慧生活股票型证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于2015年8月10日至2015年8月28日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明(2015)验字第第61090605\_A06号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2015年9月1日正式生效，首次设立募集规模为684,083,729.31份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保基金管理

有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、权证、债券资产（国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、现金资产、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金股票投资比例不低于基金资产的 80%，其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。本基金将不低于 80% 的非现金基金资产投资于本基金所界定的智慧生活相关股票。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 3 号<半年度报告的内容与格式>》《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2021 年 06 月 30 日的财务状况以及 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

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

本报告期内所采用的会计政策、会计估值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

无。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

无。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

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

### 6.4.6.2 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%

的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

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

#### 6.4.6.3 企业所得税

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

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	22,770,133.53
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	22,770,133.53

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	131,786,763.62	196,776,884.38	64,990,120.76
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	131,786,763.62	196,776,884.38	64,990,120.76

##### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,212.76
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	27.80
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	20.10
合计	2,260.66

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
交易所市场应付交易费用	120,036.84
银行间市场应付交易费用	-
合计	120,036.84

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,428.16
应付证券出借违约金	-
预提费用	89,260.15
合计	90,688.31

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,829,232.10	206,829,232.10
本期申购	5,393,796.37	5,393,796.37
本期赎回（以“-”号填列）	-100,490,012.24	-100,490,012.24
- 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	111,733,016.23	111,733,016.23

注：本期申购包含基金转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	58,250,703.02	102,462,198.76	160,712,901.78
本期利润	74,624,507.65	-58,012,020.85	16,612,486.80
本期基金份额交易产生的变动数	-52,095,441.58	-17,927,361.68	-70,022,803.26
其中：基金申购款	2,410,701.54	2,007,151.63	4,417,853.17
基金赎回款	-54,506,143.12	-19,934,513.31	-74,440,656.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,779,769.09	26,522,816.23	107,302,585.32

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	活期存款利息收入	
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		700.44
其他		236.91
合计		53,891.17

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	股票投资收益——买卖股票差价收入	

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	75,698,530.62

#### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出股票成交总额	208,951,266.08
减：卖出股票成本总额	133,252,735.46
买卖股票差价收入	75,698,530.62

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	122,677.62
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	122,677.62

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	3,684,082.88
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,537,998.30
减：应收利息总额	23,406.96
买卖债券差价收入	122,677.62

**6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入**

无。

**6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入**

无。

**6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益**

本基金于本报告期间无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

本基金于本报告期间无贵金属投资收益。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,989,800.33
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	1,989,800.33

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	-58,012,020.85
股票投资	-57,945,869.15
债券投资	-66,151.70
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2.衍生工具	-
权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-58,012,020.85

**6.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	88,342.11
基金转换费收入	150.17
合计	88,492.28

**6.4.7.19 交易费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	429,392.87
银行间市场交易费用	-
合计	429,392.87

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	2,584.27
合计	91,844.42

**6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

截至财务报表批准日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

**6.4.9 关联方关系****6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期内不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）	基金托管人、销售机构

广发银行股份有限公司（简称“广发银行”）	基金管理人股东之股东的联营企业、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,415,023.47	2,071,100.45
其中：支付销售机构的客户维护费	85,500.79	74,402.59

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

$$H = E \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	402,503.88	345,183.39

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

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

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

无。

##### 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

无。

#### 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

本基金本报告期末基金管理人未有运用固有资金投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例(%)
中国人寿	52,282,635.52	46.79	132,282,635.52	63.96

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
建设银行	22,770,133.53	52,953.82	27,095,980.76	96,446.19

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末(2021年6月30日)本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	336	8,265.60	54,768.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	468	11,554.92	14,840.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-

			日								
300942	易瑞生物	2021年 2月2日	2021年 8月9日	新股流 通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300943	春晖智 控	2021年 2月3日	2021年 8月10日	新股流 通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55		-
300945	曼卡龙	2021年 2月3日	2021年 8月10日	新股流 通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12		-
300948	冠中生 态	2021年 2月18日	2021年 8月25日	新股流 通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	锁定期内 发生送股	
300950	德固特	2021年 2月24日	2021年 9月3日	新股流 通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47		-
300953	震裕科 技	2021年 3月11日	2021年 9月22日	新股流 通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00		-
300955	嘉亨家 化	2021年 3月16日	2021年 9月24日	新股流 通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24		-
300956	英力股 份	2021年 3月16日	2021年 9月27日	新股流 通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80		-
300957	贝泰妮	2021年 3月18日	2021年 9月27日	新股流 通受限	47.33	251.96	256	12,116.48	64,501.76		-
300958	建工修 复	2021年 3月18日	2021年 9月29日	新股流 通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300960	通业科 技	2021年 3月22日	2021年 9月29日	新股流 通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-
300961	深水海 纳	2021年 3月23日	2021年 9月30日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58		-
300962	中金辐 照	2021年 3月29日	2021年 10月11日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12		-
300963	中洲特 材	2021年 3月30日	2021年 10月11日	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67		-
300966	共同药	2021年	2021年	新股流	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44		-

	业	3月31日	10月11日	通受限						
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	219	6,193.32	25,340.49	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	416	13,819.52	36,400.00	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-

300995	奇德新材	2021年 5月17 日	2021年 11月26 日	新股流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股流 通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年 5月26 日	2021年 12月2 日	新股流 通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年 5月25 日	2021年 12月2 日	新股流 通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年 5月27 日	2021年 12月7 日	新股流 通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年 6月18 日	2021年 12月27 日	新股流 通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年 6月4日	2021年 12月16 日	新股流 通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年 6月9日	2021年 12月20 日	新股流 通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年 6月9日	2021年 12月17 日	新股流 通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年 6月15 日	2021年 12月22 日	新股流 通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年 6月21 日	2021年 12月29 日	新股流 通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年 6月22 日	2021年 12月30 日	新股流 通受限	7.64	38.83	385	2,941.40	14,949.55	-
301016	雷尔伟	2021年 6月23 日	2021年 12月30 日	新股流 通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2021年 7月5 日	新股未 上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2022年 1月5 日	新股流 通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-

		日	日								
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96		-
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股流 通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股流 通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40		-
605162	新中港	2021年 6月29 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39		-
605287	德才股份	2021年 6月28 日	2021年 7月6 日	新股未 上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44		-
688087	英科再生	2021年 6月30 日	2021年 7月9 日	新股未 上市	21.96	21.96	1,975	43,371.00	43,371.00		-
688216	气派科技	2021年 6月15 日	2021年 12月23 日	新股流 通受限	14.82	47.64	1,750	25,935.00	83,370.00		-
688226	威腾电气	2021年 6月28 日	2021年 7月7 日	新股未 上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06		-
688317	之江生物	2021年 1月8日	2021年 7月19 日	新股流 通受限	43.22	63.82	2,337	101,005.14	149,147.34		-
688395	正弦电气	2021年 4月21 日	2021年 10月29 日	新股流 通受限	15.95	22.37	1,627	25,950.65	36,395.99		-
688499	利元亨	2021年 6月23 日	2021年 7月1 日	新股未 上市	38.85	38.85	1,389	53,962.65	53,962.65		-
688611	杭州柯林	2021年 4月1日	2021年 10月12 日	新股流 通受限	33.44	42.34	1,400	46,816.00	59,276.00		-
688636	智明达	2021年 3月30 日	2021年 10月8 日	新股流 通受限	34.50	80.72	918	31,671.00	74,100.96		-
688660	电气风电	2021年	2021年	新股流	5.44	7.26	17,079	92,909.76	123,993.54		-

	电	5月11日	11月19日	通受限						
688663	新风光	2021年4月6日	2021年10月13日	新股流通受限	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
688683	莱尔科技	2021年4月1日	2021年10月12日	新股流通受限	9.51	14.73	3,296	31,344.96	48,550.08	-
688689	银河微电	2021年1月15日	2021年7月27日	新股流通受限	14.01	35.62	3,258	45,644.58	116,049.96	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限证券。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

##### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证

券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放期内可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金主要投资于上市交易的证券，因此均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、买入返售金融资产及结算保证金等。本基金于本报告期末未持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,770,133.53	-	-	-	22,770,133.53
结算备付金	61,790.85	-	-	-	61,790.85
存出保证金	44,526.44	-	-	-	44,526.44
交易性金融资产	-	-	-	196,776,884.38	196,776,884.38
应收利息	-	-	-	2,260.66	2,260.66
应收申购款	-	-	-	49,419.41	49,419.41
应收证券清算款	-	-	-	456,285.55	456,285.55
资产总计	22,876,450.82	-	-	197,284,850.00	220,161,300.82
负债					
应付赎回款	-	-	-	614,490.42	614,490.42
应付管理人报酬	-	-	-	257,557.47	257,557.47
应付托管费	-	-	-	42,926.23	42,926.23
应付交易费用	-	-	-	120,036.84	120,036.84
其他负债	-	-	-	90,688.31	90,688.31
负债总计	-	-	-	1,125,699.27	1,125,699.27
利率敏感度缺口	22,876,450.82	-	-	196,159,150.73	219,035,601.55
上年度末 2020年12月31日					
资产					
银行存款	27,636,476.63	-	-	-	27,636,476.63
结算备付金	296,514.16	-	-	-	296,514.16
存出保证金	31,028.80	-	-	-	31,028.80
交易性金融资产	-	3,545,150.00	-	336,409,420.33	339,954,570.33
应收利息	-	-	-	16,260.02	16,260.02
应收申购款	-	-	-	20,786.34	20,786.34

应收证券清算款	-	-	-	532,542.10	532,542.10
资产总计	27,964,019.59	3,545,150.00	-	336,979,008.79	368,488,178.38
负债					
应付赎回款	-	-	-	193,126.15	193,126.15
应付管理人报酬	-	-	-	454,670.55	454,670.55
应付托管费	-	-	-	75,778.41	75,778.41
应付交易费用	-	-	-	42,100.12	42,100.12
应交税费	-	-	-	77.42	77.42
其他负债	-	-	-	180,291.85	180,291.85
负债总计	-	-	-	946,044.50	946,044.50
利率敏感度缺口	27,964,019.59	3,545,150.00	-	336,032,964.29	367,542,133.88

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金为股票型证券投资基金，于本报告期末未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或

未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金股票投资比例不低于基金资产的 80%，其中，权证投资比例不超过基金资产净值的 3%；现金或者到期日在一年以内的政府债券投资比例合计不低于基金资产净值的 5%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	196,776,884.38	89.84	336,409,420.33	91.53
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	3,545,150.00	0.96
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	196,776,884.38	89.84	339,954,570.33	92.49

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	2 用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
		本期末（2021年6月30日）	上年度末（2020年12月31日）
分析	-5%	-9,550,054.76	-21,849,639.47
	5%	9,550,054.76	21,849,639.47

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.14.1 公允价值

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

##### (1) 各层次金融工具公允价值

本基金本报告期末持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 195,164,852.57 元（上年度末为 336,086,159.88 元），属于第二层次的余额为人民币 1,612,031.81 元（上年度末为 3,868,410.45），无属于第三层次的余额。

##### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具，在第一层次和第二层次之间无重大转移。本基金本报告期持有的以公允价值计量的金融工具未发生转入或转出第三层次公

允价值的情况。

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	196,776,884.38	89.38
	其中：股票	196,776,884.38	89.38
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	22,831,924.38	10.37
8	其他各项资产	552,492.06	0.25
9	合计	220,161,300.82	100.00

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	38,638.20	0.02
B	采矿业	10,512.39	0.00
C	制造业	188,722,632.95	86.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	131,317.43	0.06
E	建筑业	47,572.87	0.02
F	批发和零售业	92,587.67	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	20,316.60	0.01

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	354,279.40	0.16
J	金融业	97,319.40	0.04
K	房地产业	10,095.90	0.00
L	租赁和商务服务业	65,464.36	0.03
M	科学研究和技术服务业	6,891,300.00	3.15
N	水利、环境和公共设施管理业	276,417.51	0.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	18,429.70	0.01
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	196,776,884.38	89.84

### 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港股通股票。

### 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	002138	顺络电子	270,000	10,467,900.00	4.78
2	603899	晨光文具	119,000	10,062,640.00	4.59
3	603348	文灿股份	270,000	9,450,000.00	4.31
4	300207	欣旺达	280,000	9,116,800.00	4.16
5	300082	奥克股份	700,000	8,680,000.00	3.96
6	300408	三环集团	200,082	8,487,478.44	3.87
7	600703	三安光电	249,800	8,006,090.00	3.66
8	600563	法拉电子	50,000	7,918,000.00	3.61
9	600031	三一重工	270,751	7,870,731.57	3.59
10	300587	天铁股份	340,000	7,633,000.00	3.48
11	002028	思源电气	240,000	7,389,600.00	3.37
12	002409	雅克科技	90,000	7,290,000.00	3.33
13	000338	潍柴动力	399,912	7,146,427.44	3.26
14	002484	江海股份	450,000	6,966,000.00	3.18
15	600885	宏发股份	110,800	6,947,160.00	3.17
16	603859	能科股份	190,000	6,891,300.00	3.15
17	603195	公牛集团	34,000	6,868,000.00	3.14
18	300241	瑞丰光电	860,000	6,338,200.00	2.89
19	600309	万华化学	57,807	6,290,557.74	2.87
20	002993	奥海科技	130,000	5,661,500.00	2.58
21	603989	艾华集团	169,286	5,517,030.74	2.52

22	002706	良信股份	242,684	5,470,097.36	2.50
23	002851	麦格米特	170,000	5,309,100.00	2.42
24	601231	环旭电子	300,800	5,056,448.00	2.31
25	002705	新宝股份	190,005	4,987,631.25	2.28
26	002262	恩华药业	300,000	4,605,000.00	2.10
27	000725	京东方 A	699,955	4,367,719.20	1.99
28	603699	纽威股份	200,000	2,100,000.00	0.96
29	688777	中控技术	2,788	262,490.20	0.12
30	300912	凯龙高科	5,117	200,432.89	0.09
31	605499	东鹏饮料	632	158,505.60	0.07
32	688317	之江生物	2,337	149,147.34	0.07
33	688136	科兴制药	3,727	138,197.16	0.06
34	688276	百克生物	1,287	134,594.46	0.06
35	688660	电气风电	17,079	123,993.54	0.06
36	688689	银河微电	3,258	116,049.96	0.05
37	688216	气派科技	1,750	83,370.00	0.04
38	688636	智明达	918	74,100.96	0.03
39	300957	贝泰妮	256	64,501.76	0.03
40	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.03
41	601665	齐鲁银行	6,731	62,598.30	0.03
42	300869	康泰医学	862	61,046.84	0.03
43	688611	杭州柯林	1,400	59,276.00	0.03
44	300919	中伟股份	336	54,768.00	0.03
45	688499	利元亨	1,389	53,962.65	0.02
46	601156	东航物流	2,090	49,470.30	0.02
47	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
48	688683	莱尔科技	3,296	48,550.08	0.02
49	688618	三旺通信	1,117	47,718.24	0.02
50	603529	爱玛科技	793	46,089.16	0.02
51	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
52	688087	英科再生	1,975	43,371.00	0.02
53	003039	顺控发展	1,024	42,813.44	0.02
54	300894	火星人	628	42,704.00	0.02
55	605339	南侨食品	864	37,307.52	0.02
56	300979	华利集团	416	36,400.00	0.02
57	688395	正弦电气	1,627	36,395.99	0.02
58	605090	九丰能源	1,090	35,326.90	0.02
59	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.02
60	300870	欧陆通	478	29,884.56	0.01
61	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
62	001201	东瑞股份	668	27,347.92	0.01
63	300973	立高食品	219	25,340.49	0.01

64	300871	回盛生物	618	24,102.00	0.01
65	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
66	605080	浙江自然	374	23,487.20	0.01
67	603759	海天股份	1,119	22,939.50	0.01
68	300867	圣元环保	749	22,702.19	0.01
69	001207	联科科技	682	22,581.02	0.01
70	605378	野马电池	473	21,729.62	0.01
71	300911	亿田智能	309	21,407.52	0.01
72	001206	依依股份	321	20,389.92	0.01
73	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
74	605305	中际联合	368	19,364.16	0.01
75	605122	四方新材	703	18,770.10	0.01
76	003032	传智教育	586	18,429.70	0.01
77	300900	广联航空	469	17,531.22	0.01
78	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.01
79	605368	蓝天燃气	1,204	17,217.20	0.01
80	605179	一鸣食品	939	16,836.27	0.01
81	300913	兆龙互连	630	16,506.00	0.01
82	605377	华旺科技	1,050	16,212.00	0.01
83	605196	华通线缆	1,172	16,079.84	0.01
84	605300	佳禾食品	576	16,012.80	0.01
85	603836	海程邦达	733	15,994.06	0.01
86	605299	舒华体育	738	15,874.38	0.01
87	300925	法本信息	600	15,774.00	0.01
88	300890	翔丰华	286	15,615.60	0.01
89	301015	百洋医药	385	14,949.55	0.01
90	300908	仲景食品	250	14,897.50	0.01
91	300932	三友联众	468	14,840.28	0.01
92	300898	熊猫乳品	397	14,395.22	0.01
93	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
94	003027	同兴环保	523	14,251.75	0.01
95	605016	百龙创园	445	14,222.20	0.01
96	605180	华生科技	384	14,208.00	0.01
97	300872	天阳科技	387	14,048.10	0.01
98	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
99	605060	联德股份	883	13,933.74	0.01
100	300907	康平科技	473	13,915.66	0.01
101	605319	无锡振华	764	13,706.16	0.01
102	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.01
103	003030	祖名股份	480	13,516.80	0.01
104	605500	森林包装	762	13,464.54	0.01
105	605133	嵘泰股份	618	13,398.24	0.01

106	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
107	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
108	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
109	300902	国安达	551	12,981.56	0.01
110	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
111	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
112	300877	金春股份	342	12,575.34	0.01
113	603171	税友股份	637	12,230.40	0.01
114	605286	同力日升	597	12,208.65	0.01
115	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.01
116	003036	泰坦股份	776	11,958.16	0.01
117	003042	中农联合	420	11,839.80	0.01
118	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
119	300895	铜牛信息	340	11,563.40	0.01
120	300873	海晨股份	264	11,301.84	0.01
121	605303	园林股份	610	11,242.30	0.01
122	605488	福莱新材	416	11,103.04	0.01
123	300918	南山智尚	1,063	11,065.83	0.01
124	605287	德才股份	349	11,014.44	0.01
125	605289	罗曼股份	380	10,959.20	0.01
126	605055	迎丰股份	1,146	10,909.92	0.00
127	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
128	300878	维康药业	229	10,687.43	0.00
129	605086	龙高股份	443	10,512.39	0.00
130	605189	富春染织	423	10,190.07	0.00
131	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
132	300917	特发服务	365	10,095.90	0.00
133	300922	天秦装备	287	9,996.21	0.00
134	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
135	003033	征和工业	301	9,538.69	0.00
136	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
137	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
138	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
139	001202	炬申股份	459	9,014.76	0.00
140	300881	盛德鑫泰	291	8,959.89	0.00
141	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
142	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
143	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
144	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
145	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
146	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
147	300868	杰美特	270	8,264.70	0.00

148	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
149	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
150	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
151	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
152	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
153	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
154	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
155	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
156	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
157	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
158	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
159	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
160	300886	华业香料	191	6,194.13	0.00
161	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
162	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
163	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
164	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
165	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
166	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
167	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
168	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
169	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
170	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
171	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
172	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300082	奥克股份	10,040,328.64	2.73
2	603859	能科股份	6,968,222.00	1.90
3	002484	江海股份	6,387,618.04	1.74
4	002993	奥海科技	6,203,271.00	1.69
5	300587	天铁股份	6,179,085.00	1.68
6	002028	思源电气	4,111,475.00	1.12
7	000725	京东方 A	3,900,801.50	1.06
8	300136	信维通信	1,742,604.00	0.47
9	300979	华利集团	138,195.20	0.04
10	300957	贝泰妮	120,975.48	0.03
11	688183	生益电子	116,760.42	0.03

12	300932	三友联众	115,351.68	0.03
13	688079	美迪凯	105,232.13	0.03
14	688317	之江生物	101,005.14	0.03
15	688660	电气风电	92,909.76	0.03
16	688083	中望软件	90,149.50	0.02
17	300941	创识科技	85,005.59	0.02
18	688687	凯因科技	82,031.56	0.02
19	601963	重庆银行	80,921.76	0.02
20	300968	格林精密	79,829.40	0.02

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	002706	良信股份	25,418,404.58	6.92
2	300724	捷佳伟创	18,133,373.73	4.93
3	600176	中国巨石	14,098,727.00	3.84
4	600309	万华化学	9,315,081.60	2.53
5	603899	晨光文具	8,398,430.36	2.29
6	600563	法拉电子	8,226,754.00	2.24
7	300136	信维通信	7,905,042.76	2.15
8	600885	宏发股份	7,784,182.00	2.12
9	600750	江中药业	7,231,293.00	1.97
10	600089	特变电工	7,011,659.00	1.91
11	000725	京东方 A	7,011,000.00	1.91
12	300207	欣旺达	6,498,126.00	1.77
13	002138	顺络电子	5,904,544.16	1.61
14	002705	新宝股份	5,886,210.63	1.60
15	002815	崇达技术	5,134,071.80	1.40
16	600031	三一重工	4,944,791.00	1.35
17	002028	思源电气	4,832,607.00	1.31
18	000915	华特达因	4,690,761.00	1.28
19	600699	均胜电子	4,229,898.40	1.15
20	300686	智动力	4,076,324.00	1.11

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	51,566,068.66
--------------	---------------

卖出股票收入（成交）总额	208,951,266.08
--------------	----------------

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投资组合。

#### 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

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

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

##### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资前十名股票未超出基金合同的投资范围。

##### 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	44,526.44

2	应收证券清算款	456,285.55
3	应收股利	-
4	应收利息	2,260.66
5	应收申购款	49,419.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	552,492.06

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

#### 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 (%)
26,790	4,170.70	96,750,533.55	86.59	14,982,482.68	13.41

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	735,693.23	0.66

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	50~100
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 9 月 1 日）基金份额总额	684,083,729.31
本报告期期初基金份额总额	206,829,232.10
本报告期基金总申购份额	5,393,796.37
减：本报告期基金总赎回份额	100,490,012.24
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	111,733,016.23

## § 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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人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	
长江证券	1	156,275,530.13	61.41%	114,285.17	62.49%	-
方正证券	1	66,053,844.69	25.96%	48,304.48	26.41%	-
华泰证券	1	32,155,296.44	12.64%	20,299.22	11.10%	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

### 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
长江证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	3,660,685.62	100.00%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

### 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	国寿安保智慧生活股票型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 22 日
2	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告（全上线基金）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 4 日
3	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加招商银行股份有限公司（招赢通平台）费率优惠活动的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 10 日
4	国寿安保智慧生活股票型证券投资基金 2020 年年度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告（全上线基金）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 1 日
6	国寿安保智慧生活股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
7	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司费率优惠活动的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 28 日
8	国寿安保智慧生活股票型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	2021 年 6 月 8 日
9	国寿安保智慧生活股票型证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 6 月 8 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20210101~20210630	132,282,635.52	-	80,000,000.00	52,282,635.52	46.79
	2	20210517~20210630	34,991,446.35	-	-	34,991,446.35	31.32
个人	-	-	-	-	-	-	-

**产品特有风险**

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 12.1.1 中国证监会批准国寿安保智慧生活股票型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保智慧生活股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保智慧生活股票型证券投资基金托管协议》
- 12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照
- 12.1.5 报告期内国寿安保智慧生活股票型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告
- 12.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 12.2 存放地点

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

号楼 11 层

### 12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息：[www.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

2021 年 8 月 31 日