

# 国寿安保稳和 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：中信银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
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.....	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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
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真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>13</b>
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.....	15
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>44</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	49
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.....	50

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.....	50
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.....	50
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.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	50
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
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.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
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.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	国寿安保稳和6个月持有期混合	
基金主代码	010541	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020年11月24日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,693,253,956.38份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国寿安保稳和6个月持有期混合A	国寿安保稳和6个月持有期混合C
下属分级基金的交易代码	010541	010542
报告期末下属分级基金的份额总额	3,693,248,066.84份	1,000,005,889.54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。在大类资产配置上，本基金将优先考虑债券类资产的配置，剩余资产将配置于股票和现金类等大类资产上。除主要的债券及股票投资外，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	中债综合（全价）指数收益率*80%+沪深300指数收益率*10%+恒生指数收益率*5%+金融机构人民币活期存款利率（税后）*5%。
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。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	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	姜敏
	联系电话	010-50850744	4006800000
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		4009-258-258	95558
传真		010-50850776	010-85230024
注册地址		上海市虹口区丰镇路806号3幢306号	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层

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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	100033	100020
法定代表人	王军辉	李庆萍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中证报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a>
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)	
	国寿安保稳和6个月持有期混合A	国寿安保稳和6个月持有期混合C
本期已实现收益	70,563,832.28	16,816,694.32
本期利润	62,274,812.72	14,613,735.02
加权平均基金份额本期利润	0.0125	0.0102
本期加权平均净值利润率	1.23%	1.01%
本期基金份额净值增长率	1.22%	1.00%
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	60,076,407.82	13,521,100.75
期末可供分配基金份额利润	0.0163	0.0135
期末基金资产净值	3,766,858,721.81	1,017,186,073.38
期末基金份额净值	1.0199	1.0172
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	1.99%	1.72%

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

国寿安保稳和6个月持有期混合A

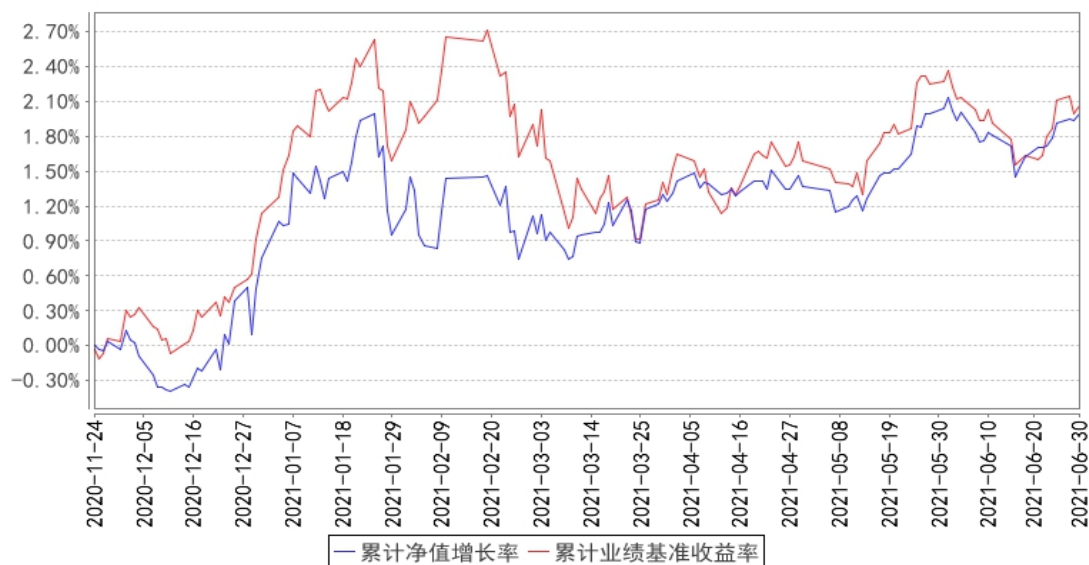
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.05%	0.10%	-0.21%	0.11%	0.16%	-0.01%
过去三个月	0.74%	0.09%	0.74%	0.13%	0.00%	-0.04%
过去六个月	1.22%	0.16%	0.91%	0.18%	0.31%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.99%	0.16%	2.06%	0.17%	-0.07%	-0.01%

国寿安保稳和6个月持有期混合C

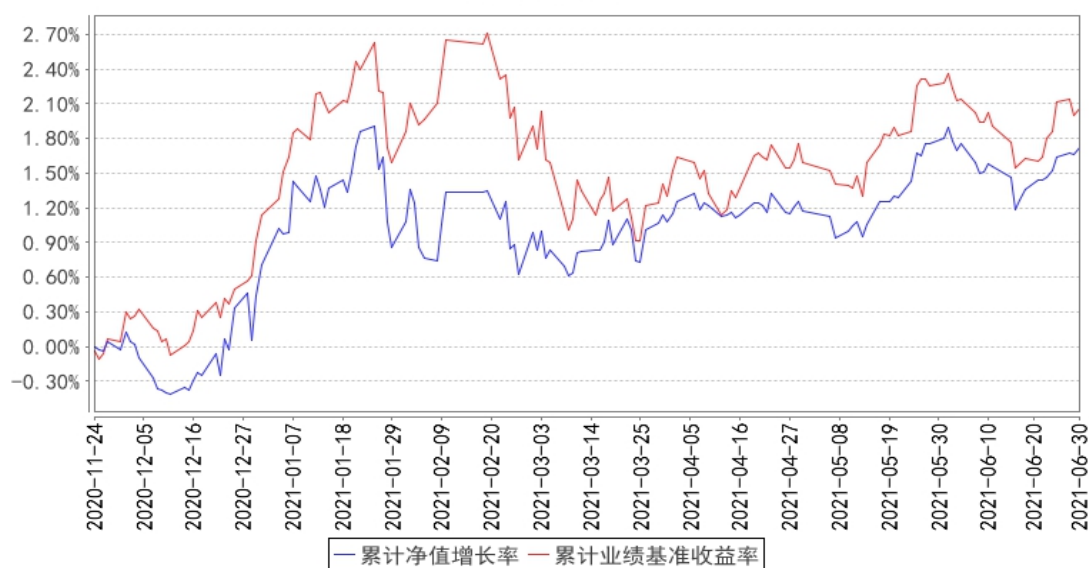
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.08%	0.10%	-0.21%	0.11%	0.13%	-0.01%
过去三个月	0.63%	0.09%	0.74%	0.13%	-0.11%	-0.04%
过去六个月	1.00%	0.16%	0.91%	0.18%	0.09%	-0.02%
自基金合同生效起至今	1.72%	0.16%	2.06%	0.17%	-0.34%	-0.01%

#### 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

国寿安保稳和6个月持有期混合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



国寿安保稳和6个月持有期混合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11月24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11月24日至2021年06月30日。

### 3.3 其他指标

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至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	证券	说明
----	----	-----------	----	----



		(助理) 期限		从业年限	
		任职日期	离任日期		
黄力	本基金的基金经理	2020年11月24日	-	11年	黄力先生，硕士，中国籍。曾任中国人寿资产管理有限公司投资经理助理；现任国寿安保安裕纯债半年定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保安盛纯债3个月定期开放债券型发起式证券投资基金、国寿安保尊耀纯债债券型证券投资基金、国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金、国寿安保中债-3-5年政策性金融债指数证券投资基金、国寿安保稳鑫一年持有期混合型证券投资基金、国寿安保稳安混合型证券投资基金、国寿安保尊庆6个月持有期债券型证券投资基金和国寿安保稳福6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。
吴坚	本基金的基金经理	2020年11月24日	-	13年	吴坚先生，博士研究生。曾任中国建设银行云南分行副经理、中国人寿资产管理有限公司一级研究员，现任国寿安保稳惠灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳诚混合型证券投资基金、国寿安保稳荣混合型证券投资基金、国寿安保策略精选灵活配置混合型证券投资基金（LOF）、国寿安保稳泰一年定期开放混合型证券投资基金、国寿安保科技创新3年封闭运作灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金、国寿安保稳安混合型证券投资基金和国寿安保稳福6个月持有期混合型证券投资基金基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，

保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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。

#### 4.4 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

债市的主线是央行货币政策的由紧转松，春节前后债市走势截然不同。春节前通胀预期走高，货币收紧预期发酵，收益率出现一波上行。期间我们承受了一定的回撤，并在此过程中适度降低了组合久期和杠杆。3月以来，央行呵护下收益率出现一轮明显下行，彼时国内疫情受控、外需强劲、且地产销售尚有韧性，基本面偏强的背景下我们对央行行为和资金面保持了观察态度，在维持基础久期的同时适度增强了信用债配置，积极调整组合持仓结构。6月中旬以来，我们再度确认半年末央行的积极表态，稳步提高组合久期水平。

股票市场在一季度呈现较大波动，总体分为三个阶段，第一个阶段是从年初到2月初，茅指数及部分抱团核心股票呈现加速上行态势，由于疫苗的推广，受益与经济复苏和通胀板块的石化、有色金属、银行等涨幅同样位居前列；第二个阶段从2月上旬开始，美债十年期国债加速上行，代表抱团方向的茅指数及前期涨幅较高的新能源、白酒、石化、有色等板块快速下跌，而代表碳中和方向的主题板块较为活跃，电力、钢铁等行业涨幅居前；第三个阶段是前期较高波动的在一季度最后一周抱团白马股有一定反弹。整体来看，一季度市场演绎较为无序，更多的是估值端的修复，包括较高估值的向下挤泡沫以及较低估值板块的向上修正。在一季度后期大幅下跌之后，市场整体在二季度明显反弹，其中结构分化非常明显。上证指数二季度上涨4.3%，创业板指数涨幅高达26%。其中，电气设备、电子、汽车、化工、医药生物、采掘等申万一级行业涨幅都在10%以上，前三名涨幅分别高达30%、21%和18%。市场在释放了对于流动性和高估值的担忧之后，重新选择了景气度高，代表未来方向的赛道。创新药产业链、新能源、半导体在业绩高增、景气度高企的基础上成了资金追逐焦点。

#### 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和6个月持有期混合A基金份额净值为1.0199元，本报告期基金份额净值增长率为1.22%；截至本报告期末国寿安保稳和6个月持有期混合C基金份额净值为1.0172元，本报告期基金份额净值增长率为1.00%；业绩比较基准收益率为0.91%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

社融增速下行已逾半年，经济增长环比高点滞后出现，PMI移动中枢见顶回落。连续一个季度的流动性宽松后，央行全面降准信号可能重塑市场对货币政策的预期，当前情形与2018年上半年有相似之处，不同在于10年国债收益率点位偏低。考虑到三季度MLF到期1.7万亿，四季度到期2.45万亿，一次全面降准可能难以覆盖到期资金缺口，历史上降准降息也多为连续行为。需要注意的是，收益率处于低位时，市场止盈心态较重，市场波动可能加大。整体上，我们认为在未看到资金中枢出现明显上行的环境下，下半年债市仍处于有利窗口。交易行为引发的波动过后，市场调整空间可控。未来半年，组合将维持中性适度的弹性久期和相对积极的杠杆水平，持仓将以信用债配置思路为主、获取稳定的套息收益，同时保持久期适度积极、灵活参与利率债波段交易。

二季度股票市场呈现明显反弹之后，部分高景气行业的估值已经反映了市场的乐观预期。一方面，这些行业和板块的长期逻辑正在被市场认可；另一方面，在市场预期已经比较乐观的背景下，股价对于行业层面的变化将变得更为敏感。从整体看，市场自身孕育着内部平衡机制，风险收益比永远在下一个平衡点的路上。本基金将更加深入扎实做好行业和公司研究，同时密切关注宏观经济环境的边际变化，均衡配置，努力控制组合波动，让整个组合的风险收益比始终处于合意状态。

#### 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

和程序的有效性及其适用性的情况时，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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金2021年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司在国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2021年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保稳和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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	68,704,950.15	982,973,208.03
结算备付金		19,868,046.51	49,145,860.63
存出保证金		5,621,375.14	335,197.53
交易性金融资产	6.4.7.2	4,936,219,382.17	6,905,751,515.61
其中：股票投资		394,087,798.47	900,815,015.61
基金投资		-	-
债券投资		4,456,826,083.70	5,759,789,500.00
资产支持证券投资		85,305,500.00	245,147,000.00
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	-	649,021,493.53
应收证券清算款		585,610.10	-
应收利息	6.4.7.5	75,923,888.33	102,537,849.76
应收股利		-	-
应收申购款		497.03	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		5,106,923,749.43	8,689,765,125.09
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年6月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		200,999,827.50	1,890,083,674.90
应付证券清算款		10.71	59,775,615.07
应付赎回款		116,094,441.80	-
应付管理人报酬		3,465,346.52	4,524,726.66
应付托管费		649,752.48	848,386.26
应付销售服务费		419,749.45	567,018.23
应付交易费用	6.4.7.7	943,462.60	849,318.77
应交税费		131,072.45	234,060.77

应付利息		66,194.79	100,489.04
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	109,095.94	10,000.00
负债合计		322,878,954.24	1,956,993,289.70
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	4,693,253,956.38	6,682,858,401.98
未分配利润	6.4.7.10	90,790,838.81	49,913,433.41
所有者权益合计		4,784,044,795.19	6,732,771,835.39
负债和所有者权益总计		5,106,923,749.43	8,689,765,125.09

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额总额4,693,253,956.38份，其中国寿安保稳和6个月持有期混合A基金份额总额3,693,248,066.84份，基金份额净值1.0199元；国寿安保稳和6个月持有期混合C基金份额总额1,000,005,889.54份，基金份额净值1.0172元。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保稳和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		125,210,384.97
1. 利息收入		115,348,596.75
其中：存款利息收入	6.4.7.11	7,856,311.78
债券利息收入		104,315,991.89
资产支持证券利息收入		2,718,967.34
买入返售金融资产收入		457,325.74
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		20,353,767.08
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,411,660.37
基金投资收益	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	23,520,009.03
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	-9,258,860.88
股利收益	6.4.7.16	2,680,958.56
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-10,491,978.86
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		48,321,837.23
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,894,664.62
2. 托管费	6.4.10.2.2	4,855,249.62

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,235,794.77
4. 交易费用	6.4.7.19	5,838,009.80
5. 利息支出		8,243,896.19
其中：卖出回购金融资产支出		8,243,896.19
6. 税金及附加		124,123.70
7. 其他费用	6.4.7.20	130,098.53
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		76,888,547.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		76,888,547.74

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保稳和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（基金净值）	6,682,858,401.98	49,913,433.41	6,732,771,835.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	76,888,547.74	76,888,547.74
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）	-1,989,604,445.60	-36,011,142.34	-2,025,615,587.94
其中：1. 基金申购款	94,227,657.57	1,006,891.96	95,234,549.53
2. 基金赎回款	-2,083,832,103.17	-37,018,034.30	-2,120,850,137.47
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）	4,693,253,956.38	90,790,838.81	4,784,044,795.19

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

国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]2662号《关于准予国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由国寿安保基金管理

有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、开放式，存续期限不定，首次设立共募集人民币6,682,858,401.98元，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2020)验字第61090605\_A19号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2020年11月24日正式生效，基金合同生效日国寿安保稳和6个月A类基金份额为5,193,731,845.96份基金份额，其中认购资金利息折合712,079.52份基金份额；国寿安保稳和6个月C类基金份额为1,489,126,556.02份基金份额，其中认购资金利息折合189,516.74份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

根据《国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认(申)购时收取认(申)购费，不收取销售服务费，且在赎回时根据持有期限收取赎回费的，称为A类基金份额；在投资者认(申)购时不收取认(申)购费，而是从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费的，称为C类基金份额。本基金A类基金份额、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，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、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、信用衍生品、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。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%-30%，其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例为0-50%；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。

本财务报表由本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司于2021年8月30日批准报出。

#### 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

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及

持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

#### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，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) 当金融工具不存在活跃市场，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。采用估值技术时，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，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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平准金和未实现平准金。已实现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损益占基金净值比例计算的金额。未实现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

未实现损益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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。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按除权日的该类别基金份额净值自动转为相应类别的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。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。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各类基金份额净值减去该类别每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

无。

#### 6.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种

(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票

的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日	
	活期存款	68,704,950.15
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	68,704,950.15	

##### 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	387,499,488.95	394,087,798.47	6,588,309.52
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	496,207,201.65	497,888,083.70
	银行间市场	3,939,092,247.11	3,958,938,000.00
	合计	4,435,299,448.76	4,456,826,083.70
资产支持证券	85,155,500.00	85,305,500.00	150,000.00
基金	-	-	-

其他	-	-	-
合计	4,907,954,437.71	4,936,219,382.17	28,264,944.46

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-195,522,500.00	-	-	-
其中：国债期货投资	-195,522,500.00	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-195,522,500.00	-	-	-

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	11,960.33
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	3,896.25
应收债券利息	75,354,123.36
应收资产支持证券利息	553,150.49
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	757.90
合计	75,923,888.33



## 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	896,576.81
银行间市场应付交易费用	46,885.79
合计	943,462.60

## 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	109,095.94
合计	109,095.94

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

## 国寿安保稳和6个月持有期混合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	5,193,731,845.96	5,193,731,845.96
本期申购	62,406,632.22	62,406,632.22
本期赎回（以“-”号填列）	-1,562,890,411.34	-1,562,890,411.34
-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	3,693,248,066.84	3,693,248,066.84

## 国寿安保稳和6个月持有期混合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	1,489,126,556.02	1,489,126,556.02
本期申购	31,821,025.35	31,821,025.35
本期赎回（以“-”号填列）	-520,941,691.83	-520,941,691.83
-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	1,000,005,889.54	1,000,005,889.54

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

##### 国寿安保稳和6个月持有期混合A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,236,673.55	29,084,901.30	39,321,574.85
本期利润	70,563,832.28	-8,289,019.56	62,274,812.72
本期基金份额交易产生的变动数	-20,724,098.01	-7,261,634.59	-27,985,732.60
其中：基金申购款	792,647.23	-99,378.33	693,268.90
基金赎回款	-21,516,745.24	-7,162,256.26	-28,679,001.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	60,076,407.82	13,534,247.15	73,610,654.97

##### 国寿安保稳和6个月持有期混合C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,257,336.54	8,334,522.02	10,591,858.56
本期利润	16,816,694.32	-2,202,959.30	14,613,735.02
本期基金份额交易产生的变动数	-5,552,930.11	-2,472,479.63	-8,025,409.74
其中：基金申购款	359,587.50	-45,964.44	313,623.06
基金赎回款	-5,912,517.61	-2,426,515.19	-8,339,032.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,521,100.75	3,659,083.09	17,180,183.84

#### 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	178,369.04
定期存款利息收入	7,488,000.00
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	172,215.58
其他	17,727.16
合计	7,856,311.78

## 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	3,411,660.37
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,411,660.37

## 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	2,551,014,730.15
减：卖出股票成本总额	2,547,603,069.78
买卖股票差价收入	3,411,660.37

## 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	23,520,009.03
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	23,520,009.03

## 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	10,130,455,425.84
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,957,768,619.84
减：应收利息总额	149,166,796.97

买卖债券差价收入	23,520,009.03
----------	---------------

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	206,268,004.07
减：卖出资产支持证券成本总额	204,844,500.00
减：应收利息总额	1,423,504.07
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

本基金于本报告期权证投资产生的收益/损失。

#### 6.4.7.15.1 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2021年1月1日至2021年6月30日
国债期货投资收益	-9,258,860.88

#### 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	2,680,958.56
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,680,958.56

#### 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	-9,154,478.86
股票投资	-10,346,691.43
债券投资	1,189,212.57
资产支持证券投资	3,000.00
基金投资	-
贵金属投资	-

其他	-
2. 衍生工具	-1,337,500.00
权证投资	-
期货投资	-1,337,500.00
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	-10,491,978.86

#### 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	5,716,123.91
银行间市场交易费用	88,110.00
期货交易费用	33,775.89
合计	5,838,009.80

#### 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	11,702.59
上清所账户维护费	4,500.00
中债登账户维护费	4,500.00
其他	300.00
合计	130,098.53

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人、注册登记机构、直销机构
中信银行	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

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的交易。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	25,894,664.62
其中：支付销售机构的客户维护费	12,937,594.36

注：支付基金管理人国寿安保基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.80\% / \text{当年天数}$$

###### 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	4,855,249.62

注：支付基金托管人广发银行的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.15\% / \text{当年天数}$$

## 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		
	国寿安保稳和6个月持有期混合A	国寿安保稳和6个月持有期混合C	合计
国寿安保	-	940.69	940.69
中信银行	-	2,355,978.50	2,355,978.50
合计	-	2,356,919.19	2,356,919.19

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金资产净值0.45%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国寿安保基金，再由国寿安保基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日C类基金资产净值 × 0.45% / 当年天数。

## 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

本基金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

份额单位：份

项目	本期	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日	2021年1月1日至2021年6月30日
	国寿安保稳和6个月持有期混合A	国寿安保稳和6个月持有期混合C
基金合同生效日（2020年11月24日）持有的基金份额	999,725.25	-
报告期初持有的基金份额	999,725.25	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	999,725.25	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.03%	-

##### 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

除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末未运用固有资金投资本基金。

#### 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
中信银行股份有限公司	68,704,950.15	178,369.04

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
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	648	5,616.00	17,768.16	锁定期内发生送股
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300953	震裕科技	2021年3月11日	2021年9月22日	新股流通受限	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
300955	嘉亨家化	2021年3月16日	2021年9月24日	新股流通受限	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300956	英力股份	2021年3月16日	2021年9月27日	新股流通受限	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300957	贝泰妮	2021年3月18日	2021年9月27日	新股流通受限	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300960	通业	2021年3月	2021年9月	新股流	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-

	科技	月22日	月29日	通受限						
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300966	共同药业	2021年3月31日	2021年10月11日	新股流通受限	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300967	晓鸣股份	2021年4月2日	2021年10月13日	新股流通受限	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300968	格林精密	2021年4月6日	2021年10月15日	新股流通受限	6.87	12.07	1,162	7,982.94	14,025.34	-
300971	博亚精工	2021年4月7日	2021年10月15日	新股流通受限	18.24	28.29	245	4,468.80	6,931.05	-
300972	万辰生物	2021年4月8日	2021年10月19日	新股流通受限	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300973	立高食品	2021年4月8日	2021年10月15日	新股流通受限	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
300975	商络电子	2021年4月14日	2021年10月21日	新股流通受限	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300978	东箭科技	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300979	华利集团	2021年4月15日	2021年10月26日	新股流通受限	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
300982	苏文电能	2021年4月19日	2021年10月27日	新股流通受限	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300985	致远新能	2021年4月21日	2021年10月29日	新股流通受限	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
300986	志特新材	2021年4月21日	2021年11月1日	新股流通受限	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300991	创益通	2021年5月12日	2021年11月22日	新股流通受限	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300992	泰福泵业	2021年5月17日	2021年11月25日	新股流通受限	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
300995	奇德新材	2021年5月17日	2021年11月26日	新股流通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
300996	普联软件	2021年5月26日	2021年12月3日	新股流通受限	20.81	42.23	482	10,030.42	20,354.86	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-

301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301007	德迈仕	2021年6月4日	2021年12月16日	新股流通受限	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
301010	晶雪节能	2021年6月9日	2021年12月20日	新股流通受限	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
301011	华立科技	2021年6月9日	2021年12月17日	新股流通受限	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
301012	扬电科技	2021年6月15日	2021年12月22日	新股流通受限	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
301013	利和兴	2021年6月21日	2021年12月29日	新股流通受限	8.72	27.11	471	4,107.12	12,768.81	-
301015	百洋医药	2021年6月22日	2021年12月30日	新股流通受限	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
301016	雷尔伟	2021年6月23日	2021年12月30日	新股流通受限	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2021年7月5日	新股未上市	8.86	8.86	4,995	44,255.70	44,255.70	-
301017	漱玉平民	2021年6月23日	2022年1月5日	新股流通受限	8.86	8.86	555	4,917.30	4,917.30	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	10.64	10.64	3,789	40,314.96	40,314.96	-
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	10.64	421	4,479.44	4,479.44	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	9.46	9.46	2,609	24,681.14	24,681.14	-
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	9.46	290	2,743.40	2,743.40	-
605162	新中港	2021年6月29日	2021年7月7日	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
605287	德才股份	2021年6月28日	2021年7月6日	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
688087	英科再生	2021年6月30日	2021年7月9日	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
688092	爱科科技	2021年3月12日	2021年9月22日	新股流通受限	19.11	33.21	1,137	21,728.07	37,759.77	-
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	-
688314	康拓医疗	2021年5月11日	2021年11月18日	新股流通受限	17.34	74.48	1,085	18,813.90	80,810.80	-
688499	利元	2021年6月	2021年7月	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-

	亨	月23日	月1日	上市						
688538	和辉光电	2021年5月20日	2021年11月29日	新股流通受限	2.65	3.38	375,156	994,163.40	1,268,027.28	-
688607	康众医疗	2021年1月25日	2021年8月2日	新股流通受限	23.21	44.50	1,890	43,866.90	84,105.00	-
688655	迅捷兴	2021年4月28日	2021年11月11日	新股流通受限	7.59	15.77	3,083	23,399.97	48,618.91	-
688676	金盘科技	2021年3月2日	2021年9月9日	新股流通受限	10.10	16.24	3,750	37,875.00	60,900.00	-
688686	奥普特	2020年12月24日	2021年7月1日	新股流通受限	78.49	451.00	2,330	182,881.70	1,050,830.00	-

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17日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	8,720	872,000.00	872,000.00	-

注：1. 根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导意见》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。

2. 根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

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

截至本报告期末2021年06月30日止，本基金从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额人民币34,999,827.5元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
200212	20国开12	2021年7月6日	100.50	360,000	36,180,000.00
合计				360,000	36,180,000.00

#### 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,本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人民币166,000,000.00元,其中88,000,000.00元,于2021年7月1日到期,其中33,000,000.00元,于2021年7月5日到期,其中45,000,000.00元,于2021年7月6日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的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

本基金本报告期末未持有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

本基金为混合型基金,预期风险收益水平相应会高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金,属于中等风险/收益的投资品种。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、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、信用衍生品、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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金将通过对宏观经济和资本市场的深入分析,采用主动的投资管理策略,把握不同时期各金融市场的收益水平,在约定的投资比例下,合理配置股票、债券、货币市场工具等各类资产,在严格控制下行风险的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。本基金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、监察稽核部和各业务部门业务人员

岗位自控构成。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析相结合的风险管理方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况,导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行广发银行,因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算,违约风险可能性很小;在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险,且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险,本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于2021年6月30日,除卖出回购金融资产款余额中有200,999,827.50元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外,本基金所承担的其他金融负债的合约

约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。于开放期内，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2021年6月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种比重较大，此外还持有银行存款、结算备付金及存出保证金等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

##### 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	68,704,950.15	-	-	-	68,704,950.15
结算备付金	19,868,046.51	-	-	-	19,868,046.51
存出保证金	5,621,375.14	-	-	-	5,621,375.14
交易性金融资产	986,012,083.70	2,512,059,500.00	1,044,060,000.00	394,087,798.47	4,936,219,382.17
应收利息	-	-	-	75,923,888.33	75,923,888.33
应收申购款	-	-	-	497.03	497.03
应收证券清算款	-	-	-	585,610.10	585,610.10
资产总计	1,080,206,455.50	2,512,059,500.00	1,044,060,000.00	470,597,793.93	5,106,923,749.43
负债					
应付赎回款	-	-	-	116,094,441.80	116,094,441.80
应付管理人报酬	-	-	-	3,465,346.52	3,465,346.52
应付托管费	-	-	-	649,752.48	649,752.48
应付证券清算款	-	-	-	10.71	10.71
卖出回购金融资产款	200,999,827.50	-	-	-	200,999,827.50
应付销售服务费	-	-	-	419,749.45	419,749.45
应付交易费用	-	-	-	943,462.60	943,462.60
应付利息	-	-	-	66,194.79	66,194.79
应交税费	-	-	-	131,072.45	131,072.45



其他负债	-	-	-	109,095.94	109,095.94
负债总计	200,999,827.50	-	-	121,879,126.74	322,878,954.24
利率敏感度缺口	879,206,628.00	2,512,059,500.00	1,044,060,000.00	348,718,667.19	4,784,044,795.19
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	982,973,208.03	-	-	-	982,973,208.03
结算备付金	49,145,860.63	-	-	-	49,145,860.63
存出保证金	335,197.53	-	-	-	335,197.53
交易性金融资产	986,273,000.00	1,390,751,500.00	3,627,912,000.00	900,815,015.61	6,905,751,515.61
买入返售金融资产	649,021,493.53	-	-	-	649,021,493.53
应收利息	-	-	-	102,537,849.76	102,537,849.76
资产总计	2,667,748,759.72	1,390,751,500.00	3,627,912,000.00	1,003,352,865.37	8,689,765,125.09
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,524,726.66	4,524,726.66
应付托管费	-	-	-	848,386.26	848,386.26
应付证券清算款	-	-	-	59,775,615.07	59,775,615.07
卖出回购金融资产款	1,890,083,674.90	-	-	-	1,890,083,674.90
应付销售服务费	-	-	-	567,018.23	567,018.23
应付交易费用	-	-	-	849,318.77	849,318.77
应付利息	-	-	-	100,489.04	100,489.04
应交税费	-	-	-	234,060.77	234,060.77
其他负债	-	-	-	10,000.00	10,000.00
负债总计	1,890,083,674.90	-	-	66,909,614.80	1,956,993,289.70
利率敏感度缺口	777,665,084.82	1,390,751,500.00	3,627,912,000.00	936,443,250.57	6,732,771,835.39

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。		
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）
	+25个基准点	-41,381,987.48	-51,842,343.13
-25个基准点	41,381,987.48	51,842,343.13	

#### 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发生波动的

风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的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	-	48,693,321.60	-	48,693,321.60
资产合计	-	48,693,321.60	-	48,693,321.60
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	-	48,693,321.60	-	48,693,321.60
项目	上年度末 2020年12月31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	-	58,123,658.40	-	58,123,658.40
资产合计	-	58,123,658.40	-	58,123,658.40
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	-	58,123,658.40	-	58,123,658.40

#### 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； 此项影响并未考虑管理层为减低汇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	+5个基准点	2,434,666.08	2,906,182.92
	-5个基准点	-2,434,666.08	-2,906,182.92

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易

所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。股票资产占基金资产的比例为0%-30%，其中，投资于港股通标的股票占股票资产的比例为0-50%；本基金持有的同业存单，其投资比例不得超过基金资产的2%；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。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于2021年6月30日，本基金无重大价格风险。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年6月30日，本基金主要投资于固定收益品种，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对本基金资产净值无重大影响。

### 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

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年6月30日，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

融资产中属于第二层次的余额为 394,087,798.47 元，无属于第一层和第三层次的余额。

(ii) 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；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

#### 6.4.14.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金除公允价值外，无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	394,087,798.47	7.72
	其中：股票	394,087,798.47	7.72
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,542,131,583.70	88.94
	其中：债券	4,456,826,083.70	87.27
	资产支持证券	85,305,500.00	1.67
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	88,572,996.66	1.73

8	其他各项资产	82,131,370.60	1.61
9	合计	5,106,923,749.43	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48,693,321.60元，占基金净资产的比例为1.02%。

## 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	283,205,061.77	5.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	40,620,000.00	0.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	50,403.70	0.00
J	金融业	21,334,721.10	0.45
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	39,030.68	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	345,394,476.87	7.22

### 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	8,354,083.20	0.17
消费者常用品	-	-
能源	7,347,266.40	0.15
金融	21,758,892.00	0.45
医疗保健	-	-
工业	-	-
信息技术	11,233,080.00	0.23
电信服务	-	-

公用事业	-	-
地产建筑业	-	-
合计	48,693,321.60	1.02

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	000858	五粮液	150,046	44,697,202.94	0.93
2	002352	顺丰控股	600,000	40,620,000.00	0.85
3	600660	福耀玻璃	599,925	33,505,811.25	0.70
4	601012	隆基股份	350,000	31,094,000.00	0.65
5	002475	立讯精密	670,000	30,820,000.00	0.64
6	600104	上汽集团	1,000,000	21,970,000.00	0.46
7	01658	邮储银行	5,000,000	21,758,892.00	0.45
8	600438	通威股份	500,000	21,635,000.00	0.45
9	600919	江苏银行	3,000,000	21,300,000.00	0.45
10	600519	贵州茅台	9,904	20,369,556.80	0.43
11	300207	欣旺达	599,971	19,535,055.76	0.41
12	002056	横店东磁	1,414,300	18,385,900.00	0.38
13	01810	小米集团-W	500,000	11,233,080.00	0.23
14	002371	北方华创	39,958	11,083,550.04	0.23
15	002311	海大集团	120,000	9,792,000.00	0.20
16	600703	三安光电	300,000	9,615,000.00	0.20
17	02333	长城汽车	400,000	8,354,083.20	0.17
18	00883	中国海洋石油	1,000,000	7,347,266.40	0.15
19	002402	和而泰	300,000	7,191,000.00	0.15
20	688538	和辉光电	375,156	1,268,027.28	0.03
21	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.02
22	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
23	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.00
24	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
25	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
26	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.00
27	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.00
28	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
29	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
30	688655	迅捷兴	3,083	48,618.91	0.00
31	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
32	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
33	688092	爱科科技	1,137	37,759.77	0.00

34	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
35	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
36	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
37	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
38	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
39	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
40	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
41	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
42	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
43	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
44	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
45	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
46	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
47	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
48	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
49	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
50	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
51	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
52	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
53	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
54	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
55	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
56	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
57	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
58	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
59	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
60	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
61	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
62	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
63	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
64	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
65	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
66	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
67	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
68	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
69	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
70	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
71	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
72	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
73	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
74	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
75	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00

76	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
77	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
78	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
79	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
80	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
81	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
82	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
83	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
84	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
85	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
86	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
87	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	146,051,768.91	2.17
2	603128	华贸物流	85,354,323.42	1.27
3	000651	格力电器	81,232,790.00	1.21
4	00941	中国移动	79,383,306.13	1.18
5	603658	安图生物	71,867,248.49	1.07
6	600438	通威股份	69,959,424.94	1.04
7	601888	中国中免	64,464,864.62	0.96
8	000830	鲁西化工	61,954,204.72	0.92
9	02333	长城汽车	60,461,465.67	0.90
10	300316	晶盛机电	54,897,684.77	0.82
11	600519	贵州茅台	54,889,986.00	0.82
12	00939	建设银行	54,557,098.39	0.81
13	300207	欣旺达	53,788,057.95	0.80
14	00268	金蝶国际	52,762,685.64	0.78
15	002056	横店东磁	46,223,352.86	0.69
16	002594	比亚迪	46,193,368.00	0.69
17	002352	顺丰控股	43,888,912.10	0.65
18	002677	浙江美大	38,687,251.40	0.57
19	00883	中国海洋石油	36,605,551.97	0.54
20	000568	泸州老窖	33,674,517.00	0.50

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	601939	建设银行	121,426,921.32	1.80
1	00939	建设银行	51,506,883.26	0.77
2	601658	邮储银行	128,384,191.66	1.91
3	002594	比亚迪	96,423,500.00	1.43
4	000858	五粮液	94,681,412.20	1.41
5	600438	通威股份	94,645,919.71	1.41
6	603128	华贸物流	88,402,794.11	1.31
7	300316	晶盛机电	87,714,850.06	1.30
8	00941	中国移动	82,706,227.00	1.23
9	601398	工商银行	81,947,484.00	1.22
10	02333	长城汽车	75,279,518.65	1.12
11	000651	格力电器	73,912,682.00	1.10
12	300750	宁德时代	71,638,576.00	1.06
13	601888	中国中免	71,569,738.40	1.06
14	300207	欣旺达	67,949,919.10	1.01
15	603658	安图生物	66,943,257.92	0.99
16	300724	捷佳伟创	65,046,595.84	0.97
17	000830	鲁西化工	62,437,875.98	0.93
18	300118	东方日升	60,452,005.87	0.90
19	00268	金蝶国际	59,631,547.11	0.89
20	002407	多氟多	51,643,374.61	0.77

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	2,051,222,544.07
卖出股票收入（成交）总额	2,551,014,730.15

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	152,577,000.00	3.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,618,305,000.00	54.73

	其中：政策性金融债	1,467,118,000.00	30.67
4	企业债券	301,308,000.00	6.30
5	企业短期融资券	60,198,000.00	1.26
6	中期票据	930,126,000.00	19.44
7	可转债（可交换债）	5,852,083.70	0.12
8	同业存单	388,460,000.00	8.12
9	其他	-	-
10	合计	4,456,826,083.70	93.16

## 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	200212	20 国开 12	9,400,000	944,700,000.00	19.75
2	200408	20 农发 08	2,600,000	262,106,000.00	5.48
3	210301	21 进出 01	2,600,000	260,312,000.00	5.44
4	1828002	18 农业银行二级 01	2,000,000	204,100,000.00	4.27
5	175629	21 财金 01	2,000,000	201,020,000.00	4.20

## 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	179047	建租 4A2	450,000	45,076,500.00	0.94
2	2089525	20 海盈 1A_bc	2,450,000	40,229,000.00	0.84

## 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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本报告期，本基金的国债期货投资以风险管理为原则，以套期保值为目的，并结合国债现货市场和期货市场的波动性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行操作，对冲投资风险。本基金国债期货交易总体风险可控，符合既定的投资政策和投资目标。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险指标说明
T2109	T2109	-200	-196,860,000.00	-1,337,500.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-1,337,500.00
国债期货投资本期收益(元)					-9,258,860.88
国债期货投资本期公允价值变动(元)					-1,337,500.00

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本报告期，本基金的国债期货投资整体操作上相对谨慎，对基金的收益以及波动性控制都有一定的积极作用。后期仍将努力把握确定性较大的机会，对冲投资风险，提升基金收益。

### 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	5,621,375.14
2	应收证券清算款	585,610.10
3	应收股利	-
4	应收利息	75,923,888.33
5	应收申购款	497.03
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	82,131,370.60

#### 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可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 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(%)
国寿安保稳和6个月持有期混合A	22,887	161,368.81	999,725.25	0.03	3,692,248,341.59	99.97
国寿安保稳和6个月持有期混合C	6,147	162,681.94	-	-	1,000,005,889.54	100.00
合计	29,034	161,646.83	999,725.25	0.02	4,692,254,231.13	99.98

### 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	国寿安保稳和6个月持有期混合A	944,452.90	0.03
	国寿安保稳和6个月持有期混合C	302,086.49	0.03
	合计	1,246,539.39	0.03

### 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	国寿安保稳和6个月持有期混合A	0
	国寿安保稳和6个月持有期混合C	10~50
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保稳和6个月持有期混合A	50~100
	国寿安保稳和6个月持有期混合C	0
	合计	50~100

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保稳和6个月持有期混合A	国寿安保稳和6个月持有期混合C
基金合同生效日(2020年11月24日)基金份额总额	5,193,731,845.96	1,489,126,556.02
本报告期期初基金份额总额	5,193,731,845.96	1,489,126,556.02
本报告期基金总申购份额	62,406,632.22	31,821,025.35
减:本报告期基金总赎回份额	1,562,890,411.34	520,941,691.83
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	3,693,248,066.84	1,000,005,889.54

## § 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的人事变动。

### 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普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内,基金管理人、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

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	
中信证券	2	1,857,680,483.03	40.44%	801,225.23	35.72%	-
国盛证券	2	1,823,892,455.51	39.71%	786,648.61	35.07%	-
兴业证券	1	911,994,258.57	19.85%	655,273.81	29.21%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

### 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
中信证券	458,845,194.10	50.05%	1,778,300,000.00	30.78%	-	-
国盛证券	261,036,800.00	28.47%	3,999,600,000.00	69.22%	-	-
兴业证券	109,862,500.00	11.98%	-	-	-	-
银河证券	87,000,000.00	9.49%	-	-	-	-

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。

## 10.8 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	关于国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金暂停大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021年2月19日
2	国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购、转换和定期定额投资业务的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021年2月19日
3	关于国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金恢复大额申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021年3月10日
4	国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金2021年第1季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021年4月22日
5	国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021年5月24日
6	国寿安保稳和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	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021年6月8日
7	国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书2021年第1号20210605	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021年6月8日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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和6个月持有期混合型证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保稳和6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保稳和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和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.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2021年8月31日