

国寿安三国证创业板中盘精选 88 交易型
开放式指数证券投资基金
2021 年中期报告

2021 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安三国证基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

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。

基金托管人中信证券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	8
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.....	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	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.....	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	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	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	42
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.....	42
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	42

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.....	42
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.....	42
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42
7.12 投资组合报告附注.....	43
§ 8 基金份额持有人信息.....	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	43
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	44
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	44
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	44
§ 9 开放式基金份额变动.....	44
§ 10 重大事件揭示.....	45
10.1 基金份额持有人大会决议.....	45
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	45
10.4 基金投资策略的改变.....	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	45
10.8 其他重大事件.....	46
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....	47
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.....	47
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	48
§ 12 备查文件目录.....	48
12.1 备查文件目录.....	48
12.2 存放地点.....	48
12.3 查阅方式.....	48

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保创精选 88ETF
场内简称	创精选 88
基金主代码	159804
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 3 月 4 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中信证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	173,899,676.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 3 月 31 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	国证创业板中盘精选 88 指数
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	国寿安保基金管理有限公司	中信证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
		杨军智
		010-60834299
		yjz@citics.com

客户服务电话	4009-258-258	400-889-5548
传真	010-50850776	010-60834004
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座
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	北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 5 层
邮政编码	100033	100125
法定代表人	王军辉	张佑君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2021年1月1日-2021年6月30日)
本期已实现收益	-902,907.68
本期利润	14,766,677.90
加权平均基金份额本期利润	0.0685
本期加权平均净值利润率	6.25%
本期基金份额净值增长率	10.80%
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	24,203,281.15
期末可供分配基金份额利润	0.1392
期末基金资产净值	224,472,360.33
期末基金份额净值	1.2908
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	29.08%

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

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

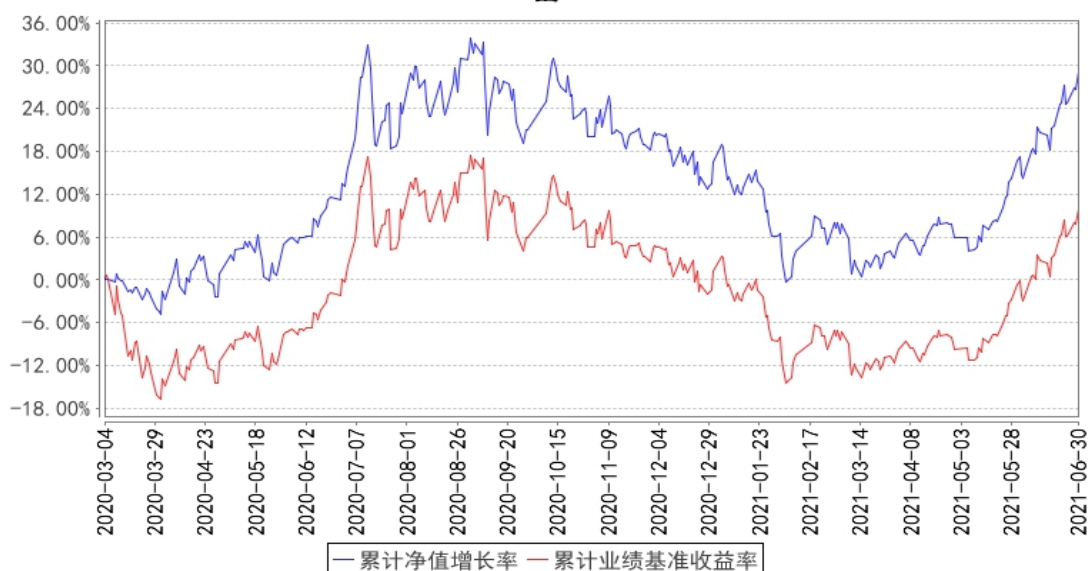
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	10.69%	1.52%	10.54%	1.57%	0.15%	-0.05%
过去三个月	25.24%	1.20%	24.20%	1.23%	1.04%	-0.03%
过去六个月	10.80%	1.36%	8.49%	1.40%	2.31%	-0.04%
过去一年	13.67%	1.68%	9.80%	1.71%	3.87%	-0.03%
自基金合同生效起至今	29.08%	1.62%	9.79%	1.78%	19.29%	-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

国寿安保创精选88ETF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 03 月 04 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 03 月 04 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		
李康	基金经理	2020 年 3 月 4 日	-	12 年	李康先生，博士研究生。2009 年 10 月至 2012 年 12 月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
苏天醒	本基金的基金经理	2021 年 3 月 1 日	-	11 年	苏天醒，北京邮电大学电子工程专业硕士，2010 年 3 月至 2012 年 11 月任中国国际金融有限公司研究员；2013 年 2 月至 2014 年 6 月任新华资产管理股份有限公司交易

					员；2014年6月至2015年5月任宁波灵均投资管理合伙企业（有限合伙）投资交易总监；2015年5月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

本基金跟踪误差主要源自成分股调整、股票停牌等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎、市场波动和预留现金头寸等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐

日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.2908 元；本报告期基金份额净值增长率为 10.80%，业绩比较基准收益率为 8.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 A 股市场主要指数呈震荡行情，均有一定涨幅，上证指数上涨 3.40%，沪深 300 上涨 0.24%，中证 500 上涨 6.93%。市场结构分化明显，行业和主题投资轮动加速，科技创新类上市公司受到市场关注，科创 50 和创业板指分别上涨 14.01% 和 17.22%。展望下半年，整体宏观环境对权益类资产相对友好。短期疫情即使有所反复，但在前期防控经验和疫苗接种的背景下整体可控。受益于政策支持、经济增长对疫情适应能力增强等因素，主要经济体有望保持复苏势头，带动全球经济重建进程。国内通胀呈现 CPI 整体可控，PPI 顶部回落的趋势，货币政策大概率保持稳健偏宽松的流动性环境。这样的宏观经济的大背景下，有利于企业盈利逐步向好，居民收入增长也将带来消费逐步改善。二季度中期以来，景气向好的半导体、新能源已经持续的走出结构性行情，后续随着上市公司业绩逐步改善，金融、消费、建筑建材等板块也会表现出一定的景气度，带动整个 A 股的投资机会不断涌现。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，国寿安保基金管理有限公司在国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金投资运作、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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，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国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数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：国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金

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	5,969,527.15	6,848,497.65
结算备付金		-	12,234.66
存出保证金		12,026.95	15,959.80
交易性金融资产	6.4.7.2	220,401,442.76	346,993,503.52
其中：股票投资		220,300,742.76	346,523,303.52
基金投资		-	-
债券投资		100,700.00	470,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	875,566.19
应收利息	6.4.7.5	2,421.41	3,477.47
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		226,385,418.27	354,749,239.29
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		1,656,002.22	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		53,356.77	91,149.15
应付托管费		17,785.57	30,383.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	66,607.45	385,101.42
应交税费		3.37	10.76
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	119,302.56	210,000.00
负债合计		1,913,057.94	716,644.40
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	173,899,676.00	303,899,676.00

未分配利润	6.4.7.10	50,572,684.33	50,132,918.89
所有者权益合计		224,472,360.33	354,032,594.89
负债和所有者权益总计		226,385,418.27	354,749,239.29

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.2908 元，基金份额总额 173,899,676.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		15,562,519.10	30,082,183.29
1. 利息收入		50,487.56	391,726.50
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,914.23	361,623.75
债券利息收入		573.33	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	30,102.75
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-137,620.38	10,413,600.49
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-1,157,652.17	9,507,757.30
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	231,910.71	-
资产支持证券投资	6.4.7.13.5	-	-
收益			
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	788,121.08	905,843.19
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,669,585.58	19,256,760.05
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	-19,933.66	20,096.25
减：二、费用		795,841.20	746,346.59
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	351,279.86	231,654.23
2. 托管费	6.4.10.2.2	117,093.20	77,218.12

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	173,163.51	316,684.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2.07	-
7. 其他费用	6.4.7.20	154,302.56	120,789.37
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,766,677.90	29,335,836.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,766,677.90	29,335,836.70

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金

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)	303,899,676.00	50,132,918.89	354,032,594.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,766,677.90	14,766,677.90
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)	-130,000,000.00	-14,326,912.46	-144,326,912.46
其中：1. 基金申购款	24,000,000.00	2,411,952.79	26,411,952.79
2. 基金赎回款	-154,000,000.00	-16,738,865.25	-170,738,865.25
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)	173,899,676.00	50,572,684.33	224,472,360.33
项目	上年度可比期间 2020 年 3 月 4 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	349,899,676.00	-	349,899,676.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	29,335,836.70	29,335,836.70
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)	-65,000,000.00	9,291,812.34	-55,708,187.66
其中：1. 基金申购款	281,000,000.00	18,624,109.47	299,624,109.47

2. 基金赎回款	-346,000,000.00	-9,332,297.13	-355,332,297.13
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)	284,899,676.00	38,627,649.04	323,527,325.04

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

国寿安三国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]2907 号文《关于准予国寿安三国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司于 2020 年 2 月 19 日至 2020 年 2 月 26 日向社会公开发行人募集，募集期结束经普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具普华永道中天验字（2020）第 0113 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 3 月 4 日正式生效，首次设立募集规模为 349,871,000.00 份基金份额。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股。为更好的实现投资目标，本基金还可投资于其他股票（包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票）、国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货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的相关规定）。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。基金管理人可以在不改变本基金既有投资策略和风险收益特征并在控制风险

的前提下，参与转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。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。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本报告期内所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

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

本基金本报告期无需要说明的会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

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

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

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

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

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

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

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳

增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年6月30日	
活期存款	5,969,527.15	
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	5,969,527.15	

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	200,800,156.72	220,300,742.76	19,500,586.04
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	100,700.00	100,700.00
	银行间市场	-	-
	合计	100,700.00	100,700.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	200,900,856.72	220,401,442.76	19,500,586.04

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金于本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	2,396.59
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	-
应收债券利息	19.42
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	5.40
合计	2,421.41

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	66,607.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	66,607.45

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	84,302.56
应付指数使用费	35,000.00
合计	119,302.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	303,899,676.00	303,899,676.00
本期申购	24,000,000.00	24,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-154,000,000.00	-154,000,000.00
- 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	173,899,676.00	173,899,676.00

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

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	42,071,231.30	8,061,687.59	50,132,918.89
本期利润	-902,907.68	15,669,585.58	14,766,677.90
本期基金份额交易产生的变动数	-16,965,042.47	2,638,130.01	-14,326,912.46
其中：基金申购款	3,100,637.96	-688,685.17	2,411,952.79
基金赎回款	-20,065,680.43	3,326,815.18	-16,738,865.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,203,281.15	26,369,403.18	50,572,684.33

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	48,322.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	1,480.52
其他	111.55
合计	49,914.23

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	6,390,516.11
股票投资收益——赎回差价收入	-7,548,168.28
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	-1,157,652.17

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	81,200,932.86
减：卖出股票成本总额	74,810,416.75
买卖股票差价收入	6,390,516.11

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
赎回基金份额对价总额	170,738,865.25
减：现金支付赎回款总额	-1,204,912.75
减：赎回股票成本总额	179,491,946.28
赎回差价收入	-7,548,168.28

6.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	231,910.71
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	231,910.71
----	------------

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	1,562,068.31
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,329,500.00
减：应收利息总额	657.60
买卖债券差价收入	231,910.71

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券产生的收益/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

本基金于本报告期间无贵金属投资产生的收益/损失。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	788,121.08
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	788,121.08

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	15,669,585.58
股票投资	15,669,585.58
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	15,669,585.58

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	-
替代损益	-19,933.66
合计	-19,933.66

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	173,163.51
银行间市场交易费用	-
合计	173,163.51

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	70,000.00
合计	154,302.56

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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期未发生存在控制关系或其他重大利害关系的关联方变化情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司(简称“国寿安保基金”)	基金管理人
中信证券股份有限公司(简称“中信证券”)	基金托管人、申赎代办券商
中国人寿资产管理有限公司(简称“国寿资产”)	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司(简称“安保资本”)	基金管理人的股东
中国人寿保险(集团)公司(简称“集团公司”)	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司(简称“中国人寿”)	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司(简称“国寿财富”)	基金管理人的子公司
国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“国寿安保创精选 88ETF 联接基金”)	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月4日(基金合同生效日)至2020 年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例(%)
中信证券	156,394,020.57	91.42	394,979,163.79	83.82

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月4日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	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 成交总额的比例（%）
中信证券	1,562,068.31	100.00	-	-

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年3月4日（基金合同生效日）至2020年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
中信证券	-	-	100,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例（%）
中信证券	67,453.75	87.92	67,453.75	87.92
关联方名称	上年度可比期间 2020年3月4日（基金合同生效日）至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量的 比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例（%）
中信证券	170,357.10	77.96	170,357.10	77.96

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日	上年度可比期间 2020年3月4日（基金合同生效日）至2020年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	351,279.86	231,654.23
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2020 年 3 月 4 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	117,093.20	77,218.12

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.3 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

无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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 (%)
国寿安保创精选 88ETF联接基金	142,000,000.00	81.66	228,000,000.00	75.02

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30 日		上年度可比期间 2020年3月4日（基金合同生效日）至2020 年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信证券	5,969,527.15	48,322.16	4,877,280.56	354,071.61

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

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	2021年	2021年	新股流	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-

	畅银	5月18日	11月25日	通受限							
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80		-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70		-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92		-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	443	10,937.67	14,047.53		-
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		-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36		-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55		-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12		-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08		锁定期内发生送股
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	155	7,336.15	39,053.80		-
300958	建工修复	2021年3月18日	2021年9月29日	新股流通受限	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00		-
300960	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04		-

300961	深水海纳	2021年 3月23 日	2021年 9月30 日	新股流 通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年 3月29 日	2021年 10月 11日	新股流 通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年 3月30 日	2021年 10月 11日	新股流 通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
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	764	5,248.68	9,221.48	-
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	150	4,242.00	17,356.50	-
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	-
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	255	8,471.10	22,312.50	-
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	224	5,577.60	5,557.44	-
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	新股流 通受限	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-

		日	26日								
300996	普联软件	2021年 5月26 日	2021年 12月3 日	新股流 通受限	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43		-
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		-
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		-
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		-

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
123116	万兴转债	2021年6月9日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	1,007	100,700.00	100,700.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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证券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所市场证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

本报告期本基金未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

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。

6.4.13.1 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；本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

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，除在附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制外（如有），其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价

值。除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息外，本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般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、结算备付金及结算保证金等。本基金于本报告期末持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,969,527.15	-	-	-	5,969,527.15
存出保证金	12,026.95	-	-	-	12,026.95
交易性金融资产	-	-	100,700.00	220,300,742.76	220,401,442.76
应收利息	-	-	-	2,421.41	2,421.41
资产总计	5,981,554.10	-	100,700.00	220,303,164.17	226,385,418.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	53,356.77	53,356.77
应付托管费	-	-	-	17,785.57	17,785.57
应付证券清算款	-	-	-	1,656,002.22	1,656,002.22
应付交易费用	-	-	-	66,607.45	66,607.45
应交税费	-	-	-	3.37	3.37
其他负债	-	-	-	119,302.56	119,302.56
负债总计	-	-	-	1,913,057.94	1,913,057.94
利率敏感度缺口	5,981,554.10	-	100,700.00	218,390,106.23	224,472,360.33
上年度末 2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	6,848,497.65	-	-	-	6,848,497.65
结算备付金	12,234.66	-	-	-	12,234.66

存出保证金	15,959.80	-	-	-	15,959.80
交易性金融资产	-	-	470,200.00	346,523,303.52	346,993,503.52
应收利息	-	-	-	3,477.47	3,477.47
应收证券清算款	-	-	-	875,566.19	875,566.19
资产总计	6,876,692.11	-	470,200.00	347,402,347.18	354,749,239.29
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	91,149.15	91,149.15
应付托管费	-	-	-	30,383.07	30,383.07
应付交易费用	-	-	-	385,101.42	385,101.42
应交税费	-	-	-	10.76	10.76
其他负债	-	-	-	210,000.00	210,000.00
负债总计	-	-	-	716,644.40	716,644.40
利率敏感度缺口	6,876,692.11	-	470,200.00	346,685,702.78	354,032,594.89

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，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本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%。

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	220,300,742.76	98.14	346,523,303.52	97.88

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	100,700.00	0.04	470,200.00	0.13
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	220,401,442.76	98.19	346,993,503.52	98.01

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 系数是报告期内所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
分析	+5%	10,886,909.48	17,170,580.85
	-5%	-10,886,909.48	-17,170,580.85

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。下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 219,811,605.39 元（上年度末：346,012,088.71 元），属于第二层次的余额为人民币 589,837.37 元（上年度末：981,414.81 元），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	220,300,742.76	97.31
	其中：股票	220,300,742.76	97.31
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	100,700.00	0.04
	其中：债券	100,700.00	0.04
	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	5,969,527.15	2.64
8	其他各项资产	14,448.36	0.01
9	合计	226,385,418.27	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,560,320.15	1.59
B	采矿业	-	-
C	制造业	138,972,522.08	61.91
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	1,746,767.12	0.78
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	60,722,032.73	27.05
J	金融业	3,219,240.00	1.43
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,521,792.00	1.12
M	科学研究和技术服务业	1,944,432.00	0.87
N	水利、环境和公共设施管理业	1,049,100.68	0.47
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,518,816.00	1.57
R	文化、体育和娱乐业	3,045,720.00	1.36
S	综合	-	-
	合计	220,300,742.76	98.14

7.2.1 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300568	星源材质	212,925	8,808,707.25	3.92
2	300458	全志科技	82,100	7,196,886.00	3.21
3	300327	中颖电子	80,200	6,835,446.00	3.05
4	300390	天华超净	128,100	6,152,643.00	2.74
5	300379	东方通	158,120	4,504,838.80	2.01
6	300346	南大光电	108,500	4,196,780.00	1.87
7	300604	长川科技	58,100	3,963,001.00	1.77
8	300315	掌趣科技	928,900	3,947,825.00	1.76
9	300767	震安科技	45,500	3,778,775.00	1.68
10	300171	东富龙	89,300	3,630,045.00	1.62
11	300348	长亮科技	192,500	3,522,750.00	1.57
12	300143	盈康生命	136,600	3,518,816.00	1.57
13	300451	创业慧康	395,520	3,496,396.80	1.56
14	300567	精测电子	56,100	3,444,540.00	1.53
15	300166	东方国信	277,300	3,427,428.00	1.53
16	300185	通裕重工	1,075,500	3,291,030.00	1.47
17	300369	绿盟科技	206,200	3,288,890.00	1.47
18	300803	指南针	83,400	3,219,240.00	1.43
19	300132	青松股份	151,700	3,200,870.00	1.43
20	300638	广和通	68,467	3,197,408.90	1.42
21	300236	上海新阳	65,700	3,189,078.00	1.42
22	300487	蓝晓科技	37,400	3,164,040.00	1.41
23	300613	富瀚微	19,683	3,068,186.04	1.37

24	300036	超图软件	138,700	3,031,982.00	1.35
25	300352	北信源	418,500	2,912,760.00	1.30
26	300598	诚迈科技	34,450	2,878,986.50	1.28
27	300002	神州泰岳	591,200	2,867,320.00	1.28
28	300226	上海钢联	47,813	2,847,264.15	1.27
29	300123	亚光科技	253,100	2,824,596.00	1.26
30	300034	钢研高纳	87,600	2,821,596.00	1.26
31	300068	南都电源	257,700	2,731,620.00	1.22
32	300026	红日药业	642,600	2,731,050.00	1.22
33	300573	兴齐眼药	19,300	2,721,879.00	1.21
34	300233	金城医药	92,758	2,643,603.00	1.18
35	300674	宇信科技	139,800	2,612,862.00	1.16
36	300151	昌红科技	96,600	2,602,404.00	1.16
37	300457	赢合科技	129,400	2,569,884.00	1.14
38	300616	尚品宅配	28,500	2,522,535.00	1.12
39	300662	科锐国际	41,600	2,521,792.00	1.12
40	300776	帝尔激光	16,540	2,470,414.40	1.10
41	300133	华策影视	386,500	2,288,080.00	1.02
42	300438	鹏辉能源	96,350	2,206,415.00	0.98
43	300679	电连技术	76,253	2,197,611.46	0.98
44	300085	银之杰	124,500	2,197,425.00	0.98
45	300633	开立医疗	68,300	2,156,914.00	0.96
46	300113	顺网科技	159,300	2,061,342.00	0.92
47	300232	洲明科技	230,714	2,060,276.02	0.92
48	300087	荃银高科	91,400	2,048,274.00	0.91
49	300180	华峰超纤	407,400	2,016,630.00	0.90
50	300770	新媒股份	41,300	2,011,310.00	0.90
51	300398	飞凯材料	110,000	1,994,300.00	0.89
52	300149	睿智医药	100,800	1,944,432.00	0.87
53	300607	拓斯达	55,500	1,931,400.00	0.86
54	300829	金丹科技	29,200	1,912,600.00	0.85
55	300078	思创医惠	256,300	1,896,620.00	0.84
56	300170	汉得信息	253,200	1,891,404.00	0.84
57	300303	聚飞光电	367,800	1,872,102.00	0.83
58	300406	九强生物	94,200	1,858,566.00	0.83
59	300031	宝通科技	114,400	1,802,944.00	0.80
60	300177	中海达	180,500	1,779,730.00	0.79
61	300596	利安隆	39,800	1,724,534.00	0.77
62	300257	开山股份	117,403	1,687,081.11	0.75
63	300755	华致酒行	40,900	1,669,129.00	0.74
64	300224	正海磁材	152,900	1,662,023.00	0.74
65	300735	光弘科技	136,200	1,656,192.00	0.74

66	300659	中孚信息	47,320	1,588,532.40	0.71
67	300206	理邦仪器	98,500	1,566,150.00	0.70
68	300572	安车检测	47,800	1,550,632.00	0.69
69	300762	上海瀚讯	53,711	1,517,335.75	0.68
70	300761	立华股份	45,299	1,500,755.87	0.67
71	300850	新强联	17,100	1,499,499.00	0.67
72	300821	东岳硅材	113,600	1,476,800.00	0.66
73	300114	中航电测	96,800	1,471,360.00	0.66
74	300394	天孚通信	56,760	1,437,163.20	0.64
75	300429	强力新材	105,342	1,427,384.10	0.64
76	300766	每日互动	90,400	1,355,096.00	0.60
77	300183	东软载波	79,800	1,310,316.00	0.58
78	300602	飞荣达	71,941	1,280,549.80	0.57
79	300527	中船应急	131,691	1,210,240.29	0.54
80	300386	飞天诚信	68,100	1,173,363.00	0.52
81	300080	易成新能	201,300	1,054,812.00	0.47
82	300552	万集科技	31,200	1,038,336.00	0.46
83	300815	玉禾田	29,000	1,010,070.00	0.45
84	300523	辰安科技	41,030	995,387.80	0.44
85	300791	仙乐健康	17,000	941,800.00	0.42
86	300634	彩讯股份	41,000	870,840.00	0.39
87	300723	一品红	25,017	844,323.75	0.38
88	300860	锋尚文化	13,000	757,640.00	0.34
89	300919	中伟股份	305	49,715.00	0.02
90	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.02
91	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.02
92	300957	贝泰妮	155	39,053.80	0.02
93	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.01
94	300979	华利集团	255	22,312.50	0.01
95	300973	立高食品	150	17,356.50	0.01
96	300932	三友联众	443	14,047.53	0.01
97	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
98	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
99	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
100	301013	利和兴	471	12,768.81	0.01
101	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.01
102	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.01
103	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.01
104	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
105	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
106	300968	格林精密	764	9,221.48	0.00
107	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00

108	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
109	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
110	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
111	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
112	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
113	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
114	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
115	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
116	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
117	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
118	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
119	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
120	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
121	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
122	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
123	300985	致远新能	224	5,557.44	0.00
124	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
125	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
126	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
127	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
128	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
129	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
130	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300390	天华超净	6,241,237.00	1.76
2	300327	中颖电子	5,134,464.00	1.45
3	300315	掌趣科技	4,405,974.00	1.24
4	300346	南大光电	4,006,160.00	1.13
5	300451	创业慧康	3,847,060.71	1.09
6	300369	绿盟科技	3,674,856.00	1.04
7	300767	震安科技	3,501,508.60	0.99
8	300598	诚迈科技	3,383,119.50	0.96
9	300604	长川科技	3,090,379.00	0.87
10	300567	精测电子	3,076,303.00	0.87
11	300123	亚光科技	2,957,816.00	0.84
12	300236	上海新阳	2,876,515.00	0.81
13	300151	昌红科技	2,859,415.64	0.81

14	300457	赢合科技	2,821,110.00	0.80
15	300803	指南针	2,814,889.33	0.80
16	300026	红日药业	2,775,076.00	0.78
17	300674	宇信科技	2,641,018.60	0.75
18	300087	荃银高科	2,331,530.00	0.66
19	300770	新媒股份	2,242,647.20	0.63
20	300224	正海磁材	1,629,304.50	0.46

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	300737	科顺股份	4,931,598.00	1.39
2	300079	数码视讯	4,865,353.00	1.37
3	300054	鼎龙股份	4,809,105.00	1.36
4	300395	菲利华	4,314,140.30	1.22
5	300118	东方日升	3,994,505.00	1.13
6	300763	锦浪科技	3,898,595.00	1.10
7	300775	三角防务	3,759,024.00	1.06
8	300623	捷捷微电	3,521,389.50	0.99
9	300726	宏达电子	3,239,935.00	0.92
10	300624	万兴科技	2,495,268.00	0.70
11	300377	赢时胜	2,369,998.00	0.67
12	300184	力源信息	2,070,867.00	0.58
13	300053	欧比特	1,853,188.60	0.52
14	300465	高伟达	1,808,523.00	0.51
15	300145	中金环境	1,735,334.11	0.49
16	300045	华力创通	1,620,501.00	0.46
17	300284	苏交科	1,614,905.29	0.46
18	300229	拓尔思	1,534,418.50	0.43
19	300349	金卡智能	1,455,811.58	0.41
20	300441	鲍斯股份	1,411,604.00	0.40

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	91,422,905.25
卖出股票收入（成交）总额	81,200,932.86

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）

填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	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）	100,700.00	0.04
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	100,700.00	0.04

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	123116	万兴转债	1,007	100,700.00	0.04

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

报告期内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	12,026.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,421.41
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,448.36

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
1,249	139,231.13	148,807,466.00	85.57	25,092,210.00	14.43

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	方正证券股份有限公司	5,716,862.00	3.29
2	梁子杰	1,849,800.00	1.06
3	中信证券股份有限公司	939,104.00	0.54
4	李国万	880,000.00	0.51
5	张爱民	850,800.00	0.49
6	张文勇	560,600.00	0.32
7	屠国明	500,008.00	0.29
8	徐太法	500,006.00	0.29
9	金锋	439,100.00	0.25
10	孟爱军	400,000.00	0.23
11	中信证券股份有限公司—国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	142,000,000.00	81.66

注：表中前十名持有人为除国寿安保创精选 88ETF 联接基金之外的前十名持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年3月4日）基金份额总额	349,899,676.00
本报告期期初基金份额总额	303,899,676.00
本报告期基金总申购份额	24,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	154,000,000.00
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	173,899,676.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中信证券	2	156,394,020.57	91.42%	67,453.75	87.92%	-
方正证券	1	14,684,467.15	8.58%	9,270.92	12.08%	-

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。

10.7.2 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	1,562,068.31	100.00%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

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	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 22 日

2	国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保创精选 88ETF 变更基金经理的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 27 日
3	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金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 2 月 27 日
4	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 2 月 27 日
5	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
6	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
7	关于国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
8	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金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 4 月 2 日
9	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
10	国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 2 号）	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-

其他	1	20210101~20210630	228,000,000.00	3,000,000.00	89,000,000.00	142,000,000.00	81.66
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>							

注:上述申购份额含交易所二级市场买入,赎回份额含交易所二级市场卖出。

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国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

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

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: www.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