

国寿安保创新医药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：交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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..... | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 9 |
| 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..... | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 11 |
| 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 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明..... | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表..... | 12 |
| 6.2 利润表..... | 13 |
| 6.3 所有者权益（基金净值）变动表..... | 14 |
| 6.4 报表附注..... | 15 |
| §7 投资组合报告 | 40 |
| 7.1 期末基金资产组合情况..... | 40 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合..... | 41 |
| 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..... | 42 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动..... | 42 |
| 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..... | 46 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 47 |
| §10 重大事件揭示..... | 47 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 47 |
| 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..... | 47 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 47 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 47 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 47 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 49 |
| 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..... | 50 |
| 12.3 查阅方式..... | 50 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | |
|-----------------|-------------------|----------------|
| 基金名称 | 国寿安保创新医药股票型证券投资基金 | |
| 基金简称 | 国寿安保创新医药股票 | |
| 基金主代码 | 009502 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2020 年 12 月 28 日 | |
| 基金管理人 | 国寿安保基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 51,144,268.63 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 国寿安保创新医药股票 A | 国寿安保创新医药股票 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 009502 | 009503 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 41,424,860.30 份 | 9,719,408.33 份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 本基金通过深度挖掘创新医药产业的投资机会，集中投资于创新医药主题相关的优质上市公司，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。在大类资产配置上，本基金将优先考虑股票资产的配置，剩余资产将配置于债券和现金类等大类资产上。除主要的股票及债券投资外，本基金还可通过投资衍生工具等，进一步为基金组合规避风险、增强收益。 |
| 业绩比较基准 | 中证医药卫生指数收益率*70%+恒生医疗保健指数收益率*10%+中债综合（全价）指数收益率*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。 |

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 | 交通银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 申梦玉 | 陆志俊 |
| | 联系电话 | 010-50850744 | 95559 |
| | 电子邮箱 | public@gsfunds.com.cn | luzj@bankcomm.com |
| 客户服务电话 | | 4009-258-258 | 95559 |
| 传真 | | 010-50850776 | 021-62701216 |
| 注册地址 | | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号 | 中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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 | 中国（上海）长宁区仙霞路 18 号 |
| 邮政编码 | 100033 | 200336 |
| 法定代表人 | 王军辉 | 任德奇 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 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) | |
|---------------|---------------------------|---------------|
| | 国寿安保创新医药股票 A | 国寿安保创新医药股票 C |
| 本期已实现收益 | 4,795,031.03 | 1,001,393.74 |
| 本期利润 | 7,252,878.73 | 2,851,109.51 |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.0792 | 0.1262 |
| 本期加权平均净值利润率 | 7.99% | 12.57% |
| 本期基金份额净值增长率 | 17.16% | 16.96% |
| 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 | 3,949,215.60 | 909,139.41 |
| 期末可供分配基金份额利润 | 0.0953 | 0.0935 |
| 期末基金资产净值 | 48,531,557.86 | 11,368,169.89 |
| 期末基金份额净值 | 1.1716 | 1.1696 |
| 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 | 17.16% | 16.96% |

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

国寿安保创新医药股票 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 | 1.86% | 1.61% | -0.05% | 1.05% | 1.91% | 0.56% |
| 过去三个月 | 25.26% | 1.46% | 11.96% | 1.17% | 13.30% | 0.29% |
| 过去六个月 | 17.16% | 1.61% | 9.70% | 1.44% | 7.46% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 17.16% | 1.59% | 10.38% | 1.43% | 6.78% | 0.16% |

国寿安保创新医药股票 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 | 1.83% | 1.61% | -0.05% | 1.05% | 1.88% | 0.56% |
| 过去三个月 | 25.16% | 1.46% | 11.96% | 1.17% | 13.20% | 0.29% |
| 过去六个月 | 16.96% | 1.61% | 9.70% | 1.44% | 7.26% | 0.17% |
| 自基金合同生效起至今 | 16.96% | 1.59% | 10.38% | 1.43% | 6.58% | 0.16% |

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

国寿安保创新医药股票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



国寿安保创新医药股票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 12 月 28 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 12 月 28 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 | | |
| 刘志军 | 本基金的基金经理 | 2020 年 12 月 28 日 | - | 9 年 | 硕士研究生，2012 年 3 月加入华夏基金管理有限公司，任研究员。2016 年 9 月加入国寿安保基金管理有限公司，任研究员。现任国寿安保健康科学混合型证券投资基金和国寿安保创新医药股票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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保创新医药股票型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，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，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平

交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年 A 股市场震荡上行，上证综指上涨 6%，沪深 300 上涨 3.76%，创业板上涨 15.14%，科创板上涨 18.57%。

经济复苏及“碳中和”政策背景下，申万一级行业中，电器设备、汽车、电子、生物医药等涨幅较多，休闲服务、农林牧渔、房地产、公用事业、银行等跌幅较多。医药板块明显，指数创历史新高，结构性机会突出，医疗美容板块、科学实验室板块、CXO 板块、眼科产业链大幅上涨，与我们的 1 季末判断一致，即医药结构性投资机会较大，无须过度悲观。

上半年市场大幅震荡，长期景气板块不惧短期调整并创出新高，再次证明长期价值投资的力量。医药行业正处于投资的黄金时期，科创板推出引入大量优质医药公司上市，因此我们始终坚信这是最好的投资时候。

2021 年 2 季度，本基金完成建仓，净值创出新高，一方面得益于医药行业黄金投资赛道的力量，另一方面，我们不断丰富投资框架，做到了知行合一，深入研究和加强调研反馈，重点投资了医疗美容、科学实验室、CXO 板块和眼科产业链等领域。港股仍选择了创新药龙头公司，但阶段持有了部分被错杀估值相对较低的优质公司。

做的不足的是对医药龙头股的投资中，长期估值和短期风险的平衡上做的不好。

我们坚信医药健康产业的投资价值仍很高，创新药投资要求更高更难，专业化要求更高，但只要做到深入研究，积极投资“长坡厚雪高槛”的细分行业及个股，一定会取得较好的收益。

截至 2021 年 6 月 30 日，基金组合中持有的股票市值占资产净值比例为 90.75%，其中股票持仓中医药占比 70% 左右，持有的债券市值比例为 0.84%。

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创新医药股票 A 基金份额净值为 1.1716 元，本报告期

基金份额净值增长率为 17.16%；截至本报告期末国寿安保创新医药股票 C 基金份额净值为 1.1696 元，本报告期基金份额净值增长率为 16.96%；业绩比较基准收益率为 9.70%。

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 3 季度，全球疫情仍有加剧风险，市场震荡会加剧，但我们仍坚信长期的力量，医药健康产业可投资标的众多，我们会积极精选优质估值合理的公司重点投资。细分领域我们仍然看好创新药（疫苗）产业链、医疗美容、医疗服务及部分部分创新医疗器械公司。

主要风险是：全球通胀风险、去杠杆政策超预期、地缘位置风险等

最后，本基金将密切关注国内外宏观经济形势和政策的变化，综合考虑估值的安全性和业绩的成长性，对投资组合进行动态的优化调整。

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，基金托管人在国寿安保创新医药股票型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

本报告期，国寿安保基金管理有限公司在国寿安保创新医药股票型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

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

本报告期，由国寿安保基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关国寿安保创新医药股票型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：国寿安保创新医药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 |
|------------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 5,936,590.88 | 128,984,289.40 |
| 结算备付金 | | 344,906.50 | - |
| 存出保证金 | | 61,926.10 | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 54,860,745.16 | - |
| 其中：股票投资 | | 54,360,395.16 | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 500,350.00 | - |

| | | | |
|-----------------|------------|---------------------------|-----------------------------|
| 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 | - | 85,800,000.00 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 6,247.17 | 32,650.16 |
| 应收股利 | | 3,481.60 | - |
| 应收申购款 | | 185,836.67 | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 61,399,734.08 | 214,816,939.56 |
| 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 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | 813,958.79 | - |
| 应付赎回款 | | 429,232.14 | - |
| 应付管理人报酬 | | 57,186.70 | 21,126.34 |
| 应付托管费 | | 9,531.13 | 3,521.05 |
| 应付销售服务费 | | 2,825.40 | 2,258.68 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 102,857.21 | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 84,414.96 | - |
| 负债合计 | | 1,500,006.33 | 26,906.07 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 51,144,268.63 | 214,784,289.40 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | 8,755,459.12 | 5,744.09 |
| 所有者权益合计 | | 59,899,727.75 | 214,790,033.49 |
| 负债和所有者权益总计 | | 61,399,734.08 | 214,816,939.56 |

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额总额 51,144,268.63 份，其中国寿安保创新医药股票 A 基金份额总额 41,424,860.30 份，基金份额净值 1.1716 元；国寿安保创新医药股票 C 基金份额总额 9,719,408.33 份，基金份额净值 1.1696 元。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保创新医药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 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日 |
|------------------------|------------|---------------------------------------|
| 一、收入 | | 11,486,811.47 |
| 1. 利息收入 | | 162,825.31 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.11 | 93,366.89 |
| 债券利息收入 | | 1,398.09 |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 68,060.33 |
| 证券出借利息收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） | | 6,570,223.35 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.12 | 6,451,810.21 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | - |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.2 | - |
| 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 | 118,413.14 |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 4,307,563.47 |
| 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 | 446,199.34 |
| 减：二、费用 | | 1,382,823.23 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 685,950.88 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 114,325.10 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 33,791.64 |
| 4. 交易费用 | 6.4.7.19 | 464,053.05 |
| 5. 利息支出 | | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - |
| 6. 税金及附加 | | - |
| 7. 其他费用 | 6.4.7.20 | 84,702.56 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 10,103,988.24 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 10,103,988.24 |

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保创新医药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) | 214,784,289.40 | 5,744.09 | 214,790,033.49 |
| 二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润) | - | 10,103,988.24 | 10,103,988.24 |
| 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) | -163,640,020.77 | -1,354,273.21 | -164,994,293.98 |
| 其中：1. 基金申购款 | 19,400,877.07 | 713,899.74 | 20,114,776.81 |
| 2. 基金赎回款 | -183,040,897.84 | -2,068,172.95 | -185,109,070.79 |
| 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) | 51,144,268.63 | 8,755,459.12 | 59,899,727.75 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>左季庆</u> | <u>王文英</u> | <u>韩占锋</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保创新医药股票型证券投资基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）《关于准予国寿安保创新医药股票型证券投资基金注册的批复》（证监许可【2020】775号）的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于2020年10月19日至2020年12月24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_A22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12月28日正式生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次募集规模为214,784,289.40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，基金托管人为交通银行股份有限公司（简称“交通银行”）。

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）、港股通标的股票、国债、中央银行票据、金融债券、公开发行的次级债券、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券、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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例不超过 20%；投资于创新医药主题相关证券的比例不低于非现金基金资产的 80%；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。

本基金的投资范围包括港股通标的股票，基金可根据投资策略需要或不同配置地市场环境的变化，选择将部分基金资产投资于港股或选择不将基金资产投资于港股，基金资产并非必然投资港股。

如果法律法规对上述投资比例要求有变更的，本基金将及时对其做出相应调整，并以调整变更后的投资比例为准。

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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本基金的报告期间为 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债均划分为其他金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现

金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

(1) 股票投资

买入股票于交易日确认为股票投资，股票投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账；

卖出股票于交易日确认股票投资收益，卖出股票的成本按移动加权平均法于交易日结转；

(2) 债券投资

买入债券于交易日确认为债券投资。债券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于交易日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

(3) 资产支持证券投资

买入资产支持证券于交易日确认为资产支持证券投资。资产支持证券投资成本，按交易日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的资产支持证券应收利息单独核算，不构成资产支持证券投资成本；

卖出资产支持证券于成交日确认资产支持证券投资收益，卖出资产支持证券的成本按移动加权平均法结转；

(4) 分离交易可转债

申购新发行的分离交易可转债于获得日，按可分离权证公允价值占分离交易可转债全部公允价值的比例将购买分离交易可转债实际支付全部价款的一部分确认为权证投资成本，按实际支付的全部价款扣减可分离权证确定的成本确认债券成本；

上市后，上市流通的债券和权证分别按上述(2)、(3)中相关原则进行计算；

(5) 回购协议

本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在实际持有期间内逐日计提利息。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的股票投资和债券投资等投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值；

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基

础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取

定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 衍生工具收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(8) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(9) 公允价值变动收益/（损失）系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(10) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同；

(2) 本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

(3) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

(4) 同一类别每一基金份额享有同等分配权；

(5) 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的情况下，基金管理人可在法律法规允许的前提下酌情调整上述基金收益分配原则，此项调整不需要召开基金份额持有人大会，但应于变更实施日前在规定媒介公告。法律、法规或监管机构另有规定的，基金管理人在履行适当程序后，将对上述基金收益分配原则进行调整。

6.4.4.12 分部报告

无。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无需要说明的其他重要会计政策和会计估计事项。

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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

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 2018 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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。

6.4.6.5 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 | 5,936,590.88 |
| 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 | 5,936,590.88 |

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 | 50,052,431.69 | 54,360,395.16 | 4,307,963.47 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 500,750.00 | 500,350.00 |
| | 银行间市场 | - | - |
| | 合计 | 500,750.00 | 500,350.00 |
| 资产支持证券 | - | - | - |
| 基金 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 合计 | 50,553,181.69 | 54,860,745.16 | 4,307,563.47 |

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 | 652.75 |
| 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 | 207.50 |
| 应收债券利息 | 5,359.32 |
| 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 | 27.60 |
| 合计 | 6,247.17 |

6.4.7.6 其他资产

本基金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 | 102,857.21 |
| 银行间市场应付交易费用 | - |
| 合计 | 102,857.21 |

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 | 112.40 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 预提费用 | 84,302.56 |
| 合计 | 84,414.96 |

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保创新医药股票 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 | 122,930,792.92 | 122,930,792.92 |
| 本期申购 | 10,282,295.51 | 10,282,295.51 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -91,788,228.13 | -91,788,228.13 |
| -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 | 41,424,860.30 | 41,424,860.30 |

国寿安保创新医药股票 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 | 91,853,496.48 | 91,853,496.48 |
| 本期申购 | 9,118,581.56 | 9,118,581.56 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -91,252,669.71 | -91,252,669.71 |
| -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 | 9,719,408.33 | 9,719,408.33 |

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

国寿安保创新医药股票 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|--------------|--------------|
| 上年度末 | 4,580.38 | - | 4,580.38 |
| 本期利润 | 4,795,031.03 | 2,457,847.70 | 7,252,878.73 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -850,395.81 | 699,634.26 | -150,761.55 |

| | | | |
|----------|---------------|--------------|--------------|
| 其中：基金申购款 | 306,682.95 | 195,401.10 | 502,084.05 |
| 基金赎回款 | -1,157,078.76 | 504,233.16 | -652,845.60 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 3,949,215.60 | 3,157,481.96 | 7,106,697.56 |

国寿安保创新医药股票 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|--------------|---------------|---------------|
| 上年度末 | 1,163.71 | - | 1,163.71 |
| 本期利润 | 1,001,393.74 | 1,849,715.77 | 2,851,109.51 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -93,418.04 | -1,110,093.62 | -1,203,511.66 |
| 其中：基金申购款 | 165,767.30 | 46,048.39 | 211,815.69 |
| 基金赎回款 | -259,185.34 | -1,156,142.01 | -1,415,327.35 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 909,139.41 | 739,622.15 | 1,648,761.56 |

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 | | 54,526.68 |
| 定期存款利息收入 | | 31,777.77 |
| 其他存款利息收入 | | - |
| 结算备付金利息收入 | | 6,661.16 |
| 其他 | | 401.28 |
| 合计 | | 93,366.89 |

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 | | 6,451,810.21 |
| 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 | | 6,451,810.21 |

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 | 197,043,724.68 |
| 减：卖出股票成本总额 | 190,591,914.47 |
| 买卖股票差价收入 | 6,451,810.21 |

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

本基金于本报告期无债券投资产生的收益/损失。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

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 | 118,413.14 |
| 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 | 118,413.14 |

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 | 4,307,563.47 |
| 股票投资 | 4,307,963.47 |
| 债券投资 | -400.00 |
| 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 | 4,307,563.47 |

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 | 445,862.33 |
| 基金转换费收入 | 337.01 |
| 合计 | 446,199.34 |

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 | 464,053.05 |
| 银行间市场交易费用 | - |
| 合计 | 464,053.05 |

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 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 其他 | 400.00 |
| 合计 | 84,702.56 |

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 |
| 中国交通银行股份有限公司（简称“交通银行”） | 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、销售机构 |
| 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 |
| 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 |

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 |
|-----------------|----------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 685,950.88 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 63,137.04 |

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1.20%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

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 | 114,325.10 |

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 0.20% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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 | | |
| | 国寿安保创新医药股票 | 国寿安保创新医药股票 | 合计 |
| | A | C | |
| 国寿安保 | - | 17,815.16 | 17,815.16 |
| 交通银行 | - | 4,241.33 | 4,241.33 |
| 中国人寿 | - | 1.75 | 1.75 |
| 合计 | - | 22,058.24 | 22,058.24 |

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

本基金于本报告期末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间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

国寿安保创新医药股票 A

| 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 | 30,011,150.00 | 72.45 | 90,011,150.00 | 73.22 |

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 |
| 交通银行 | 5,936,590.88 | 54,526.68 |

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

本基金于本报告期末未进行利润分配。

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

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人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，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。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 | 5,936,590.88 | - | - | - | 5,936,590.88 |
| 结算备付金 | 344,906.50 | - | - | - | 344,906.50 |
| 存出保证金 | 61,926.10 | - | - | - | 61,926.10 |
| 交易性金融资产 | 500,350.00 | - | - | 54,360,395.16 | 54,860,745.16 |
| 应收利息 | - | - | - | 6,247.17 | 6,247.17 |
| 应收股利 | - | - | - | 3,481.60 | 3,481.60 |
| 应收申购款 | - | - | - | 185,836.67 | 185,836.67 |
| 资产总计 | 6,843,773.48 | - | - | 54,555,960.60 | 61,399,734.08 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | - | - | - | 429,232.14 | 429,232.14 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 57,186.70 | 57,186.70 |
| 应付托管费 | - | - | - | 9,531.13 | 9,531.13 |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 813,958.79 | 813,958.79 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 2,825.40 | 2,825.40 |
| 应付交易费用 | - | - | - | 102,857.21 | 102,857.21 |
| 其他负债 | - | - | - | 84,414.96 | 84,414.96 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,500,006.33 | 1,500,006.33 |
| 利率敏感度缺口 | 6,843,773.48 | - | - | 53,055,954.27 | 59,899,727.75 |
| 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 | 128,984,289.40 | - | - | - | 128,984,289.40 |

| | | | | | |
|----------|----------------|---|---|-----------|----------------|
| 买入返售金融资产 | 85,800,000.00 | - | - | - | 85,800,000.00 |
| 应收利息 | - | - | - | 32,650.16 | 32,650.16 |
| 资产总计 | 214,784,289.40 | - | - | 32,650.16 | 214,816,939.56 |
| 负债 | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 21,126.34 | 21,126.34 |
| 应付托管费 | - | - | - | 3,521.05 | 3,521.05 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 2,258.68 | 2,258.68 |
| 负债总计 | - | - | - | 26,906.07 | 26,906.07 |
| 利率敏感度缺口 | 214,784,289.40 | - | - | 5,744.09 | 214,790,033.49 |

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款等，所持有的债券占基金净资产比例低于 20%。除此之外的金融资产和金融负债均不计息。因此市场利率的变动对于本资产净值无重大影响。

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。本基金持有港股通标的的股票，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2021年6月30日 | | | |
|---------------|----------------------|--------------|----------------|--------------|
| | 美元 折合 人民币 元 | 港币 折合人民币元 | 其他币种 折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 8,103,627.12 | - | 8,103,627.12 |
| 资产合计 | - | 8,103,627.12 | - | 8,103,627.12 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 8,103,627.12 | - | 8,103,627.12 |
| 项目 | 上年度末 2020年12月31日 | | | |
| | 美元 | 港币 | 其他币种 | 合计 |

| | 折合人民币元 | 折合人民币元 | 折合人民币元 | |
|---------------|--------|--------|--------|---|
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 资产合计 | - | - | - | - |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | - | - | - |

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变 | | |
|----|--------------------------|-----------------------------|------------------------|
| | 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 个基准点 | 405,355.44 | - |
| | -5 个基准点 | -405,355.44 | - |

注：此表为外汇风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的股票公允价值的变动对基金净值产生的影响。

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和债券，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。

本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的比例为 0%-95%，其中投资于国内依法上市的股票比例占基金资产的 0-95%，投资于港股通标的股票比例占股票资产的 0-50%，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 | 54,360,395.16 | 90.75 | - | - |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—债券投资 | 500,350.00 | 0.84 | - | - |
| 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 | 54,860,745.16 | 91.59 | - | - |

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（2021年6月30日） | 上年度末（2020年12月31日） |
| | +5% | 2,991,450.99 | - |
| -5% | -2,991,450.99 | - | |

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 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 54,360,395.16 元（上年度末：0.00 元），属于第二层次的余额为人民币 500,350.00 元（上年度末：0.00 元），本报告期末及上年度末均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 | 54,360,395.16 | 88.54 |
| | 其中：股票 | 54,360,395.16 | 88.54 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 500,350.00 | 0.81 |
| | 其中：债券 | 500,350.00 | 0.81 |
| | 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 | 6,281,497.38 | 10.23 |
| 8 | 其他各项资产 | 257,491.54 | 0.42 |

| | | | |
|---|----|---------------|--------|
| 9 | 合计 | 61,399,734.08 | 100.00 |
|---|----|---------------|--------|

注：上述表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额为人民币 8,103,627.12 元，占基金净资产的比例为 13.53%。

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 | - | - |
| C | 制造业 | 38,741,136.04 | 64.68 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | - | - |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 1,619,592.00 | 2.70 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 5,896,040.00 | 9.84 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 46,256,768.04 | 77.22 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|--------------|--------------|
| 基础材料 | - | - |
| 消费者非必需品 | - | - |
| 消费者常用品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗保健 | 8,103,627.12 | 13.53 |
| 工业 | - | - |
| 信息技术 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | - | - |

| | | |
|-------|--------------|-------|
| 地产建筑业 | - | - |
| 合计 | 8,103,627.12 | 13.53 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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 | 300760 | 迈瑞医疗 | 10,000 | 4,800,500.00 | 8.01 |
| 2 | 688185 | 康希诺 | 3,000 | 2,333,310.00 | 3.90 |
| 2 | 06185 | 康希诺生物-B | 6,000 | 2,059,897.25 | 3.44 |
| 3 | 688139 | 海尔生物 | 40,653 | 4,272,630.30 | 7.13 |
| 4 | 688363 | 华熙生物 | 15,000 | 4,167,900.00 | 6.96 |
| 5 | 300896 | 爱美客 | 4,500 | 3,549,960.00 | 5.93 |
| 6 | 600276 | 恒瑞医药 | 50,339 | 3,421,541.83 | 5.71 |
| 7 | 688656 | 浩欧博 | 35,000 | 2,602,950.00 | 4.35 |
| 8 | 300347 | 泰格医药 | 13,000 | 2,512,900.00 | 4.20 |
| 9 | 300639 | 凯普生物 | 70,000 | 2,310,700.00 | 3.86 |
| 10 | 02359 | 药明康德 | 7,000 | 1,055,992.73 | 1.76 |
| 10 | 603259 | 药明康德 | 4,800 | 751,632.00 | 1.25 |
| 11 | 300653 | 正海生物 | 23,000 | 1,800,900.00 | 3.01 |
| 12 | 300685 | 艾德生物 | 17,000 | 1,769,360.00 | 2.95 |
| 13 | 01548 | 金斯瑞生物科技 | 60,000 | 1,692,450.72 | 2.83 |
| 14 | 600763 | 通策医疗 | 4,000 | 1,644,000.00 | 2.74 |
| 15 | 300171 | 东富龙 | 40,000 | 1,626,000.00 | 2.71 |
| 16 | 01801 | 信达生物 | 20,000 | 1,506,896.88 | 2.52 |
| 17 | 603456 | 九洲药业 | 30,000 | 1,457,400.00 | 2.43 |
| 18 | 300015 | 爱尔眼科 | 20,000 | 1,419,600.00 | 2.37 |
| 19 | 300358 | 楚天科技 | 70,000 | 1,309,700.00 | 2.19 |
| 20 | 300759 | 康龙化成 | 4,000 | 867,960.00 | 1.45 |
| 21 | 300357 | 我武生物 | 10,000 | 641,200.00 | 1.07 |
| 22 | 300725 | 药石科技 | 3,901 | 619,907.91 | 1.03 |
| 23 | 000739 | 普洛药业 | 20,000 | 588,000.00 | 0.98 |
| 24 | 01093 | 石药集团 | 60,000 | 561,154.75 | 0.94 |
| 25 | 00460 | 四环医药 | 200,000 | 552,501.12 | 0.92 |
| 26 | 688575 | 亚辉龙 | 9,140 | 405,816.00 | 0.68 |
| 27 | 000661 | 长春高新 | 1,000 | 387,000.00 | 0.65 |
| 28 | 688613 | 奥精医疗 | 4,000 | 363,160.00 | 0.61 |
| 29 | 02269 | 药明生物 | 3,000 | 355,214.95 | 0.59 |
| 30 | 603882 | 金城医学 | 2,000 | 319,540.00 | 0.53 |

| | | | | | |
|----|--------|------|--------|------------|------|
| 31 | 01530 | 三生制药 | 40,000 | 319,518.72 | 0.53 |
| 32 | 300298 | 三诺生物 | 10,000 | 313,200.00 | 0.52 |

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 | 600276 | 恒瑞医药 | 16,847,214.95 | 7.84 |
| 2 | 688363 | 华熙生物 | 12,960,366.57 | 6.03 |
| 3 | 300759 | 康龙化成 | 10,186,484.00 | 4.74 |
| 4 | 300760 | 迈瑞医疗 | 9,901,673.00 | 4.61 |
| 5 | 603259 | 药明康德 | 8,673,422.42 | 4.04 |
| 5 | 02359 | 药明康德 | 1,027,436.42 | 0.48 |
| 6 | 688139 | 海尔生物 | 9,066,872.29 | 4.22 |
| 7 | 300015 | 爱尔眼科 | 6,988,434.00 | 3.25 |
| 8 | 300347 | 泰格医药 | 6,274,607.00 | 2.92 |
| 9 | 000661 | 长春高新 | 6,133,538.00 | 2.86 |
| 10 | 300122 | 智飞生物 | 5,493,457.00 | 2.56 |
| 11 | 02269 | 药明生物 | 5,241,099.65 | 2.44 |
| 12 | 600529 | 山东药玻 | 5,046,261.00 | 2.35 |
| 13 | 300595 | 欧普康视 | 5,027,813.28 | 2.34 |
| 14 | 300630 | 普利制药 | 4,441,468.00 | 2.07 |
| 15 | 688185 | 康希诺 | 2,583,757.40 | 1.20 |
| 15 | 06185 | 康希诺生物-B | 1,630,901.85 | 0.76 |
| 16 | 300639 | 凯普生物 | 4,154,670.97 | 1.93 |
| 17 | 300896 | 爱美客 | 4,109,785.00 | 1.91 |
| 18 | 688026 | 洁特生物 | 3,895,713.24 | 1.81 |
| 19 | 01548 | 金斯瑞生物科技 | 3,853,779.81 | 1.79 |
| 20 | 01801 | 信达生物 | 3,696,694.11 | 1.72 |

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 | 688363 | 华熙生物 | 10,647,136.56 | 4.96 |
| 2 | 300759 | 康龙化成 | 10,065,866.00 | 4.69 |
| 3 | 600276 | 恒瑞医药 | 9,457,459.00 | 4.40 |
| 4 | 603259 | 药明康德 | 8,410,797.00 | 3.92 |
| 5 | 688139 | 海尔生物 | 6,473,183.68 | 3.01 |
| 6 | 300595 | 欧普康视 | 5,839,797.60 | 2.72 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 7 | 300122 | 智飞生物 | 5,527,911.00 | 2.57 |
| 8 | 300760 | 迈瑞医疗 | 5,246,041.00 | 2.44 |
| 9 | 600529 | 山东药玻 | 5,232,505.00 | 2.44 |
| 10 | 603987 | 康德莱 | 5,148,151.00 | 2.40 |
| 11 | 02269 | 药明生物 | 5,146,050.14 | 2.40 |
| 12 | 300630 | 普利制药 | 4,805,645.74 | 2.24 |
| 13 | 000661 | 长春高新 | 4,743,867.00 | 2.21 |
| 14 | 300015 | 爱尔眼科 | 4,496,756.00 | 2.09 |
| 15 | 688026 | 洁特生物 | 4,022,504.43 | 1.87 |
| 16 | 688356 | 键凯科技 | 3,969,140.67 | 1.85 |
| 17 | 688580 | 伟思医疗 | 3,956,388.02 | 1.84 |
| 18 | 300573 | 兴齐眼药 | 3,814,576.00 | 1.78 |
| 19 | 300347 | 泰格医药 | 3,640,031.00 | 1.69 |
| 20 | 300725 | 药石科技 | 3,633,698.00 | 1.69 |

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 | 240,644,346.16 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 197,043,724.68 |

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 | 500,350.00 | 0.84 |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 500,350.00 | 0.84 |

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 | 019649 | 21 国债 01 | 5,000 | 500,350.00 | 0.84 |

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投资资产支持证券。

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投资贵金属。

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投资权证。

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 | 61,926.10 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 3,481.60 |
| 4 | 应收利息 | 6,247.17 |
| 5 | 应收申购款 | 185,836.67 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 257,491.54 |

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

基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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

| 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 (%) |
| 国寿安保创新医药股票 A | 1,344 | 30,822.07 | 30,011,150.00 | 72.45 | 11,413,710.30 | 27.55 |
| 国寿安保创新医药股票 C | 1,628 | 5,970.15 | 3,000,675.00 | 30.87 | 6,718,733.33 | 69.13 |
| 合计 | 2,972 | 17,208.70 | 33,011,825.00 | 64.55 | 18,132,443.63 | 35.45 |

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持有本基金 | 国寿安保创新医药股票 A | 152,719.77 | 0.37 |
| | 国寿安保创新医药股票 C | 24,277.13 | 0.25 |
| | 合计 | 176,996.90 | 0.35 |

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金 | 国寿安保创新医药股票 A | 0~10 |
| | 国寿安保创新医药股票 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有 | 国寿安保创新医药股票 A | 0~10 |

| | | |
|--------|--------------|------|
| 本开放式基金 | 国寿安保创新医药股票 C | 0~10 |
| | 合计 | 0~10 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 国寿安保创新医药股票 A | 国寿安保创新医药股票 C |
|---------------------------------|----------------|---------------|
| 基金合同生效日（2020 年 12 月 28 日）基金份额总额 | 122,930,792.92 | 91,853,496.48 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 122,930,792.92 | 91,853,496.48 |
| 本报告期基金总申购份额 | 10,282,295.51 | 9,118,581.56 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 91,788,228.13 | 91,252,669.71 |
| 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 | 41,424,860.30 | 9,719,408.33 |

§ 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，交通银行托管部负责人由袁庆伟变更为徐铁。

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、基金托管人的专门基金托管部门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 | |
| 中泰证券 | 2 | 72,357,171.99 | 16.53% | 31,175.64 | 16.62% | - |
| 天风证券 | 2 | 365,330,898.85 | 83.47% | 156,385.00 | 83.38% | - |
| 兴业证券 | 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 |
| 中泰证券 | - | - | - | - | - | - |
| 天风证券 | 500,750.00 | 100.00% | 85,000,000.00 | 100.00% | - | - |
| 兴业证券 | - | - | - | - | - | - |

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 | 国寿安保创新医药股票型基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021年1月6日 |
| 2 | 国寿安保创新医药股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021年4月22日 |
| 3 | 国寿安保创新医药股票型证券投资基金更新基金招募说明书(2021年第1号) | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021年6月8日 |
| 4 | 国寿安保创新医药股票型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021年6月8日 |
| 5 | 国寿安保创新医药股票型基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告 | 上海证券报、证监会指定网站及公司网站 | 2021年1月6日 |
| 6 | 国寿安保创新医药股票型证券投资基金 2021 年第 1 季度报告 | 上海证券报、证监会指定网站及公司网站 | 2021年4月22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 | 报告期内持有基金份额变化情况 | 报告期末持有基金情况 |
|------|----------------|------------|
| | | |

| 别 | 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 | 90,011,150.00 | - | 60,000,000.00 | 30,011,150.00 | 58.68 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |
| 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创新医药股票型证券投资基金募集的文件
- 12.1.2 《国寿安保创新医药股票型证券投资基金基金合同》
- 12.1.3 《国寿安保创新医药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 报告期内国寿安保创新医药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

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