

国寿安保沪深 300 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：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2021 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
§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.....	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	10
§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.....	12
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	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	51
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.....	51
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.....	51

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.....	51
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.....	51
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	52
§8 基金份额持有人信息.....	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	53
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
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.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	54
§10 重大事件揭示.....	54
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	55
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	55
10.8 其他重大事件.....	56
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
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.....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	58
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保沪深 300ETF
场内简称	国寿 300
基金主代码	510380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,148,802,400.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2018 年 2 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，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	沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	秦一楠
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850776	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	王军辉	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	723,476,939.39
本期利润	101,896,982.34
加权平均基金份额本期利润	0.0372
本期加权平均净值利润率	2.69%
本期基金份额净值增长率	1.64%
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	761,154,520.44
期末可供分配基金份额利润	0.3542
期末基金资产净值	2,977,847,176.72
期末基金份额净值	1.3858
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	38.58%

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

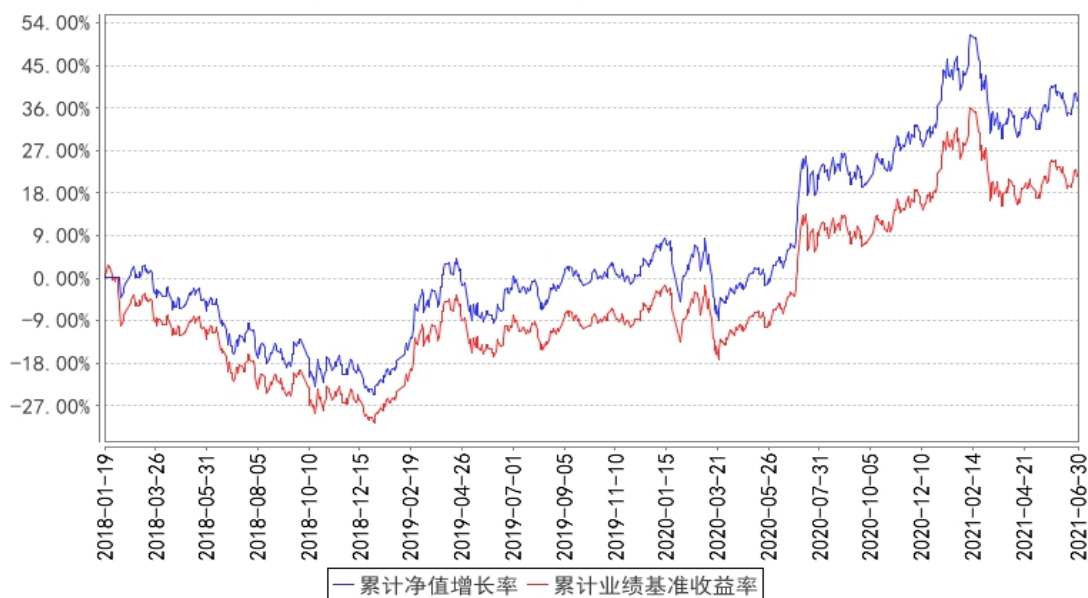
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长	份额净值增长率标	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①—③	②—④
----	--------	----------	------------	--------------	-----	-----

	率①	准差②		④		
过去一个月	-1.42%	0.80%	-2.02%	0.80%	0.60%	0.00%
过去三个月	4.42%	0.97%	3.48%	0.98%	0.94%	-0.01%
过去六个月	1.64%	1.29%	0.24%	1.31%	1.40%	-0.02%
过去一年	28.41%	1.31%	25.46%	1.33%	2.95%	-0.02%
过去三年	57.37%	1.35%	48.79%	1.37%	8.58%	-0.02%
自基金合同生效起至今	38.58%	1.32%	22.30%	1.35%	16.28%	-0.03%

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

国寿安保沪深300ETF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 2018 年 01 月 19 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 2018 年 01 月 19 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	2018 年 1 月 19 日	-	12 年	李康先生，博士研究生。2009 年 10 月至 2012 年 12 月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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

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、停复牌等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎和市场波动等因素，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 1.3858 元；本报告期基金份额净值增长率为 1.64%，业绩比较基准收益率为 0.24%。

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

本报告期内，本基金自 2020 年 11 月 3 日至 2021 年 1 月 22 日存在连续二十个工作日持有人数量低于二百人的情况。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 06 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事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本基金的投资运作、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本基金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，未发现有关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：国寿安保沪深 300 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	29,545,921.17	66,645,272.17
结算备付金		2,946,217.23	70,014.38
存出保证金		524,658.95	238,105.58
交易性金融资产	6.4.7.2	2,956,282,694.68	4,944,719,638.02
其中：股票投资		2,954,239,294.68	4,943,722,790.32
基金投资		-	-

债券投资		2,043,400.00	996,847.70
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		-	605,927.27
应收利息	6.4.7.5	42,605.88	15,448.30
应收股利		44,110.48	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,989,386,208.39	5,012,294,405.72
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		6,622,302.18	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,211,710.34	2,125,007.48
应付托管费		242,342.06	425,001.52
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	3,093,076.76	1,403,488.05
应交税费		3,909.46	3,075.99
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	365,690.87	621,749.15
负债合计		11,539,031.67	4,578,322.19
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	2,148,802,400.00	3,672,802,400.00
未分配利润	6.4.7.10	829,044,776.72	1,334,913,683.53
所有者权益合计		2,977,847,176.72	5,007,716,083.53
负债和所有者权益总计		2,989,386,208.39	5,012,294,405.72

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.3858 元，基金份额总额 2,148,802,400.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保沪深 300 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 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
一、收入		117,241,291.41	127,758,325.65
1. 利息收入		851,465.39	168,477.17
其中：存款利息收入	6.4.7.11	197,183.63	160,686.43
债券利息收入		1,939.74	533.99
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		652,342.02	7,256.75
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		734,923,613.78	10,268,263.94
其中：股票投资收益	6.4.7.12	710,172,504.37	-41,659,831.37
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,260,791.69	933,660.91
资产支持证券投资	6.4.7.13.3	-	-
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	23,490,317.72	50,994,434.40
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-621,579,957.05	117,258,254.60
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	3,046,169.29	63,329.94
减：二、费用		15,344,309.07	15,499,600.14
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,421,862.81	11,992,938.51
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,884,372.56	2,398,587.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	3,346,470.41	267,673.43
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,350.52	28.02
7. 其他费用	6.4.7.20	689,252.77	840,372.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		101,896,982.34	112,258,725.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		101,896,982.34	112,258,725.51

号填列)			
------	--	--	--

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保沪深 300 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）	3,672,802,400.00	1,334,913,683.53	5,007,716,083.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	101,896,982.34	101,896,982.34
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）	-1,524,000,000.00	-607,765,889.15	-2,131,765,889.15
其中：1. 基金申购款	90,000,000.00	30,461,847.20	120,461,847.20
2. 基金赎回款	-1,614,000,000.00	-638,227,736.35	-2,252,227,736.35
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）	2,148,802,400.00	829,044,776.72	2,977,847,176.72
项目	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,728,802,400.00	264,877,506.51	4,993,679,906.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	112,258,725.51	112,258,725.51
三、本期基金份额	27,000,000.00	-576,708.11	26,423,291.89

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	33,000,000.00	-396,370.37	32,603,629.63
2. 基金赎回款	-6,000,000.00	-180,337.74	-6,180,337.74
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）	4,755,802,400.00	376,559,523.91	5,132,361,923.91

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

国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(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[2015]2166 号《关于准予国寿安保沪深 300 交易型开放式指数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《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 294,788,000.00 元(含募集股票市值),业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2018)验字第 61090605_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 294,802,400.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,400.00 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,基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“中国农业银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2018]19 号文审核同意,本基金 294,802,400.00 份基金份额于 2018 年 2 月 7 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及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)。在建仓完成后,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%,权证及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。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿安保沪深 300ETF 联接基金”)。国寿安保沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资

管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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	29,545,921.17
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	29,545,921.17

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	2,281,011,823.93	2,954,239,294.68	673,227,470.75
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	2,043,400.00	2,043,400.00
	银行间市场	-	-
	合计	2,043,400.00	2,043,400.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	2,283,055,223.93	2,956,282,694.68	673,227,470.75

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	6,000.43
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,325.80
应收债券利息	146.77
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	34,896.78

其他	236.10
合计	42,605.88

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	3,093,076.76
银行间市场应付交易费用	-
合计	3,093,076.76

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	114,055.34
应付指数使用费	251,635.53
合计	365,690.87

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	3,672,802,400.00	3,672,802,400.00
本期申购	90,000,000.00	90,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,614,000,000.00	-1,614,000,000.00
- 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	2,148,802,400.00	2,148,802,400.00

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	359,556,613.41	975,357,070.12	1,334,913,683.53
本期利润	723,476,939.39	-621,579,957.05	101,896,982.34
本期基金份额交易产生的变动数	-321,879,032.36	-285,886,856.79	-607,765,889.15
其中：基金申购款	23,013,134.89	7,448,712.31	30,461,847.20
基金赎回款	-344,892,167.25	-293,335,569.10	-638,227,736.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	761,154,520.44	67,890,256.28	829,044,776.72

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		175,220.94
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		18,915.18
其他		3,047.51
合计		197,183.63

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		426,123,067.19
股票投资收益——赎回差价收入		284,049,437.18
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		710,172,504.37

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		1,446,288,089.61
减：卖出股票成本总额		1,020,165,022.42
买卖股票差价收入		426,123,067.19

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	2,156,425,481.45
减：现金支付赎回款总额	775,106,354.45
减：赎回股票成本总额	1,097,269,689.82
赎回差价收入	284,049,437.18

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	1,260,791.69
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	1,260,791.69

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	11,029,076.88
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	9,766,400.00
减：应收利息总额	1,885.19
买卖债券差价收入	1,260,791.69

6.4.7.13.3 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

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	23,490,317.72
其中：证券出借权益补偿收入	436,580.74
基金投资产生的股利收益	-
合计	23,490,317.72

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	-621,579,957.05
股票投资	-621,443,109.35
债券投资	-136,847.70
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-
权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-621,579,957.05

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	3,046,169.29
合计	3,046,169.29

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购日估值的差额。

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	3,346,470.41
银行间市场交易费用	-
合计	3,346,470.41

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	54,547.97
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	9,885.71
指数使用费	565,311.72
合计	689,252.77

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	基金管理人
农业银行	基金托管人
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（“国寿安保沪深 300ETF 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	9,421,862.81	11,992,938.51
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0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H=E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

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1月1日至2020年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,884,372.56	2,398,587.62

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

本基金本报告期末与关联方进行转融通证券出借业务。

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（%）
国寿安保沪深 300ETF 联接基 金	2,079,249,800.00	96.76	3,638,649,800.00	99.07

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	29,545,921.17	175,220.94	84,681,032.51	157,524.84

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期内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)	期末 成本总额	期末估值 总额	备注

							位： 股)			
300614	百川畅银	2021年5月18日	2021年11月25日	新股流通受限	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年7月2日	新股流通受限	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月12日	新股流通受限	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股流通受限	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300931	通用电梯	2021年1月13日	2021年7月21日	新股流通受限	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300932	三友联众	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300933	中辰股份	2021年1月15日	2021年7月22日	新股流通受限	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
300937	药易购	2021年1月20日	2021年7月27日	新股流通受限	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300940	南极光	2021年1月27日	2021年8月3日	新股流通受限	12.76	43.38	307	3,917.32	13,317.66	-
300941	创识科技	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
300942	易瑞生物	2021年2月2日	2021年8月9日	新股流通受限	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300943	春晖智控	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300945	曼卡龙	2021年2月3日	2021年8月10日	新股流通受限	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021年2月18日	2021年8月25日	新股流通受限	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	锁定期内发生送股
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
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	-
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	通业科技	2021年3月22日	2021年9月29日	新股流通受限	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300961	深水海纳	2021年3月23日	2021年9月30日	新股流通受限	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300962	中金辐照	2021年3月29日	2021年10月11日	新股流通受限	3.40	16.37	576	1,958.40	9,429.12	-
300963	中洲特材	2021年3月30日	2021年10月11日	新股流通受限	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
300966	共同药业	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	241	5,015.21	10,177.43	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
301004	嘉益股份	2021年6月18日	2021年12月27日	新股流通受限	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-
301006	迈拓股份	2021年5月31日	2021年12月7日	新股流通受限	14.42	24.89	5,051	72,835.42	125,719.39	-
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	-
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	利元亨	2021年6月23日	2021年7月1日	新股未上市	38.85	38.85	2,149	83,488.65	83,488.65	-
688565	力源科技	2021年5月6日	2021年11月15日	新股流通受限	9.39	14.00	2,464	23,136.96	34,496.00	-
688575	亚辉龙	2021年5月10日	2021年11月17日	新股流通受限	14.80	32.09	3,435	50,838.00	110,229.15	-
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	-
688613	奥精医疗	2021年5月13日	2021年11月22日	新股流通受限	16.43	63.50	2,617	42,997.31	166,179.50	-
688633	星球石墨	2021年3月17日	2021年9月24日	新股流通受限	33.62	53.14	1,558	52,379.96	82,792.12	-
688656	浩欧博	2021年1月6日	2021年7月13日	新股流通受限	35.26	72.60	1,371	48,341.46	99,534.60	-
688661	和林微纳	2021年3月19日	2021年9月29日	新股流通受限	17.71	84.01	1,452	25,714.92	121,982.52	-
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
113049	长汽转债	2021年6月10日	2021年7月8日	新债未上市	100.00	100.00	830	83,000.00	83,000.00	-
113050	南银转债	2021年6月15日	2021年7月1日	新债未上市	100.00	100.00	17,610	1,761,000.00	1,761,000.00	-
123117	健帆转债	2021年6月23日	2021年7月12日	新债未上市	100.00	100.00	695	69,500.00	69,500.00	-
127038	国微转债	2021年6月10日	2021年7月14日	新债未上市	100.00	100.00	1,299	129,900.00	129,900.00	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002024	苏宁易购	2021年6月16日	重大事项停牌	5.59	2021年7月6日	6.15	546,500	7,170,885.61	3,054,935.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量 (单位: 股)	期末估值总额
1	000001	平安银行	2021年7月8日	22.62	224,000	5,066,880.00
2	000002	万科A	2021年7月1日	23.81	38,800	923,828.00
3	000066	中国长城	2021年7月1日-2021年7月8日	14.60	30,000	438,000.00
4	000100	TCL科技	2021年7月1日	7.65	14,700	112,455.00
5	000166	申万宏源	2021年7月1日	4.68	15,000	70,200.00
6	000333	美的集团	2021年7月1日	71.37	10,000	713,700.00

7	000338	潍柴动力	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 1 日	17.87	25,100	448,537.00
8	000425	徐工机械	2021 年 7 月 2 日-2021 年 7 月 5 日	6.37	130,000	828,100.00
9	000568	泸州老窖	2021 年 7 月 1 日	235.94	10,000	2,359,400.00
10	000625	长安汽车	2021 年 7 月 5 日	26.28	62,000	1,629,360.00
11	000651	格力电器	2021 年 7 月 1 日	52.10	13,100	682,510.00
12	000703	恒逸石化	2021 年 7 月 1 日	11.95	19,600	234,220.00
13	000725	京东方 A	2021 年 7 月 1 日	6.24	19,900	124,176.00
14	000728	国元证券	2021 年 7 月 1 日	7.97	31,700	252,649.00
15	000768	中航西飞	2021 年 7 月 1 日	26.28	10,000	262,800.00
16	000776	广发证券	2021 年 7 月 1 日	15.14	22,500	340,650.00
17	000860	顺鑫农业	2021 年 7 月 1 日	42.18	12,900	544,122.00
18	000876	新希望	2021 年 7 月 1 日	14.67	10,000	146,700.00
19	000895	双汇发展	2021 年 7 月 1 日	31.80	10,100	321,180.00
20	000963	华东医药	2021 年 7 月 13 日	46.01	16,000	736,160.00
21	002007	华兰生物	2021 年 7 月 1 日	36.68	10,000	366,800.00
22	002008	大族激光	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 14 日	40.39	20,000	807,800.00
23	002044	美年健康	2021 年 7 月 9 日	9.11	50,000	455,500.00
24	002049	紫光国微	2021 年 7 月 1 日	154.19	10,000	1,541,900.00
25	002120	韵达股份	2021 年 7 月 1 日	13.53	16,300	220,539.00
26	002129	中环股份	2021 年 7 月 1 日	38.60	16,300	629,180.00
27	002142	宁波银行	2021 年 7 月 1 日	38.97	10,000	389,700.00
28	002153	石基信息	2021 年 7 月 1 日	23.51	10,000	235,100.00
29	002157	正邦科技	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 14 日	11.95	42,800	511,460.00
30	002179	中航光电	2021 年 7 月 1 日	79.02	10,000	790,200.00
31	002236	大华股份	2021 年 7 月 1 日	21.10	19,300	407,230.00
32	002252	上海莱士	2021 年 7 月 1 日	7.49	10,000	74,900.00
33	002271	东方雨虹	2021 年 7 月 1 日	55.32	11,700	647,244.00
34	002304	洋河股份	2021 年 7 月 1 日	207.20	10,000	2,072,000.00
35	002352	顺丰控股	2021 年 7 月 1 日	67.70	10,000	677,000.00
36	002384	东山精密	2021 年 7 月 1 日	20.84	10,000	208,400.00
37	002414	高德红外	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 1 日	27.58	28,000	772,240.00
38	002415	海康威视	2021 年 7 月 1 日	64.50	18,100	1,167,450.00
39	002460	赣锋锂业	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 6 日	121.09	20,000	2,421,800.00
40	002463	沪电股份	2021 年 7 月 1 日	15.47	10,000	154,700.00
41	002475	立讯精密	2021 年 7 月 1 日	46.00	25,300	1,163,800.00
42	002493	荣盛石化	2021 年 7 月 1 日	17.27	10,000	172,700.00
43	002508	老板电器	2021 年 7 月 1 日	46.50	10,000	465,000.00
44	002555	三七互娱	2021 年 7 月 1 日	24.02	13,800	331,476.00

45	002558	巨人网络	2021年7月1日-2021年7月5日	13.30	31,000	412,300.00
46	002594	比亚迪	2021年7月14日	251.00	5,000	1,255,000.00
47	002601	龙佰集团	2021年7月2日	34.58	13,400	463,372.00
48	002602	世纪华通	2021年7月8日	6.42	60,700	389,694.00
49	002714	牧原股份	2021年7月1日-2021年7月8日	60.82	30,000	1,824,600.00
50	002773	康弘药业	2021年7月1日	23.13	10,000	231,300.00
51	002939	长城证券	2021年7月1日	11.13	10,000	111,300.00
52	600010	包钢股份	2021年7月14日-2021年7月14日	1.55	544,600	844,130.00
53	600019	宝钢股份	2021年7月1日	7.64	15,100	115,364.00
54	600036	招商银行	2021年7月1日	54.19	18,400	997,096.00
55	600048	保利地产	2021年7月1日	12.04	50,300	605,612.00
56	600061	国投资本	2021年7月1日	8.49	15,200	129,048.00
57	600085	同仁堂	2021年7月1日	40.85	10,000	408,500.00
58	600109	国金证券	2021年7月1日	12.69	24,100	305,829.00
59	600111	北方稀土	2021年7月13日	20.70	65,000	1,345,500.00
60	600118	中国卫星	2021年7月1日	29.26	12,500	365,750.00
61	600143	金发科技	2021年7月13日	20.86	40,700	849,002.00
62	600150	中国船舶	2021年7月1日	16.51	18,500	305,435.00
63	600161	天坛生物	2021年7月1日	34.25	10,900	373,325.00
64	600183	生益科技	2021年7月1日	23.41	10,000	234,100.00
65	600196	复星医药	2021年7月13日	72.13	20,000	1,442,600.00
66	600233	圆通速递	2021年7月1日	10.01	21,300	213,213.00
67	600276	恒瑞医药	2021年7月1日	67.97	21,000	1,427,370.00
68	600332	白云山	2021年7月1日	33.85	12,600	426,510.00
69	600340	华夏幸福	2021年7月2日	5.24	42,000	220,080.00
70	600438	通威股份	2021年7月1日	43.27	24,900	1,077,423.00
71	600482	中国动力	2021年7月1日	17.42	13,100	228,202.00
72	600522	中天科技	2021年7月1日	10.00	20,100	201,000.00
73	600547	山东黄金	2021年7月1日	19.22	27,600	530,472.00
74	600570	恒生电子	2021年7月1日	93.25	10,000	932,500.00
75	600584	长电科技	2021年7月1日-2021年7月13日	37.68	28,200	1,062,576.00
76	600585	海螺水泥	2021年7月1日	41.05	23,200	952,360.00
77	600588	用友网络	2021年7月1日	33.26	10,000	332,600.00
78	600600	青岛啤酒	2021年7月1日	115.65	10,000	1,156,500.00
79	600606	绿地控股	2021年7月2日	5.45	20,000	109,000.00
80	600655	豫园股份	2021年7月1日-2021年7月5日	11.59	23,400	271,206.00
81	600703	三安光电	2021年7月1日	32.05	10,000	320,500.00
82	600745	闻泰科技	2021年7月1日	96.90	10,000	969,000.00
83	600848	上海临港	2021年7月1日	17.90	18,120	324,348.00

84	600872	中炬高新	2021 年 7 月 1 日	42.02	10,000	420,200.00
85	600887	伊利股份	2021 年 7 月 1 日	36.83	13,200	486,156.00
86	600918	中泰证券	2021 年 7 月 9 日	10.82	20,000	216,400.00
87	601066	中信建投	2021 年 7 月 1 日	31.43	10,000	314,300.00
88	601108	财通证券	2021 年 7 月 1 日	10.49	10,000	104,900.00
89	601155	新城控股	2021 年 7 月 1 日	41.60	10,400	432,640.00
90	601162	天风证券	2021 年 7 月 13 日-2021 年 7 月 14 日	4.86	119,000	578,340.00
91	601166	兴业银行	2021 年 7 月 1 日	20.55	12,500	256,875.00
92	601216	君正集团	2021 年 7 月 6 日-2021 年 7 月 13 日	5.09	93,000	473,370.00
93	601238	广汽集团	2021 年 7 月 1 日	12.95	10,000	129,500.00
94	601319	中国人保	2021 年 7 月 1 日	5.93	10,000	59,300.00
95	601336	新华保险	2021 年 7 月 1 日	45.91	10,000	459,100.00
96	601360	三六零	2021 年 7 月 9 日-2021 年 7 月 14 日	12.21	59,000	720,390.00
97	601600	中国铝业	2021 年 7 月 1 日	5.30	200,000	1,060,000.00
98	601633	长城汽车	2021 年 7 月 13 日	43.59	35,000	1,525,650.00
99	601696	中银证券	2021 年 7 月 6 日	20.59	20,000	411,800.00
100	601698	中国卫通	2021 年 7 月 1 日	16.19	10,000	161,900.00
101	601766	中国中车	2021 年 7 月 1 日	6.08	18,900	114,912.00
102	601788	光大证券	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 5 日	17.89	48,600	869,454.00
103	601800	中国交建	2021 年 7 月 1 日	6.48	11,000	71,280.00
104	601808	中海油服	2021 年 7 月 1 日	14.36	10,000	143,600.00
105	601881	中国银河	2021 年 7 月 1 日	10.78	10,000	107,800.00
106	601899	紫金矿业	2021 年 7 月 1 日	9.69	14,600	141,474.00
107	601919	中远海控	2021 年 7 月 8 日-2021 年 7 月 14 日	30.54	133,000	4,061,820.00
108	601933	永辉超市	2021 年 7 月 2 日	4.73	105,000	496,650.00
109	601939	建设银行	2021 年 7 月 1 日	6.65	10,000	66,500.00
110	601985	中国核电	2021 年 7 月 1 日	5.06	15,800	79,948.00
111	601990	南京证券	2021 年 7 月 1 日-2021 年 7 月 2 日	10.52	48,000	504,960.00
112	603019	中科曙光	2021 年 7 月 1 日	27.61	31,800	877,998.00
113	603288	海天味业	2021 年 7 月 1 日	128.95	10,000	1,289,500.00
114	603369	今世缘	2021 年 7 月 1 日	54.16	10,300	557,848.00
115	603799	华友钴业	2021 年 7 月 1 日	114.20	10,000	1,142,000.00
116	603806	福斯特	2021 年 7 月 13 日	105.13	10,000	1,051,300.00
117	603986	兆易创新	2021 年 7 月 1 日	187.90	10,000	1,879,000.00
118	603993	洛阳钼业	2021 年 7 月 1 日	5.16	27,000	139,320.00
合计	-	-	-	-	3,674,020	78,089,648.00

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

本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，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。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、衍生工具(权证等)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、中小企业私募债、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具以及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。

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中国农业银行，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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，违约风险可能性很小。

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。

针对兑付申购赎回产生的退补款、现金替代款和现金差额的流动性风险，本基金的基金管理人于开放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。

于 2021 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即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发行的证券不得超过该证券的 10%。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%。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,545,921.17	-	-	-	29,545,921.17
结算备付金	2,946,217.23	-	-	-	2,946,217.23
存出保证金	524,658.95	-	-	-	524,658.95
交易性金融资产	2,043,400.00	-	-	-2,954,239,294.68	2,956,282,694.68
应收利息	-	-	-	42,605.88	42,605.88
应收股利	-	-	-	44,110.48	44,110.48
资产总计	35,060,197.35	-	-	-2,954,326,011.04	2,989,386,208.39
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,211,710.34	1,211,710.34
应付托管费	-	-	-	242,342.06	242,342.06
应付证券清算款	-	-	-	6,622,302.18	6,622,302.18
应付交易费用	-	-	-	3,093,076.76	3,093,076.76
应交税费	-	-	-	3,909.46	3,909.46
其他负债	-	-	-	365,690.87	365,690.87
负债总计	-	-	-	11,539,031.67	11,539,031.67
利率敏感度缺口	35,060,197.35	-	-	-2,942,786,979.37	2,977,847,176.72
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	66,645,272.17	-	-	-	66,645,272.17
结算备付金	70,014.38	-	-	-	70,014.38
存出保证金	238,105.58	-	-	-	238,105.58
交易性金融资产	-	-	996,847.70	4,943,722,790.32	4,944,719,638.02
应收利息	-	-	-	15,448.30	15,448.30
应收证券清算款	-	-	-	605,927.27	605,927.27
资产总计	66,953,392.13	-	996,847.70	4,944,344,165.89	5,012,294,405.72
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	2,125,007.48	2,125,007.48
应付托管费	-	-	-	425,001.52	425,001.52
应付交易费用	-	-	-	1,403,488.05	1,403,488.05
应交税费	-	-	-	3,075.99	3,075.99
其他负债	-	-	-	621,749.15	621,749.15
负债总计	-	-	-	4,578,322.19	4,578,322.19
利率敏感度缺口	66,953,392.13	-	996,847.70	4,939,765,843.70	5,007,716,083.53

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的

比例为 0.07%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，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。

本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。在建仓完成后，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%。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

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	2,954,239,294.68	99.21	4,943,722,790.32	98.72
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	2,043,400.00	0.07	996,847.70	0.02

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	2,956,282,694.68	99.28	4,944,719,638.02	98.74

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%	146,603,595.24	257,897,378.30
	-5%	-146,603,595.24	-257,897,378.30

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金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 2,950,385,454.29 元（上年度末：4,936,182,595.83 元），属于第二层次的余额为人民币 5,897,240.39 元（上年度末：8,537,042.19 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	2,954,239,294.68	98.82
	其中：股票	2,954,239,294.68	98.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,043,400.00	0.07
	其中：债券	2,043,400.00	0.07
	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	32,492,138.40	1.09
8	其他各项资产	611,375.31	0.02
9	合计	2,989,386,208.39	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	30,976,420.08	1.04
B	采矿业	62,418,538.54	2.10
C	制造业	1,634,834,793.68	54.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	52,054,212.03	1.75

E	建筑业	35,762,276.25	1.20
F	批发和零售业	21,492,425.85	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	86,018,798.56	2.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,785,596.32	3.25
J	金融业	696,752,486.59	23.40
K	房地产业	60,689,390.28	2.04
L	租赁和商务服务业	53,815,364.50	1.81
M	科学研究和技术服务业	42,133,919.68	1.41
N	水利、环境和公共设施管理业	73,526.68	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,322,772.00	0.18
Q	卫生和社会工作	62,760,829.44	2.11
R	文化、体育和娱乐业	12,347,944.20	0.41
S	综合	-	-
	合计	2,954,239,294.68	99.21

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资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	600519	贵州茅台	86,618	178,147,240.60	5.98
2	601318	中国平安	1,496,507	96,195,469.96	3.23
3	600036	招商银行	1,709,676	92,647,342.44	3.11
4	000858	五粮液	268,101	79,864,606.89	2.68
5	601012	隆基股份	597,450	53,077,458.00	1.78
6	000333	美的集团	681,300	48,624,381.00	1.63
7	600276	恒瑞医药	618,528	42,041,348.16	1.41
8	002415	海康威视	644,200	41,550,900.00	1.40
9	601166	兴业银行	2,008,925	41,283,408.75	1.39
10	601888	中国中免	134,851	40,468,785.10	1.36
11	603259	药明康德	247,392	38,739,113.28	1.30
12	300059	东方财富	1,142,010	37,446,507.90	1.26
13	000651	格力电器	664,914	34,642,019.40	1.16
14	600900	长江电力	1,568,540	32,374,665.60	1.09
15	002594	比亚迪	125,226	31,431,726.00	1.06
16	002475	立讯精密	674,305	31,018,030.00	1.04
17	600887	伊利股份	840,501	30,955,651.83	1.04

18	000001	平安银行	1,340,400	30,319,848.00	1.02
19	600030	中信证券	1,176,365	29,338,543.10	0.99
20	000725	京东方 A	4,670,900	29,146,416.00	0.98
21	300015	爱尔眼科	372,867	26,466,099.66	0.89
22	601398	工商银行	4,841,200	25,029,004.00	0.84
23	000568	泸州老窖	101,200	23,877,128.00	0.80
24	600031	三一重工	820,600	23,854,842.00	0.80
25	600309	万华化学	216,898	23,602,840.36	0.79
26	603501	韦尔股份	71,743	23,101,246.00	0.78
27	603288	海天味业	174,612	22,516,217.40	0.76
28	000002	万科 A	940,300	22,388,543.00	0.75
29	002714	牧原股份	363,490	22,107,461.80	0.74
30	600809	山西汾酒	48,213	21,599,424.00	0.73
31	300122	智飞生物	110,300	20,596,319.00	0.69
32	601919	中远海控	668,300	20,409,882.00	0.69
33	002142	宁波银行	497,200	19,375,884.00	0.65
34	600436	片仔癀	41,700	18,694,110.00	0.63
35	601328	交通银行	3,793,900	18,590,110.00	0.62
36	601899	紫金矿业	1,908,786	18,496,136.34	0.62
37	002304	洋河股份	83,300	17,259,760.00	0.58
38	002812	恩捷股份	73,082	17,108,496.20	0.57
39	002352	顺丰控股	251,800	17,046,860.00	0.57
40	002230	科大讯飞	245,800	16,611,164.00	0.56
41	300014	亿纬锂能	156,500	16,265,045.00	0.55
42	600000	浦发银行	1,622,098	16,220,980.00	0.54
43	300274	阳光电源	140,400	16,154,424.00	0.54
44	600438	通威股份	373,000	16,139,710.00	0.54
45	300124	汇川技术	213,950	15,887,927.00	0.53
46	600837	海通证券	1,330,900	15,305,350.00	0.51
47	000661	长春高新	39,100	15,131,700.00	0.51
48	000100	TCL 科技	1,937,300	14,820,345.00	0.50
49	601816	京沪高铁	2,696,600	14,265,014.00	0.48
50	000063	中兴通讯	425,900	14,152,657.00	0.48
51	002241	歌尔股份	330,400	14,121,296.00	0.47
52	300347	泰格医药	72,409	13,996,659.70	0.47
53	603986	兆易创新	73,189	13,752,213.10	0.46
54	601601	中国太保	472,809	13,697,276.73	0.46
55	600585	海螺水泥	331,554	13,610,291.70	0.46
56	600690	海尔智家	522,912	13,548,649.92	0.45
57	002271	东方雨虹	243,850	13,489,782.00	0.45
58	601668	中国建筑	2,896,300	13,467,795.00	0.45
59	002460	赣锋锂业	111,150	13,459,153.50	0.45

60	603799	华友钴业	117,020	13,363,684.00	0.45
61	002027	分众传媒	1,418,340	13,346,579.40	0.45
62	300142	沃森生物	216,200	13,339,540.00	0.45
63	600016	民生银行	2,938,500	12,958,785.00	0.44
64	600763	通策医疗	31,000	12,741,000.00	0.43
65	600196	复星医药	166,700	12,024,071.00	0.40
66	601288	农业银行	3,968,200	12,023,646.00	0.40
67	600048	保利地产	992,400	11,948,496.00	0.40
68	600703	三安光电	370,759	11,882,825.95	0.40
69	000338	潍柴动力	655,800	11,719,146.00	0.39
70	600919	江苏银行	1,632,200	11,588,620.00	0.39
71	002129	中环股份	292,900	11,305,940.00	0.38
72	601229	上海银行	1,374,435	11,270,367.00	0.38
73	601688	华泰证券	711,760	11,245,808.00	0.38
74	600050	中国联通	2,561,300	11,064,816.00	0.37
75	600660	福耀玻璃	193,600	10,812,560.00	0.36
76	600570	恒生电子	115,326	10,754,149.50	0.36
77	601211	国泰君安	622,549	10,670,489.86	0.36
78	600104	上汽集团	484,237	10,638,686.89	0.36
79	601766	中国中车	1,679,600	10,211,968.00	0.34
80	688111	金山办公	25,300	9,988,440.00	0.34
81	601169	北京银行	2,044,524	9,956,831.88	0.33
82	600999	招商证券	512,850	9,754,407.00	0.33
83	002371	北方华创	34,300	9,514,134.00	0.32
84	600019	宝钢股份	1,231,796	9,410,921.44	0.32
85	002311	海大集团	114,700	9,359,520.00	0.31
86	002049	紫光国微	58,640	9,041,701.60	0.30
87	601988	中国银行	2,913,900	8,974,812.00	0.30
88	002410	广联达	131,100	8,941,020.00	0.30
89	600406	国电南瑞	382,831	8,896,992.44	0.30
90	601088	中国神华	455,262	8,886,714.24	0.30
91	300498	温氏股份	616,400	8,857,668.00	0.30
92	601818	光大银行	2,285,300	8,638,434.00	0.29
93	300601	康泰生物	56,780	8,460,220.00	0.28
94	600745	闻泰科技	85,810	8,314,989.00	0.28
95	000625	长安汽车	313,500	8,238,780.00	0.28
96	000538	云南白药	70,600	8,169,832.00	0.27
97	300450	先导智能	134,560	8,092,438.40	0.27
98	600028	中国石化	1,848,800	8,060,768.00	0.27
99	600893	航发动力	147,400	7,840,206.00	0.26
100	601628	中国人寿	230,300	7,804,867.00	0.26
101	600346	恒力石化	291,620	7,652,108.80	0.26

102	002821	凯莱英	20,200	7,526,520.00	0.25
103	601658	邮储银行	1,497,100	7,515,442.00	0.25
104	600588	用友网络	225,751	7,508,478.26	0.25
105	601390	中国中铁	1,405,900	7,366,916.00	0.25
106	601633	长城汽车	168,700	7,353,633.00	0.25
107	601009	南京银行	692,601	7,286,162.52	0.24
108	300595	欧普康视	70,074	7,256,162.70	0.24
109	002493	荣盛石化	419,850	7,250,809.50	0.24
110	601377	兴业证券	740,600	7,154,196.00	0.24
111	601857	中国石油	1,342,200	7,100,238.00	0.24
112	688036	传音控股	33,000	6,913,500.00	0.23
113	300413	芒果超媒	98,512	6,757,923.20	0.23
114	600132	重庆啤酒	33,200	6,571,940.00	0.22
115	601225	陕西煤业	552,200	6,543,570.00	0.22
116	600009	上海机场	135,363	6,515,021.19	0.22
117	600584	长电科技	172,100	6,484,728.00	0.22
118	002601	龙佰集团	185,400	6,411,132.00	0.22
119	300408	三环集团	150,600	6,388,452.00	0.21
120	600426	华鲁恒升	204,000	6,313,800.00	0.21
121	600111	北方稀土	301,500	6,241,050.00	0.21
122	000776	广发证券	408,900	6,190,746.00	0.21
123	601100	恒立液压	72,018	6,187,786.56	0.21
124	601939	建设银行	926,400	6,160,560.00	0.21
125	002001	新和成	213,600	6,126,048.00	0.21
126	603882	金域医学	38,200	6,103,214.00	0.20
127	688012	中微公司	36,700	6,089,264.00	0.20
128	000895	双汇发展	191,100	6,076,980.00	0.20
129	300433	蓝思科技	206,199	6,064,312.59	0.20
130	600926	杭州银行	409,766	6,044,048.50	0.20
131	002179	中航光电	75,910	5,998,408.20	0.20
132	002050	三花智控	248,138	5,950,349.24	0.20
133	000166	申万宏源	1,245,100	5,827,068.00	0.20
134	600958	东方证券	576,600	5,760,234.00	0.19
135	002841	视源股份	46,200	5,742,198.00	0.19
136	600741	华域汽车	217,700	5,718,979.00	0.19
137	600600	青岛啤酒	48,900	5,655,285.00	0.19
138	300003	乐普医疗	174,500	5,604,940.00	0.19
139	000963	华东医药	120,759	5,556,121.59	0.19
140	002007	华兰生物	151,345	5,551,334.60	0.19
141	000786	北新建材	139,900	5,491,075.00	0.18
142	000157	中联重科	585,600	5,410,944.00	0.18
143	601006	大秦铁路	820,500	5,398,890.00	0.18

144	603806	福斯特	50,800	5,340,604.00	0.18
145	601901	方正证券	568,694	5,322,975.84	0.18
146	002607	中公教育	254,800	5,322,772.00	0.18
147	601336	新华保险	115,200	5,288,832.00	0.18
148	600015	华夏银行	850,033	5,261,704.27	0.18
149	002236	大华股份	248,300	5,239,130.00	0.18
150	601155	新城控股	124,900	5,195,840.00	0.17
151	601989	中国重工	1,259,500	5,189,140.00	0.17
152	600143	金发科技	247,900	5,171,194.00	0.17
153	600176	中国巨石	332,123	5,151,227.73	0.17
154	601138	工业富联	410,300	5,091,823.00	0.17
155	603993	洛阳钼业	976,600	5,039,256.00	0.17
156	000768	中航西飞	191,400	5,029,992.00	0.17
157	601877	正泰电器	148,600	4,960,268.00	0.17
158	600352	浙江龙盛	359,500	4,939,530.00	0.17
159	600760	中航沈飞	81,383	4,907,394.90	0.16
160	600029	南方航空	810,518	4,879,318.36	0.16
161	600010	包钢股份	3,146,040	4,876,362.00	0.16
162	601788	光大证券	269,600	4,823,144.00	0.16
163	600547	山东黄金	250,032	4,805,615.04	0.16
164	300529	健帆生物	55,631	4,804,293.16	0.16
165	001979	招商蛇口	437,300	4,788,435.00	0.16
166	601600	中国铝业	902,300	4,782,190.00	0.16
167	002008	大族激光	117,800	4,757,942.00	0.16
168	601186	中国铁建	636,000	4,725,480.00	0.16
169	603369	今世缘	86,600	4,690,256.00	0.16
170	002202	金风科技	381,206	4,635,464.96	0.16
171	601916	浙商银行	1,150,500	4,567,485.00	0.15
172	000876	新希望	310,900	4,560,903.00	0.15
173	002555	三七互娱	183,600	4,410,072.00	0.15
174	003816	中国广核	1,627,200	4,344,624.00	0.15
175	603899	晨光文具	51,193	4,328,880.08	0.15
176	000938	紫光股份	197,718	4,326,069.84	0.15
177	601799	星宇股份	19,000	4,288,680.00	0.14
178	688169	石头科技	3,400	4,287,400.00	0.14
179	002736	国信证券	398,800	4,287,100.00	0.14
180	601066	中信建投	134,800	4,236,764.00	0.14
181	600109	国金证券	333,700	4,234,653.00	0.14
182	000069	华侨城 A	566,300	4,213,272.00	0.14
183	600989	宝丰能源	302,200	4,134,096.00	0.14
184	000425	徐工机械	648,100	4,128,397.00	0.14
185	300136	信维通信	133,400	4,119,392.00	0.14

186	603160	汇顶科技	31,582	4,093,974.66	0.14
187	601669	中国电建	1,055,524	4,084,877.88	0.14
188	600150	中国船舶	246,300	4,066,413.00	0.14
189	000977	浪潮信息	140,541	3,953,418.33	0.13
190	600795	国电电力	1,625,500	3,949,965.00	0.13
191	002384	东山精密	188,300	3,924,172.00	0.13
192	000783	长江证券	534,700	3,914,004.00	0.13
193	603659	璞泰来	28,620	3,909,492.00	0.13
194	688008	澜起科技	62,400	3,892,512.00	0.13
195	601238	广汽集团	299,600	3,879,820.00	0.13
196	603019	中科曙光	139,940	3,863,743.40	0.13
197	600085	同仁堂	94,400	3,856,240.00	0.13
198	002624	完美世界	160,700	3,842,337.00	0.13
199	600079	人福医药	135,017	3,816,930.59	0.13
200	000596	古井贡酒	15,900	3,808,050.00	0.13
201	601838	成都银行	299,200	3,781,888.00	0.13
202	300677	英科医疗	29,800	3,719,040.00	0.12
203	600886	国投电力	385,400	3,703,694.00	0.12
204	600183	生益科技	158,000	3,698,780.00	0.12
205	300558	贝达药业	34,000	3,680,160.00	0.12
206	601985	中国核电	724,000	3,663,440.00	0.12
207	300144	宋城演艺	217,040	3,646,272.00	0.12
208	000703	恒逸石化	305,010	3,644,869.50	0.12
209	601108	财通证券	346,400	3,633,736.00	0.12
210	601360	三六零	296,100	3,615,381.00	0.12
211	002600	领益智造	390,200	3,585,938.00	0.12
212	601555	东吴证券	428,629	3,574,765.86	0.12
213	002414	高德红外	129,580	3,573,816.40	0.12
214	603517	绝味食品	42,300	3,565,467.00	0.12
215	603833	欧派家居	25,096	3,562,628.16	0.12
216	000066	中国长城	242,400	3,539,040.00	0.12
217	002252	上海莱士	464,000	3,475,360.00	0.12
218	002044	美年健康	379,128	3,453,856.08	0.12
219	002938	鹏鼎控股	95,700	3,433,716.00	0.12
220	601077	渝农商行	852,600	3,401,874.00	0.11
221	300676	华大基因	28,624	3,394,806.40	0.11
222	600522	中天科技	339,400	3,394,000.00	0.11
223	601607	上海医药	159,436	3,368,882.68	0.11
224	000728	国元证券	421,020	3,355,529.40	0.11
225	300033	同花顺	29,718	3,351,596.04	0.11
226	002602	世纪华通	515,801	3,311,442.42	0.11
227	688396	华润微	36,300	3,304,026.00	0.11

228	600332	白云山	96,800	3,276,680.00	0.11
229	600161	天坛生物	94,780	3,246,215.00	0.11
230	600872	中炬高新	77,149	3,241,800.98	0.11
231	601111	中国国航	414,000	3,220,920.00	0.11
232	600362	江西铜业	143,400	3,209,292.00	0.11
233	600383	金地集团	311,995	3,194,828.80	0.11
234	601800	中国交建	486,200	3,150,576.00	0.11
235	600115	中国东航	619,200	3,145,536.00	0.11
236	300628	亿联网络	37,400	3,134,120.00	0.11
237	600845	宝信软件	61,354	3,122,918.60	0.10
238	002024	苏宁易购	546,500	3,054,935.00	0.10
239	002508	老板电器	65,500	3,045,750.00	0.10
240	000860	顺鑫农业	71,700	3,024,306.00	0.10
241	600061	国投资本	355,016	3,014,085.84	0.10
242	002916	深南电路	27,000	3,000,510.00	0.10
243	601727	上海电气	705,768	2,992,456.32	0.10
244	601618	中国中冶	987,000	2,941,260.00	0.10
245	000708	中信特钢	139,600	2,909,264.00	0.10
246	601162	天风证券	597,260	2,902,683.60	0.10
247	601021	春秋航空	50,753	2,887,845.70	0.10
248	600705	中航产融	739,500	2,861,865.00	0.10
249	601878	浙商证券	214,500	2,805,660.00	0.09
250	603939	益丰药房	49,400	2,770,846.00	0.09
251	600606	绿地控股	506,100	2,758,245.00	0.09
252	688363	华熙生物	9,800	2,723,028.00	0.09
253	601990	南京证券	254,800	2,680,496.00	0.09
254	002456	欧菲光	297,100	2,638,248.00	0.09
255	002157	正邦科技	217,400	2,597,930.00	0.09
256	002463	沪电股份	167,100	2,585,037.00	0.09
257	600011	华能国际	606,682	2,560,198.04	0.09
258	000656	金科股份	442,100	2,559,759.00	0.09
259	600521	华海药业	120,200	2,509,776.00	0.08
260	601933	永辉超市	526,500	2,490,345.00	0.08
261	600655	豫园股份	214,800	2,489,532.00	0.08
262	603392	万泰生物	9,240	2,394,823.20	0.08
263	600118	中国卫星	81,700	2,390,542.00	0.08
264	601216	君正集团	465,900	2,371,431.00	0.08
265	600848	上海临港	132,480	2,371,392.00	0.08
266	601696	中银证券	113,700	2,341,083.00	0.08
267	600489	中金黄金	268,666	2,315,900.92	0.08
268	600018	上港集团	478,600	2,282,922.00	0.08
269	002558	巨人网络	167,200	2,223,760.00	0.07

270	601995	中金公司	36,000	2,214,000.00	0.07
271	002120	韵达股份	159,891	2,163,325.23	0.07
272	603195	公牛集团	10,700	2,161,400.00	0.07
273	601998	中信银行	422,700	2,155,770.00	0.07
274	601872	招商轮船	445,680	2,059,041.60	0.07
275	002673	西部证券	246,600	2,034,450.00	0.07
276	601319	中国人保	342,200	2,029,246.00	0.07
277	688009	中国通号	356,600	2,029,054.00	0.07
278	688126	沪硅产业	68,300	1,992,994.00	0.07
279	603338	浙江鼎力	33,400	1,960,246.00	0.07
280	002739	万达电影	123,100	1,943,749.00	0.07
281	601881	中国银河	177,200	1,910,216.00	0.06
282	603658	安图生物	24,350	1,844,999.50	0.06
283	600233	圆通速递	174,248	1,744,222.48	0.06
284	603233	大参林	32,600	1,666,186.00	0.06
285	600482	中国动力	90,000	1,567,800.00	0.05
286	601231	环旭电子	91,800	1,543,158.00	0.05
287	002153	石基信息	62,440	1,467,964.40	0.05
288	600025	华能水电	249,500	1,444,605.00	0.05
289	002032	苏泊尔	22,513	1,436,104.27	0.05
290	002939	长城证券	128,100	1,425,753.00	0.05
291	000800	一汽解放	127,200	1,376,304.00	0.05
292	601236	红塔证券	100,200	1,358,712.00	0.05
293	600340	华夏幸福	242,477	1,270,579.48	0.04
294	002773	康弘药业	50,672	1,172,043.36	0.04
295	601808	中海油服	81,500	1,170,340.00	0.04
296	600918	中泰证券	106,800	1,155,576.00	0.04
297	688686	奥普特	2,330	1,050,830.00	0.04
298	601698	中国卫通	60,300	976,257.00	0.03
299	603087	甘李药业	8,520	908,061.60	0.03
300	600299	安迪苏	55,500	663,780.00	0.02
301	002945	华林证券	37,400	516,868.00	0.02
302	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.01
303	688613	奥精医疗	2,617	166,179.50	0.01
304	301006	迈拓股份	5,051	125,719.39	0.00
305	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.00
306	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.00
307	688656	浩欧博	1,371	99,534.60	0.00
308	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
309	688607	康众医疗	1,890	84,105.00	0.00
310	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
311	688633	星球石墨	1,558	82,792.12	0.00

312	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
313	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.00
314	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
315	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
316	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
317	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
318	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
319	688565	力源科技	2,464	34,496.00	0.00
320	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
321	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
322	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
323	301015	百洋医药	462	17,939.46	0.00
324	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
325	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
326	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
327	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
328	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
329	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
330	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
331	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
332	301013	利和兴	471	12,768.81	0.00
333	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
334	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
335	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
336	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
337	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
338	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
339	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
340	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
341	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
342	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
343	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
344	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
345	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
346	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
347	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
348	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
349	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
350	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
351	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
352	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
353	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00

354	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
355	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
356	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
357	301004	嘉益股份	312	6,845.28	0.00
358	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
359	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
360	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
361	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
362	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
363	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
364	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
365	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
366	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
367	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
368	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
369	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
370	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
371	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
372	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
373	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	600519	贵州茅台	26,127,356.00	0.52
2	603501	韦尔股份	23,512,160.52	0.47
3	600036	招商银行	20,674,783.56	0.41
4	002352	顺丰控股	14,038,654.00	0.28
5	600809	山西汾酒	13,700,254.00	0.27
6	300274	阳光电源	13,695,707.00	0.27
7	600763	通策医疗	13,568,449.38	0.27
8	601816	京沪高铁	13,237,526.00	0.26
9	603259	药明康德	11,353,480.88	0.23
10	000661	长春高新	10,834,891.00	0.22
11	002812	恩捷股份	10,658,541.25	0.21
12	688111	金山办公	10,258,948.22	0.20
13	600196	复星医药	9,721,415.78	0.19
14	300450	先导智能	8,707,054.40	0.17
15	002714	牧原股份	8,379,966.92	0.17
16	002049	紫光国微	8,008,489.91	0.16

17	300595	欧普康视	7,313,888.10	0.15
18	002415	海康威视	6,955,957.00	0.14
19	002371	北方华创	6,943,634.00	0.14
20	600426	华鲁恒升	6,804,407.00	0.14

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	000858	五粮液	80,827,815.88	1.61
2	000333	美的集团	60,152,350.52	1.20
3	000651	格力电器	38,650,127.04	0.77
4	300059	东方财富	32,496,835.41	0.65
5	000001	平安银行	31,417,389.82	0.63
6	002415	海康威视	30,460,274.76	0.61
7	000568	泸州老窖	30,289,315.15	0.60
8	600519	贵州茅台	28,004,238.79	0.56
9	002594	比亚迪	27,641,510.16	0.55
10	000661	长春高新	26,078,930.56	0.52
11	002475	立讯精密	25,737,048.76	0.51
12	000002	万科A	24,517,947.17	0.49
13	002714	牧原股份	21,820,985.54	0.44
14	601318	中国平安	21,744,869.20	0.43
15	300015	爱尔眼科	21,441,478.93	0.43
16	000725	京东方A	20,967,655.00	0.42
17	002352	顺丰控股	20,161,211.62	0.40
18	002304	洋河股份	17,654,831.85	0.35
19	000100	TCL 科技	15,716,424.30	0.31
20	002027	分众传媒	15,433,146.40	0.31

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	675,278,430.12
卖出股票收入（成交）总额	1,446,288,089.61

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）	2,043,400.00	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,043,400.00	0.07

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	113050	南银转债	17,610	1,761,000.00	0.06
2	127038	国微转债	1,299	129,900.00	0.00
3	113049	长汽转债	830	83,000.00	0.00
4	123117	健帆转债	695	69,500.00	0.00

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	524,658.95
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	44,110.48
4	应收利息	42,605.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	611,375.31

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600276	恒瑞医药	1,427,370.00	0.05	转融通流通受限
2	002415	海康威视	1,167,450.00	0.04	转融通流通受限
3	600036	招商银行	997,096.00	0.03	转融通流通受限
4	000333	美的集团	713,700.00	0.02	转融通流通受限
5	601166	兴业银行	256,875.00	0.01	转融通流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
288	7,461,119.44	2,147,706,300.00	99.95	1,096,100.00	0.05

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	中国中金财富证券有 限公司转融通担保证 券明细账户	36,385,000.00	1.69
2	友邦保险有限公司江 苏分公司—传统—普 通保险产品	30,226,200.00	1.41
3	中信证券股份有限公司	1,845,300.00	0.09
4	王新红	115,000.00	0.01
5	张志义	100,000.00	0.00
6	黄庭兰	100,000.00	0.00
7	卢新英	80,000.00	0.00
8	骆莉	50,000.00	0.00
9	程良平	40,000.00	0.00
10	王振河	40,000.00	0.00
11	中国农业银行股份有 限公司—国寿安保沪 深 300 交易型开放式指 数证券投资基金联接 基	2,079,249,800.00	96.76

注：表中前十名持有人为除国寿安保沪深 300ETF 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

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	500.00	0.00

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

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

注：本公司的所有从业人员均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 1 月 19 日）基金份额总额	294,802,400.00
本报告期期初基金份额总额	3,672,802,400.00
本报告期基金总申购份额	90,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,614,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	2,148,802,400.00

§ 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。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

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

本基金于 2018 年 12 月 28 日发布公告，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	638,745,731.25	30.25%	594,865.62	35.21%	-
国泰君安	2	568,672,241.30	26.93%	529,605.75	31.35%	-
中金公司	2	341,319,454.53	16.16%	147,212.03	8.71%	-
长城证券	2	298,935,877.54	14.16%	218,618.70	12.94%	-
兴业证券	2	232,264,926.41	11.00%	169,855.58	10.05%	-
海通证券	2	31,601,998.87	1.50%	29,431.03	1.74%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；

(3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；

(4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

(5) 具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；

(6) 具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；

(7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	6,500,765.18	58.94%	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	892,000.20	8.09%	-	-	-	-
兴业证券	168,442.80	1.53%	-	-	-	-
海通证券	3,467,868.70	31.44%	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 22 日

2	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
3	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
4	关于国寿安保沪深 300 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	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
5	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
6	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
7	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2021 年第 1 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 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	3,638,649,800.00	54,600,000.00	1,614,000,000.00	2,079,249,800.00	96.76
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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保沪深 300 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 报告期内国寿安保沪深 300 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