

国寿安保稳丰 6 个月持有期 混合型证券投资基金 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：中国民生银行股份有限公司

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。

基金托管人中国民生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

§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.....	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
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.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
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.....	44
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.....	45

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.....	45
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.....	45
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45
7.12 投资组合报告附注.....	45
§8 基金份额持有人信息.....	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
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.....	47
§9 开放式基金份额变动.....	47
§10 重大事件揭示.....	48
10.1 基金份额持有人大会决议.....	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	48
10.4 基金投资策略的改变.....	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	48
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.....	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	48
10.8 其他重大事件.....	49
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
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.....	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§12 备查文件目录.....	50
12.1 备查文件目录.....	50
12.2 存放地点.....	51
12.3 查阅方式.....	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	国寿安保稳丰 6 个月持有混合	
基金主代码	009244	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 8 月 5 日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	594,656,877.00 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	009244	009245
报告期末下属分级基金的份额总额	400,576,880.45 份	194,079,996.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具，同时通过量化策略精选个股，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	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。
业绩比较基准	中债综合（全价）指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为混合型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

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	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	罗菲菲
	联系电话	010-50850744	010-58560666
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgbfxjdzx@cmbc.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95568
传真		010-50850776	010-58560798
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区复兴门内大街 2 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 2 号
邮政编码		100033	100031
法定代表人		王军辉	高迎欣

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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)	
	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C
本期已实现收益	23,695,407.02	9,463,479.99
本期利润	18,362,409.07	6,756,566.45
加权平均基金份额本期利润	0.0351	0.0303
本期加权平均净值利润率	3.36%	2.91%
本期基金份额净值增长率	3.35%	3.20%
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	21,420,789.50	9,816,455.40
期末可供分配基金份额利润	0.0535	0.0506
期末基金资产净值	425,093,927.56	205,394,088.29
期末基金份额净值	1.0612	1.0583
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	6.12%	5.83%

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

国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A

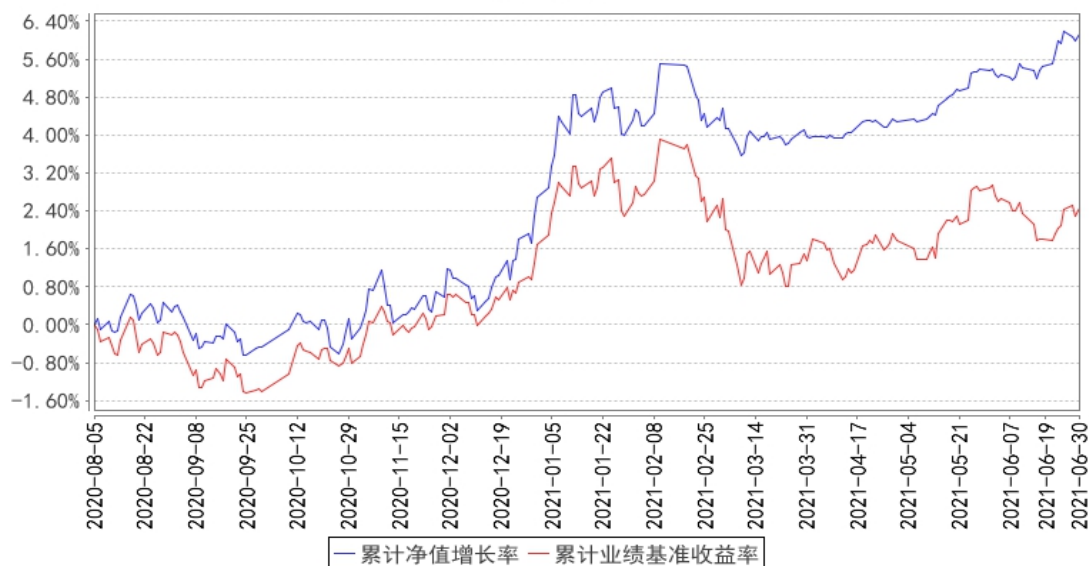
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.71%	0.13%	-0.43%	0.17%	1.14%	-0.04%
过去三个月	2.07%	0.10%	1.09%	0.20%	0.98%	-0.10%
过去六个月	3.35%	0.21%	0.73%	0.27%	2.62%	-0.06%
自基金合同生效起至今	6.12%	0.22%	2.45%	0.24%	3.67%	-0.02%

国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C

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	0.68%	0.13%	-0.43%	0.17%	1.11%	-0.04%
过去三个月	1.99%	0.10%	1.09%	0.20%	0.90%	-0.10%
过去六个月	3.20%	0.21%	0.73%	0.27%	2.47%	-0.06%
自基金合同生效起至今	5.83%	0.22%	2.45%	0.24%	3.38%	-0.02%

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

国寿安保稳丰6个月持有混合A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



国寿安保稳丰6个月持有混合C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 2020 年 08 月 05 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 2020 年 08 月 05 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		
吴闻	本基金的基金经理	2020年8月5日	-	13年	吴闻先生，硕士。曾任中信证券股份有限公司债务资本市场部高级经理，固定收益部副总裁，2014年9月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保灵活优选混合型证券投资基金、国寿安保稳荣混合型证券投资基金、国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金、国寿安保安吉纯债半年定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保稳吉混合型证券投资基金、国寿安保尊盛双债债券型证券投资基金及国寿安保稳丰6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。
李康	本基金的基金经理	2020年8月5日	-	12年	李康先生，博士研究生。2009年10月至2012年12月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012年12月至2013年11月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保沪深300交

					易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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 年上半年欧美发达经济体延续复苏态势，新兴市场国家经济修复相对缓慢，经济复苏分化带来供需阶段性错配，大宗商品价格维持在较高位。中国经济延续复苏态势，宏观经济处于从快速复苏向常态化回归的过程中，主要宏观指标处于合理区间，但经济恢复仍不平衡，出口强劲支撑了工业生产增速，国内消费和投资的恢复明显偏

慢。上半年全球大宗商品价格上涨推高了国内 PPI 涨幅，但是核心通胀涨幅总体维持在低位，呈现高 PPI、低 CPI 并存的局面。

货币政策方面，央行维持灵活精准、合理适度的货币政策基调，保持流动性合理充裕，货币市场利率围绕公开市场操作利率和中期借贷便利利率波动，人民币汇率在合理均衡水平上基本稳定。1 月末资金面有所波动，此后货币市场总体较为平稳。

债券市场方面，上半年资金利率总体平稳，尽管大宗商品价格短期上升，但经济动能边际放缓、供需关系相对有利等因素推动债券市场收益率小幅下行。信用债方面，中高等级和低等级信用债延续分化表现，高等级信用债利差位于低位。转债方面，上半年转债市场小幅上涨，低估值转债有所修复。

股票市场方面，上半年 A 股震荡加剧，行业结构分化较为显著，上证综指上涨 3.4%，深圳成指上涨约 4.8%，创业板综指上涨约 14.1%。上半年表现较好的行业分别为电气设备、钢铁、化工、采掘等，表现相对较弱的行业分别为家用电器、非银金融、国防军工、房地产等。

投资运作方面，本基金在报告期内以利率债和高等级信用债为主要投资品种，维持组合中高久期。股票方面，主要以多因子模型建立股票多头，以基本面因子为主，辅以技术因子把握投资时点，在权益仓位上保持一定的灵活调整空间，积极应对市场波动。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A 基金份额净值为 1.0612 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.35%；截至本报告期末国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C 基金份额净值为 1.0583 元，本报告期基金份额净值增长率为 3.20%；业绩比较基准收益率为 0.73%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年下半年中国经济可能将延续复苏不均衡的态势。出口上半年高增长但未来可能在海外供应链复苏的情况下逐步回落，房地产投资受监管政策加强影响存在下行压力，基建投资在财政政策更加积极影响下有望托底但实际力度待观察，制造业投资温和回升，消费恢复速度可能仍然偏慢。物价方面，全球大宗商品价格上涨阶段性推升我国 PPI，但输入性通胀的风险总体可控，CPI 继续位于低位。

政策方面，2021 年 7 月央行宣布全面降准 0.5 个百分点，降准时点和方式超出市场预期。预计央行下半年将在保持战略定力的基础上注重灵活适度，继续保持对制造

业和小微企业的金融支持，宏观流动性将合理充裕。

债券市场方面，经济增长数据分化，CPI 低位运行、PPI 阶段性高企，央行保持流动性合理充裕，利率债发行量阶段性加大，预计债券市场短期呈现震荡格局。信用债方面，信用分化格局将延续，投资需要继续以中高等级信用债为主要配置品种，严控信用风险。

股票市场方面，下半年金融市场资金利率有望维持平稳，A 股市场在经历上半年的大幅波动后，再度回到以企业盈利为主的结构性行情中，高景气公司有望继续获得市场青睐。从量化策略的角度，需要更加重视上市公司基本面因子与估值因子的相互匹配，同时以行业轮动策略把握结构化投资机会。

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及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

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

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

本报告期内，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、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方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为，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

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

§ 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：国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	10,415,085.42	7,645,924.26
结算备付金		3,918,508.71	7,224,649.42
存出保证金		155,449.42	292,335.66
交易性金融资产	6.4.7.2	713,004,415.52	980,268,987.53
其中：股票投资		88,667,924.92	174,242,106.45
基金投资		-	-
债券投资		624,336,490.60	806,026,881.08
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	16,000,000.00	24,000,000.00
应收证券清算款		2,265,176.54	8,860,544.83
应收利息	6.4.7.5	9,822,145.64	7,757,128.49
应收股利		-	-
应收申购款		367,280.92	170.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		755,948,062.17	1,036,049,740.19
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
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		111,000,000.00	134,000,000.00
应付证券清算款		9,120,012.07	11,693,121.98
应付赎回款		4,589,796.34	-
应付管理人报酬		417,643.58	592,372.98
应付托管费		78,308.15	111,069.93
应付销售服务费		50,395.81	56,521.88
应付交易费用	6.4.7.7	60,084.21	496,734.71
应交税费		24,409.57	29,141.93
应付利息		30,136.44	-49,906.85
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	89,260.15	90,000.00
负债合计		125,460,046.32	147,019,056.56
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	594,656,877.00	866,122,677.35
未分配利润	6.4.7.10	35,831,138.85	22,908,006.28
所有者权益合计		630,488,015.85	889,030,683.63
负债和所有者权益总计		755,948,062.17	1,036,049,740.19

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 594,656,877.00 份，其中国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A 基金份额总额 400,576,880.45 份，基金份额净值 1.0612 元；国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C 基金份额总额 194,079,996.55 份，基金份额净值 1.0583 元。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金

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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6
-----	-----	--------------------------------

		月 30 日
一、收入		31,485,100.68
1. 利息收入		11,412,037.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	60,253.16
债券利息收入		11,081,771.95
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		270,012.37
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		28,112,974.69
其中：股票投资收益	6.4.7.12	32,884,563.67
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,772,450.30
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-
股利收益	6.4.7.16	1,000,861.32
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-8,039,911.49
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	-
减：二、费用		6,366,125.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,111,971.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	583,494.56
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	347,350.02
4. 交易费用	6.4.7.19	641,468.51
5. 利息支出		1,549,423.56
其中：卖出回购金融资产支出		1,549,423.56
6. 税金及附加		14,201.60
7. 其他费用	6.4.7.20	118,215.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		25,118,975.52
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		25,118,975.52

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金

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	866,122,677.35	22,908,006.28	889,030,683.63

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	25,118,975.52	25,118,975.52
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)	-271,465,800.35	-12,195,842.95	-283,661,643.30
其中：1. 基金申购款	434,341,424.93	19,458,139.22	453,799,564.15
2. 基金赎回款	-705,807,225.28	-31,653,982.17	-737,461,207.45
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)	594,656,877.00	35,831,138.85	630,488,015.85

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

国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金（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”）《关于准予国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2020]450 号）核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2020 年 7 月 6 日至 2020 年 7 月 31 日向社会公开募集，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（2020）验字第 61090605_A10 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 2020 年 8 月 5 日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金将基金份额分为 A 类和 C 类不同的类别。在投资人认（申）购和赎回时，收取认（申）购费和赎回费，不收取销售服务费的，称为 A 类基金份额；收取销售服务费和赎回费，不收取认（申）购费的，称为 C 类基金份额。首次募集规模为 611,720,540.25 份 A 类基金份额，176,708,824.63 份 C 类基金份额。本基金 A 类及 C 类收到的实收基金合计人民币 788,429,364.88 元，分别折合成 A 类和 C 类基金份额，合计折合 788,429,364.88

份基金份额。本基金的基金管理人和注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国民生银行股份有限公司（简称“民生银行”）。

本基金的投资范围主要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、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、证券公司短期公司债、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货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）。本基金可以参与融资交易。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-30%；本基金持有的同业存单，其投资比例不得超过基金资产的 20%；每个交易日日终在扣除股指期货和国债期货需缴纳的交易保证金后，本基金持有不低于基金资产净值的 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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

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	10,415,085.42
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	10,415,085.42

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	82,834,210.58	88,667,924.92	5,833,714.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	319,493,154.99	320,476,490.60
	银行间市场	303,226,208.73	303,860,000.00
	合计	622,719,363.72	624,336,490.60
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	705,553,574.30	713,004,415.52	7,450,841.22

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

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	16,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	16,000,000.00	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末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	2,038.35
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	1,763.30
应收债券利息	9,818,273.99
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	70.00
合计	9,822,145.64

6.4.7.6 其他资产

本基金于本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	57,413.60
银行间市场应付交易费用	2,670.61
合计	60,084.21

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

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

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A

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	645,119,838.39	645,119,838.39
本期申购	294,700,697.90	294,700,697.90
本期赎回（以“-”号填列）	-539,243,655.84	-539,243,655.84
-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	400,576,880.45	400,576,880.45

国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C

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	221,002,838.96	221,002,838.96
本期申购	139,640,727.03	139,640,727.03
本期赎回（以“-”号填列）	-166,563,569.44	-166,563,569.44
-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	194,079,996.55	194,079,996.55

注：本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,738,514.89	11,528,832.73	17,267,347.62
本期利润	23,695,407.02	-5,332,997.95	18,362,409.07
本期基金份额交易产生的变动数	-8,013,132.41	-3,099,577.17	-11,112,709.58
其中：基金申购款	6,979,170.60	6,324,603.43	13,303,774.03
基金赎回款	-14,992,303.01	-9,424,180.60	-24,416,483.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,420,789.50	3,096,257.61	24,517,047.11

国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,695,657.07	3,945,001.59	5,640,658.66
本期利润	9,463,479.99	-2,706,913.54	6,756,566.45
本期基金份额交易产生的变动数	-1,342,681.66	259,548.29	-1,083,133.37
其中：基金申购款	3,320,445.45	2,833,919.74	6,154,365.19
基金赎回款	-4,663,127.11	-2,574,371.45	-7,237,498.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,816,455.40	1,497,636.34	11,314,091.74

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	18,986.90
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	39,039.99
其他	2,226.27
合计	60,253.16

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	32,884,563.67
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	32,884,563.67

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	284,656,567.33
减：卖出股票成本总额	251,772,003.66
买卖股票差价收入	32,884,563.67

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	-5,772,450.30
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	-5,772,450.30

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	721,110,574.19
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	718,383,275.24
减：应收利息总额	8,499,749.25
买卖债券差价收入	-5,772,450.30

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资产生的收益/损失。

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/损失。

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	1,000,861.32
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	1,000,861.32

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	-8,039,911.49
股票投资	-9,111,350.82
债券投资	1,071,439.33
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	-8,039,911.49

6.4.7.18 其他收入

本基金于本报告期无其他收入。

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	633,531.01
银行间市场交易费用	7,937.50
合计	641,468.51

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	10,655.29
上清所账户维护费	9,000.00
中债登账户维护费	9,000.00
其他	300.00
合计	118,215.44

6.4.7.21 分部报告

无。

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	基金管理人、注册登记机构、直销机构
民生银行	基金托管人、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

本基金本报告期内未发生通过关联方交易单元进行的交易。

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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金于本报告期末发生通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期末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
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,111,971.47
其中：支付销售机构的客户维护费	1,553,771.40

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 0.80% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

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	
	当期发生的基金应支付的托管费	583,494.56

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C	合计
国寿安保	-	279.30	279.30
民生银行	-	44,790.69	44,790.69
合计	-	45,069.99	45,069.99

注：销售服务费每日计提，按月支付。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.30%。本基金销售服务费将专门用于本基金的销售与基金份额持有人服务。销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息

						支出
民生银行	-	-	-	-	79,135,000.00	5,788.23

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

本基金于本报告期无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人本报告期无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

本基金于本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

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	
	期末余额	当期利息收入
民生银行	10,415,085.42	18,986.90

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间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

本基金于本报告期末进行利润分配。

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
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	610	15,006.00	99,430.00	-
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	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
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	-
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	-
600905	三峡能源	2021年6月2日	2021年12月10日	新股流通受限	2.65	5.67	907,763	2,405,571.95	5,147,016.21	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688131	皓元医药	2021年6月1日	2021年12月8日	新股流通受限	64.99	247.10	1,955	127,055.45	483,080.50	-
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	-
688319	欧林生物	2021年5月31日	2021年12月8日	新股流通受限	9.88	27.34	3,412	33,710.56	93,284.08	-
688350	富淼科技	2021年1月21日	2021年7月28日	新股流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688367	工大高科	2021年6月21日	2021年12月28日	新股流通受限	11.53	17.94	1,717	19,797.01	30,802.98	-
688499	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

688677	海泰新光	2021年2月18日	2021年8月26日	新股流通受限	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-
688681	科汇股份	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	9.56	14.54	1,899	18,154.44	27,611.46	-
688685	迈信林	2021年4月30日	2021年11月15日	新股流通受限	9.02	19.50	2,612	23,560.24	50,934.00	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021年6月15日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	2,180	218,000.00	218,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月15日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	560	56,000.00	56,000.00	-

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股票。

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

本基金于本报告期末未持有银行间市场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

截至本报告期末2021年6月30日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额111,000,000.00元，于2021年7月1日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末未参与转融通业务。

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，除在附注 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。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在 1 个月内到期且计息外，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、存出保证金、债券投资及买入返售金融资产等。

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	10,415,085.42	-	-	-	10,415,085.42
结算备付金	3,918,508.71	-	-	-	3,918,508.71
存出保证金	155,449.42	-	-	-	155,449.42
交易性金融资产	170,244,600.00	410,768,189.70	43,323,700.90	88,667,924.92	713,004,415.52
买入返售金融资产	16,000,000.00	-	-	-	16,000,000.00
应收利息	-	-	-	9,822,145.64	9,822,145.64
应收申购款	-	-	-	367,280.92	367,280.92

应收证券清算款	-	-	-	2,265,176.54	2,265,176.54
资产总计	200,733,643.55	410,768,189.70	43,323,700.90	101,122,528.02	755,948,062.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,589,796.34	4,589,796.34
应付管理人报酬	-	-	-	417,643.58	417,643.58
应付托管费	-	-	-	78,308.15	78,308.15
应付证券清算款	-	-	-	9,120,012.07	9,120,012.07
卖出回购金融资产款	111,000,000.00	-	-	-	111,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	50,395.81	50,395.81
应付交易费用	-	-	-	60,084.21	60,084.21
应付利息	-	-	-	30,136.44	30,136.44
应交税费	-	-	-	24,409.57	24,409.57
其他负债	-	-	-	89,260.15	89,260.15
负债总计	111,000,000.00	-	-	14,460,046.32	125,460,046.32
利率敏感度缺口	89,733,643.55	410,768,189.70	43,323,700.90	86,662,481.70	630,488,015.85
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,645,924.26	-	-	-	7,645,924.26
结算备付金	7,224,649.42	-	-	-	7,224,649.42
存出保证金	292,335.66	-	-	-	292,335.66
交易性金融资产	241,114,284.00	416,554,205.40	148,358,391.68	174,242,106.45	980,268,987.53
买入返售金融资产	24,000,000.00	-	-	-	24,000,000.00
应收利息	-	-	-	7,757,128.49	7,757,128.49
应收申购款	-	-	-	170.00	170.00
应收证券清算款	-	-	-	8,860,544.83	8,860,544.83
资产总计	280,277,193.34	416,554,205.40	148,358,391.68	190,859,949.77	1,036,049,740.19
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	592,372.98	592,372.98
应付托管费	-	-	-	111,069.93	111,069.93
应付证券清算款	-	-	-	11,693,121.98	11,693,121.98
卖出回购金融资产款	134,000,000.00	-	-	-	134,000,000.00
应付销售服务费	-	-	-	56,521.88	56,521.88
应付交易费用	-	-	-	496,734.71	496,734.71
应付利息	-	-	-	-49,906.85	-49,906.85
应交税费	-	-	-	29,141.93	29,141.93
其他负债	-	-	-	90,000.00	90,000.00
负债总计	134,000,000.00	-	-	13,019,056.56	147,019,056.56
利率敏感度缺口	146,277,193.34	416,554,205.40	148,358,391.68	177,840,893.21	889,030,683.63

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	该利率敏感性分析基于本基金报表日的利率风险状况；		
	假定所有期限的利率均以相同幅度变动 25 个基点，其他变量不变；		
	此项影响并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。		
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	+25 个基点	-3,230,017.79	-6,485,113.78
	-25 个基点	3,230,017.79	6,485,113.78

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债券或银行间同业市场交易的债券，所面临的最大的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。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-30%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于基金资产净值 5% 的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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	88,667,924.92	14.06	174,242,106.45	19.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	624,336,490.60	99.02	806,026,881.08	90.66
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	713,004,415.52	113.09	980,268,987.53	110.26

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）	
分析	-5%	-20,919,488.82	-44,982,393.95
	5%	20,919,488.82	44,982,393.95

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

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产等，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

本基金于本报告期末持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 135,750,513.43 元（上年度末：262,656,260.25 元），属于第二层次的余额为人民币 577,253,902.09 元（上年度末：717,612,727.28 元），

本报告期末无属于第三层次的余额。

(2) 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	88,667,924.92	11.73
	其中：股票	88,667,924.92	11.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	624,336,490.60	82.59
	其中：债券	624,336,490.60	82.59
	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	16,000,000.00	2.12
	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	14,333,594.13	1.90
8	其他各项资产	12,610,052.52	1.67
9	合计	755,948,062.17	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	-	-
B	采矿业	5,851,738.00	0.93
C	制造业	30,965,792.30	4.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,336,970.60	1.16
E	建筑业	1,464,912.44	0.23
F	批发和零售业	127,060.36	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,494,488.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,637,088.76	0.42
J	金融业	29,412,768.20	4.67
K	房地产业	506,884.00	0.08
L	租赁和商务服务业	1,516,671.00	0.24
M	科学研究和技术服务业	1,234,712.50	0.20
N	水利、环境和公共设施管理业	8,884.08	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,906,726.68	0.30
R	文化、体育和娱乐业	203,228.00	0.03
S	综合	-	-
	合计	88,667,924.92	14.06

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持有港股通投资股票。

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	600919	江苏银行	982,281	6,974,195.10	1.11
2	000001	平安银行	284,300	6,430,866.00	1.02
3	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.82
4	002311	海大集团	51,700	4,218,720.00	0.67
5	600985	淮北矿业	220,600	2,693,526.00	0.43
6	601398	工商银行	400,000	2,068,000.00	0.33

7	601899	紫金矿业	209,800	2,032,962.00	0.32
8	601006	大秦铁路	307,400	2,022,692.00	0.32
9	600809	山西汾酒	4,500	2,016,000.00	0.32
10	600436	片仔癀	3,900	1,748,370.00	0.28
11	600519	贵州茅台	800	1,645,360.00	0.26
12	600377	宁沪高速	137,500	1,342,000.00	0.21
13	601939	建设银行	190,600	1,267,490.00	0.20
14	600926	杭州银行	85,000	1,253,750.00	0.20
15	300677	英科医疗	10,000	1,248,000.00	0.20
16	600036	招商银行	22,800	1,235,532.00	0.20
17	601888	中国中免	4,100	1,230,410.00	0.20
18	601288	农业银行	399,900	1,211,697.00	0.19
19	601919	中远海控	38,400	1,172,736.00	0.19
20	603659	璞泰来	8,500	1,161,100.00	0.18
21	601988	中国银行	360,000	1,108,800.00	0.18
22	601012	隆基股份	12,320	1,094,508.80	0.17
23	600570	恒生电子	11,730	1,093,822.50	0.17
24	600346	恒力石化	40,400	1,060,096.00	0.17
25	600900	长江电力	49,900	1,029,936.00	0.16
26	600309	万华化学	9,300	1,012,026.00	0.16
27	000063	中兴通讯	30,000	996,900.00	0.16
28	000799	酒鬼酒	3,900	996,840.00	0.16
29	600763	通策医疗	2,400	986,400.00	0.16
30	600132	重庆啤酒	4,800	950,160.00	0.15
31	300015	爱尔眼科	12,966	920,326.68	0.15
32	600031	三一重工	30,400	883,728.00	0.14
33	000333	美的集团	11,900	849,303.00	0.13
34	601166	兴业银行	38,400	789,120.00	0.13
35	603501	韦尔股份	2,400	772,800.00	0.12
36	603259	药明康德	4,800	751,632.00	0.12
37	601633	长城汽车	16,100	701,799.00	0.11
38	600893	航发动力	13,100	696,789.00	0.11
39	300059	东方财富	20,000	655,800.00	0.10
40	001965	招商公路	90,000	649,800.00	0.10
41	601377	兴业证券	67,200	649,152.00	0.10
42	601318	中国平安	10,000	642,800.00	0.10
43	600660	福耀玻璃	11,200	625,520.00	0.10
44	600584	长电科技	16,000	602,880.00	0.10
45	300750	宁德时代	1,100	588,280.00	0.09
46	601838	成都银行	44,800	566,272.00	0.09
47	600999	招商证券	29,500	561,090.00	0.09
48	600025	华能水电	93,600	541,944.00	0.09

49	600690	海尔智家	20,800	538,928.00	0.09
50	601066	中信建投	17,100	537,453.00	0.09
51	600161	天坛生物	15,653	536,115.25	0.09
52	600522	中天科技	52,000	520,000.00	0.08
53	600438	通威股份	12,000	519,240.00	0.08
54	600109	国金证券	40,800	517,752.00	0.08
55	600048	保利地产	42,100	506,884.00	0.08
56	688036	传音控股	2,400	502,800.00	0.08
57	600030	中信证券	20,000	498,800.00	0.08
58	688131	皓元医药	1,955	483,080.50	0.08
59	000858	五粮液	1,600	476,624.00	0.08
60	600039	四川路桥	76,000	476,520.00	0.08
61	300253	卫宁健康	29,000	471,830.00	0.07
62	601336	新华保险	10,000	459,100.00	0.07
63	601225	陕西煤业	37,600	445,560.00	0.07
64	601601	中国太保	15,200	440,344.00	0.07
65	601088	中国神华	22,000	429,440.00	0.07
66	600019	宝钢股份	51,200	391,168.00	0.06
67	600027	华电国际	109,400	376,336.00	0.06
68	601618	中国中冶	123,200	367,136.00	0.06
69	601186	中国铁建	48,900	363,327.00	0.06
70	600000	浦发银行	35,520	355,200.00	0.06
71	603833	欧派家居	2,400	340,704.00	0.05
72	002439	启明星辰	11,300	327,813.00	0.05
73	600276	恒瑞医药	4,800	326,256.00	0.05
74	002180	纳思达	10,000	322,000.00	0.05
75	300308	中际旭创	8,200	315,864.00	0.05
76	601021	春秋航空	5,400	307,260.00	0.05
77	601009	南京银行	27,900	293,508.00	0.05
78	002127	南极电商	29,300	286,261.00	0.05
79	002065	东华软件	33,300	264,069.00	0.04
80	601877	正泰电器	7,900	263,702.00	0.04
81	300383	光环新网	18,300	263,337.00	0.04
82	603288	海天味业	1,950	251,452.50	0.04
83	601898	中煤能源	35,000	250,250.00	0.04
84	601668	中国建筑	53,100	246,915.00	0.04
85	600886	国投电力	23,800	228,718.00	0.04
86	601100	恒立液压	2,600	223,392.00	0.04
87	300251	光线传媒	18,800	203,228.00	0.03
88	600406	国电南瑞	7,920	184,060.80	0.03
89	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.03
90	603019	中科曙光	6,400	176,704.00	0.03

91	600966	博汇纸业	13,000	169,650.00	0.03
92	600703	三安光电	5,000	160,250.00	0.03
93	601128	常熟银行	25,500	158,100.00	0.03
94	601688	华泰证券	9,700	153,260.00	0.02
95	601211	国泰君安	8,700	149,118.00	0.02
96	600837	海通证券	12,900	148,350.00	0.02
97	601998	中信银行	27,700	141,270.00	0.02
98	601636	旗滨集团	6,400	118,784.00	0.02
99	600390	五矿资本	18,600	111,228.00	0.02
100	601933	永辉超市	22,200	105,006.00	0.02
101	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.02
102	688319	欧林生物	3,412	93,284.08	0.01
103	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.01
104	600691	阳煤化工	24,000	82,080.00	0.01
105	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.01
106	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.01
107	688685	迈信林	2,612	50,934.00	0.01
108	300910	瑞丰新材	474	49,556.70	0.01
109	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
110	688367	工大高科	1,717	30,802.98	0.00
111	688681	科汇股份	1,899	27,611.46	0.00
112	000568	泸州老窖	100	23,594.00	0.00
113	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
114	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
115	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
116	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
117	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
118	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
119	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
120	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
121	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
122	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
123	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
124	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
125	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
126	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
127	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
128	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
129	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
130	605011	杭州热电	525	4,662.00	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	601899	紫金矿业	18,694,315.97	2.10
2	600919	江苏银行	10,982,555.31	1.24
3	000001	平安银行	6,811,339.00	0.77
4	600985	淮北矿业	6,750,588.75	0.76
5	000333	美的集团	5,940,905.00	0.67
6	002120	韵达股份	5,785,845.00	0.65
7	300059	东方财富	5,627,774.56	0.63
8	601633	长城汽车	5,531,532.00	0.62
9	002557	洽洽食品	5,474,219.92	0.62
10	002142	宁波银行	3,999,190.00	0.45
11	002311	海大集团	3,998,012.00	0.45
12	000651	格力电器	3,991,527.00	0.45
13	600660	福耀玻璃	3,566,858.00	0.40
14	601006	大秦铁路	3,531,704.00	0.40
15	001965	招商公路	3,502,352.60	0.39
16	600905	三峡能源	3,436,527.95	0.39
17	600276	恒瑞医药	3,318,258.00	0.37
18	002966	苏州银行	2,999,919.00	0.34
19	000783	长江证券	2,999,257.00	0.34
20	600809	山西汾酒	2,763,634.00	0.31

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	601899	紫金矿业	31,878,635.30	3.59
2	000333	美的集团	12,150,694.00	1.37
3	300059	东方财富	9,097,839.92	1.02
4	002142	宁波银行	8,193,659.00	0.92
5	600519	贵州茅台	7,490,062.00	0.84
6	601633	长城汽车	6,229,052.00	0.70
7	601318	中国平安	5,812,209.00	0.65
8	002120	韵达股份	5,750,488.70	0.65
9	600985	淮北矿业	5,560,943.53	0.63
10	002493	荣盛石化	5,549,400.00	0.62

11	600919	江苏银行	5,169,676.40	0.58
12	002475	立讯精密	5,158,190.00	0.58
13	002460	赣锋锂业	4,892,009.77	0.55
14	002557	洽洽食品	4,806,668.36	0.54
15	002001	新和成	4,654,404.00	0.52
16	601398	工商银行	4,625,126.00	0.52
17	300015	爱尔眼科	4,470,162.50	0.50
18	600104	上汽集团	4,351,053.00	0.49
19	000651	格力电器	3,969,780.00	0.45
20	601288	农业银行	3,584,316.00	0.40

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	175,309,172.95
卖出股票收入（成交）总额	284,656,567.33

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	407,865,250.00	64.69
	其中：政策性金融债	200,137,000.00	31.74
4	企业债券	94,334,000.00	14.96
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	19,838,000.00	3.15
7	可转债（可交换债）	53,689,240.60	8.52
8	同业存单	48,610,000.00	7.71
9	其他	-	-
10	合计	624,336,490.60	99.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	163756	20 国君 G4	500,000	50,370,000.00	7.99
2	200207	20 国开 07	500,000	50,140,000.00	7.95

3	160210	16 国开 10	500,000	49,780,000.00	7.90
4	112111022	21 平安银行 CD022	500,000	48,610,000.00	7.71
5	170206	17 国开 06	400,000	40,472,000.00	6.42

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	155,449.42
2	应收证券清算款	2,265,176.54
3	应收股利	-
4	应收利息	9,822,145.64
5	应收申购款	367,280.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,610,052.52

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	132015	18 中油 EB	25,787,450.00	4.09
2	132004	15 国盛 EB	11,764,500.00	1.87
3	132009	17 中油 EB	5,850,894.00	0.93
4	110059	浦发转债	4,505,895.70	0.71
5	132007	16 凤凰 EB	2,086,800.00	0.33
6	113044	大秦转债	581,441.50	0.09

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600905	三峡能源	5,147,016.21	0.82	新股流通受限

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

份额级别	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 (%)
国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	4,642	86,294.03	-	-	400,576,880.45	100.00
国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C	2,972	65,302.83	-	-	194,079,996.55	100.00
合计	7,614	78,100.46	-	-	594,656,877.00	100.00

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	29.92	0.00
	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C	59.66	0.00

员持有本基金			
	合计	89.58	0.00

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	份额级别	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	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	0
	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	0
	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C	0
	合计	0

注：本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理本报告期末未持有本基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 A	国寿安保稳丰 6 个月持有混合 C
基金合同生效日 (2020 年 8 月 5 日) 基金份额总额	611,720,540.25	176,708,824.63
本报告期期初基金份额总额	645,119,838.39	221,002,838.96
本报告期基金总申购份额	294,700,697.90	139,640,727.03
减：本报告期基金总赎回份额	539,243,655.84	166,563,569.44
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	400,576,880.45	194,079,996.55

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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。

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	
兴业证券	2	314,028,700.59	70.51%	229,650.81	80.21%	-
申万宏源	2	131,354,108.56	29.49%	56,655.09	19.79%	-

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	83,824,432.16	75.78%	3,075,400,000.00	64.82%	-	-
申万宏源	26,796,711.30	24.22%	1,669,000,000.00	35.18%	-	-

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	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证	证券日报、证监会指定	2021 年 1 月 22 日

	券投资基金 2020 年第 4 季度报告	网站及公司网站	
2	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 22 日
3	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务的公告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 5 日
4	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回和转换转出业务的公告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 5 日
5	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
6	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2020 年年度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
7	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
8	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
9	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	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 28 日
10	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	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 28 日
11	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证券日报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 6 月 8 日
12	国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金更新基金招募说明书（2021 年第 1 号）	证券日报、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

无。

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稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金募集的

文件

12.1.2 《国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保稳丰 6 个月持有期混合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 报告期内国寿安保稳丰 6 个月持有期混合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.gsfc.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