

# 国寿安保中证 500 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

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	9
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
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	10
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.....	10
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	10
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>11</b>
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.....	13
6.4 报表附注.....	14
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>34</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	34
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.....	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	50

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	51
7.12 投资组合报告附注.....	51
<b>§ 8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>52</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	52
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	52
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	52
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.....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示.....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	53
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	53
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	53
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>55</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
<b>§ 12 备查文件目录.....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录.....	56
12.2 存放地点.....	56
12.3 查阅方式.....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	国寿 500
基金主代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 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	170,318,687.00 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	2015 年 7 月 3 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
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。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，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近的风险收益特征。

### 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
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
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	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gsfunds.com.cn">http://www.gsfunds.com.cn</a>

基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处
------------	--------------

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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	121,844,206.83
本期利润	52,812,718.70
加权平均基金份额本期利润	0.1052
本期加权平均净值利润率	7.52%
本期基金份额净值增长率	8.99%
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	-112,449,580.17
期末可供分配基金份额利润	-0.6602
期末基金资产净值	255,384,242.28
期末基金份额净值	1.4994
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	-30.57%

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	1.63%	0.72%	1.18%	0.73%	0.45%	-0.01%
过去三个月	10.22%	0.67%	8.86%	0.68%	1.36%	-0.01%
过去六个月	8.99%	0.98%	6.93%	0.99%	2.06%	-0.01%
过去一年	18.90%	1.23%	16.09%	1.25%	2.81%	-0.02%
过去三年	34.49%	1.47%	30.48%	1.48%	4.01%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-30.57%	1.71%	-31.01%	1.74%	0.44%	-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

国寿安保中证500ETF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 2015 年 05 月 29 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 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 2015 年 05 月 29 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	说明
----	----	-----------------	------	----

		任职日期	离任日期	年限	
李康	基金经理	2015 年 5 月 29 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、国寿安保护国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保护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遵规守信情况的说明

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股票停牌和成份股调整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 1.4994 元；本报告期基金份额净值增长率为 8.99%，业绩比较基准收益率为 6.93%。

#### 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

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 1 月 1 日至 2021 年 6 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

的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	3,876,565.94	5,252,939.56
结算备付金		2,136,553.84	-
存出保证金		107,795.14	30,926.98
交易性金融资产	6.4.7.2	250,629,129.19	797,929,494.64
其中：股票投资		250,563,129.19	797,913,194.64
基金投资		-	-
债券投资		66,000.00	16,300.00
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		50,795.16	7,195,640.39
应收利息	6.4.7.5	2,212.55	1,203.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-426.00	-
资产总计		256,802,625.82	810,410,205.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		162,610.69	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		119,692.72	339,894.74
应付托管费		23,938.57	67,978.95

应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	982,644.93	423,318.14
应交税费		0.13	1.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	129,496.50	230,484.31
负债合计		1,418,383.54	1,061,677.52
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	367,833,822.45	1,270,579,965.54
未分配利润	6.4.7.10	-112,449,580.17	-461,231,437.69
所有者权益合计		255,384,242.28	809,348,527.85
负债和所有者权益总计		256,802,625.82	810,410,205.37

注：报告截止日 2021 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4994 元，基金份额总额 170,318,687.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 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 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
一、收入		56,209,767.75	87,026,724.84
1. 利息收入		89,908.62	15,207.60
其中：存款利息收入	6.4.7.11	44,124.43	15,129.87
债券利息收入		164.43	77.73
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		45,619.76	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		123,837,793.09	30,187,240.73
其中：股票投资收益	6.4.7.12	119,935,658.39	24,522,802.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	121,438.36	35,680.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,780,696.34	5,628,758.02
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-69,031,488.13	56,821,044.55
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	1,313,554.17	3,231.96

减：二、费用		3,397,049.05	2,782,669.74
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,755,554.42	1,842,177.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	351,110.88	368,435.52
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	1,093,368.18	375,465.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		164.55	0.24
7. 其他费用	6.4.7.20	196,851.02	196,590.82
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		52,812,718.70	84,244,055.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		52,812,718.70	84,244,055.10

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 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）	1,270,579,965.54	-461,231,437.69	809,348,527.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	52,812,718.70	52,812,718.70
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）	-902,746,143.09	295,969,138.82	-606,777,004.27
其中：1. 基金申购款	8,638,719.08	-2,787,816.12	5,850,902.96
2. 基金赎回款	-911,384,862.17	298,756,954.94	-612,627,907.23
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）	367,833,822.45	-112,449,580.17	255,384,242.28
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）	1,374,244,594.45	-656,335,418.05	717,909,176.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	84,244,055.10	84,244,055.10
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）	-12,958,078.60	5,687,096.79	-7,270,981.81

其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-12,958,078.60	5,687,096.79	-7,270,981.81
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）	1,361,286,515.85	-566,404,266.16	794,882,249.69

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

国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2015]485 号文《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2015 年 5 月 11 日至 2015 年 5 月 22 日向社会公开发行人募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明(2015)验字第 61090605\_A04 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 2015 年 5 月 29 日正式生效，首次设立募集规模为 665,869,631.00 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，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司（简称“农业银行”）。

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、现金资产、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。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。本基金的业绩比较基准为标的指数。本基金标的指数为中证 500 指数。为了更好的跟踪标的指数，基金管理人在本基金基金份额上市前可进行基金份额折算并提前公告。在本基金基金份额上市后，基金管理人也可以根据运作情况决定是否对基金份额进行折算并提前公告，无需召开份额持有人大会。

#### 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

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 6.4.6 税项

### 6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产



品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含

1 个月) 的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在 1 个月以上至 1 年 (含 1 年) 的, 暂减按 50% 计入应纳税所得额; 持股期限超过 1 年的, 暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税;

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定, 自 2015 年 9 月 8 日起, 证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票, 持股期限超过 1 年的, 股息红利所得暂免征收个人所得税。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加, 以实际缴纳的增值税税额为计税依据, 分别按规定的比例缴纳。

#### 6.4.7 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	3,876,565.94
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	3,876,565.94

##### 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	224,791,397.04	250,563,129.19	25,771,732.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	66,000.00	66,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	66,000.00	66,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	224,857,397.04	250,629,129.19	25,771,732.15

**6.4.7.3 衍生金融资产/负债**

本基金于本报告期末有衍生金融资产/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**

本基金于本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 应收利息**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
应收活期存款利息	1,199.66
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	961.50
应收债券利息	2.89
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	48.50
合计	2,212.55

**6.4.7.6 其他资产**

单位：人民币元

项目	本期末 2021年6月30日
其他应收款	—
待摊费用	—
其他	-426.00
合计	-426.00

**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	982,644.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	982,644.93

#### 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	45,193.94
合计	129,496.50

#### 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	588,318,687.00	1,270,579,965.54
本期申购	4,000,000.00	8,638,719.08
本期赎回（以“-”号填列）	-422,000,000.00	-911,384,862.17
- 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	170,318,687.00	367,833,822.45

#### 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	-515,682,836.17	54,451,398.48	-461,231,437.69
本期利润	121,844,206.83	-69,031,488.13	52,812,718.70
本期基金份额交易产生的变动数	310,420,398.83	-14,451,260.01	295,969,138.82
其中：基金申购款	-2,727,864.93	-59,951.19	-2,787,816.12
基金赎回款	313,148,263.76	-14,391,308.82	298,756,954.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-83,418,230.51	-29,031,349.66	-112,449,580.17

#### 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	39,752.76
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	4,123.47
其他	248.20
合计	44,124.43

#### 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	85,267,776.59
股票投资收益——赎回差价收入	34,667,881.80
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	119,935,658.39

##### 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	463,323,221.87
减：卖出股票成本总额	378,055,445.28
买卖股票差价收入	85,267,776.59

##### 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	579,960,754.13
减：现金支付赎回款总额	297,523,335.13
减：赎回股票成本总额	247,769,537.20
赎回差价收入	34,667,881.80

### 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	121,438.36
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	121,438.36

#### 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	891,904.07
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	770,300.00
减：应收利息总额	165.71
买卖债券差价收入	121,438.36

#### 6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资产生的收益/损失。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期间及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	3,780,696.34
其中：证券出借权益补偿收入	10,330.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	3,780,696.34

#### 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	-69,031,488.13
股票投资	-69,031,488.13
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	-69,031,488.13

#### 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	1,313,554.17
合计	1,313,554.17

#### 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	1,093,368.18
银行间市场交易费用	-
合计	1,093,368.18

#### 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	-
银行费用	7,215.22
指数使用费	105,333.24
合计	196,851.02

## 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
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
国寿投资保险资产管理有限公司（简称“国寿投资”）	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（“国寿安保中证 500ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。



### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6 月30日	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	1,755,554.42	1,842,177.61
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	351,110.88	368,435.52

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

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

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

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

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 (%)
国寿安保中证 500ETF联接基金	166,286,286.00	97.63	585,486,286.00	99.52

##### 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	3,876,565.94	39,752.76	5,765,489.94	13,932.17

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

#### 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	-
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	648	5,616.00	17,768.16	锁定期内发生送股
300950	德固特	2021年2月24日	2021年9月3日	新股流通受限	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
300953	震裕科技	2021年3月	2021年9月	新股流	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-

		月 11 日	月 22 日	通受限						
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	562	26,599.46	141,601.52	-
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	482	10,030.42	20,354.86	-
300997	欢乐家	2021年5月26日	2021年12月2日	新股流通受限	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300998	宁波方正	2021年5月25日	2021年12月2日	新股流通受限	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301002	崧盛股份	2021年5月27日	2021年12月7日	新股流通受限	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
688191	智洋创新	2021年3月30日	2021年10月8日	新股流通受限	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
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	-
688350	富淼科技	2021年1月21日	2021年7月28日	新股流通受限	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688538	和辉光电	2021年5月20日	2021年11月29日	新股流通受限	2.65	3.38	172,571	457,313.15	583,289.98	-

#### 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
600460	士兰微	2021年6月30日	重大事项停牌	56.35	2021年7月1日	59.49	32,100	531,355.26	1,808,835.00	-
600811	东方集团	2021年6月30日	重大事项停牌	3.05	2021年7月14日	3.36	121,130	512,969.54	369,446.50	-

#### 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

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资

组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，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，其余均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。本基金于本报告期末持有债券投资占基金份额比例较低，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	3,876,565.94	-	-	-	3,876,565.94
结算备付金	2,136,553.84	-	-	-	2,136,553.84
存出保证金	107,795.14	-	-	-	107,795.14
交易性金融资产	66,000.00	-	-	-250,563,129.19	250,629,129.19
应收利息	-	-	-	2,212.55	2,212.55
应收证券清算款	-	-	-	50,795.16	50,795.16
其他资产	-	-	-	-426.00	-426.00
资产总计	6,186,914.92	-	-	-250,615,710.90	256,802,625.82
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	119,692.72	119,692.72

应付托管费	-	-	-	23,938.57	23,938.57
应付证券清算款	-	-	-	162,610.69	162,610.69
应付交易费用	-	-	-	982,644.93	982,644.93
应交税费	-	-	-	0.13	0.13
其他负债	-	-	-	129,496.50	129,496.50
负债总计	-	-	-	1,418,383.54	1,418,383.54
利率敏感度缺口	6,186,914.92	-	-	-249,197,327.36	255,384,242.28
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	5,252,939.56	-	-	-	5,252,939.56
存出保证金	30,926.98	-	-	-	30,926.98
交易性金融资产	-	-	16,300.00	797,913,194.64	797,929,494.64
应收利息	-	-	-	1,203.80	1,203.80
应收证券清算款	-	-	-	7,195,640.39	7,195,640.39
资产总计	5,283,866.54	-	16,300.00	805,110,038.83	810,410,205.37
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	339,894.74	339,894.74
应付托管费	-	-	-	67,978.95	67,978.95
应付交易费用	-	-	-	423,318.14	423,318.14
应交税费	-	-	-	1.38	1.38
其他负债	-	-	-	230,484.31	230,484.31
负债总计	-	-	-	1,061,677.52	1,061,677.52
利率敏感度缺口	5,283,866.54	-	16,300.00	804,048,361.31	809,348,527.85

#### 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和债券投资等，除此之外的金融资产和金融负债均不计息。因此市场利率的变动对于本资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股。本基金投资标的指数成份股、备选成份股的资产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按照法律法规或监管机构的规定执行。于 2021 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

#### 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	250,563,129.19	98.11	797,913,194.64	98.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	66,000.00	0.03	16,300.00	-
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	250,629,129.19	98.14	797,929,494.64	98.59

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5% 基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2021 年 6 月 30 日）	上年度末（2020 年 12 月 31 日）
	+5%	12,569,469.00	40,201,924.80
-5%	-12,569,469.00	-40,201,924.80	

#### 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

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 249,212,706.63 元（上年度末：

796,513,428.31 元），属于第二层次的余额为人民币 1,415,996.56 元（上年度末：1,416,066.33 元），本报告期末及上年度末均无属于第三层次的余额。

#### (2) 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

#### 6.4.14.3 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

#### 6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 8 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	250,563,129.19	97.57
	其中：股票	250,563,129.19	97.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	66,000.00	0.03
	其中：债券	66,000.00	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	6,013,119.78	2.34
8	其他各项资产	160,376.85	0.06
9	合计	256,802,625.82	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	2,442,567.28	0.96

B	采矿业	8,693,572.70	3.40
C	制造业	158,898,644.61	62.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,025,407.00	2.36
E	建筑业	4,645,320.30	1.82
F	批发和零售业	8,543,157.06	3.35
G	交通运输、仓储和邮政业	4,810,412.06	1.88
H	住宿和餐饮业	1,327,695.20	0.52
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,742,775.90	8.12
J	金融业	14,647,666.78	5.74
K	房地产业	8,134,252.20	3.19
L	租赁和商务服务业	3,295,301.40	1.29
M	科学研究和技术服务业	653,691.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	2,158,467.35	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	156,587.12	0.06
Q	卫生和社会工作	680,974.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	2,508,437.63	0.98
S	综合	2,197,773.60	0.86
	合计	250,562,703.19	98.11

注：此项合计不包含可退替代款估值增值。

### 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	002709	天赐材料	23,214	2,474,148.12	0.97
2	000799	酒鬼酒	9,200	2,351,520.00	0.92
3	603486	科沃斯	9,200	2,098,336.00	0.82
4	600089	特变电工	151,500	1,946,775.00	0.76
5	000009	中国宝安	105,180	1,921,638.60	0.75
6	002074	国轩高科	41,800	1,820,808.00	0.71
7	600460	士兰微	32,100	1,808,835.00	0.71
8	002340	格林美	192,678	1,801,539.30	0.71
9	300285	国瓷材料	32,600	1,589,250.00	0.62
10	601233	桐昆股份	65,300	1,573,077.00	0.62
11	300207	欣旺达	45,000	1,465,200.00	0.57
12	002185	华天科技	89,500	1,377,405.00	0.54
13	300316	晶盛机电	26,400	1,333,200.00	0.52
14	600885	宏发股份	21,140	1,325,478.00	0.52
15	601636	旗滨集团	65,700	1,219,392.00	0.48

16	600733	北汽蓝谷	87,400	1,178,152.00	0.46
17	300037	新宙邦	11,500	1,151,150.00	0.45
18	300146	汤臣倍健	34,700	1,141,630.00	0.45
19	300253	卫宁健康	69,600	1,132,392.00	0.44
20	002648	卫星石化	28,280	1,108,293.20	0.43
21	603737	三棵树	6,280	1,105,280.00	0.43
22	002625	光启技术	52,200	1,086,282.00	0.43
23	600884	杉杉股份	46,410	1,082,281.20	0.42
24	002223	鱼跃医疗	28,250	1,077,172.50	0.42
25	600219	南山铝业	292,800	1,054,080.00	0.41
26	002353	杰瑞股份	23,400	1,045,980.00	0.41
27	601127	小康股份	15,427	1,028,518.09	0.40
28	002138	顺络电子	26,400	1,023,528.00	0.40
29	600779	水井坊	7,900	998,165.00	0.39
30	000547	航天发展	52,500	990,675.00	0.39
31	603589	口子窖	14,600	988,274.00	0.39
32	002797	第一创业	136,000	971,040.00	0.38
33	600704	物产中大	122,500	964,075.00	0.38
34	002444	巨星科技	28,100	957,648.00	0.37
35	300699	光威复材	12,600	956,970.00	0.37
36	603444	吉比特	1,800	954,000.00	0.37
37	000988	华工科技	40,500	952,560.00	0.37
38	601099	太平洋	278,100	942,759.00	0.37
39	002212	天融信	47,600	941,052.00	0.37
40	601168	西部矿业	77,766	927,748.38	0.36
41	688099	晶晨股份	8,200	920,040.00	0.36
42	002422	科伦药业	46,100	919,695.00	0.36
43	600739	辽宁成大	44,100	917,721.00	0.36
44	002385	大北农	134,100	911,880.00	0.36
45	000807	云铝股份	75,800	902,020.00	0.35
46	688002	睿创微纳	8,900	888,487.00	0.35
47	300308	中际旭创	23,000	885,960.00	0.35
48	002439	启明星辰	30,400	881,904.00	0.35
49	601117	中国化学	100,500	880,380.00	0.34
50	000636	风华高科	29,100	879,402.00	0.34
51	603893	瑞芯微	6,300	878,598.00	0.34
52	600392	盛和资源	50,595	878,329.20	0.34
53	600862	中航高科	28,500	877,230.00	0.34
54	000830	鲁西化工	46,600	872,818.00	0.34
55	002078	太阳纸业	64,300	858,405.00	0.34
56	600563	法拉电子	5,400	855,144.00	0.33
57	600699	均胜电子	33,460	853,899.20	0.33

58	002030	达安基因	40,044	850,534.56	0.33
59	002180	纳思达	26,300	846,860.00	0.33
60	600068	葛洲坝	112,800	844,872.00	0.33
61	600754	锦江酒店	14,800	842,860.00	0.33
62	600486	扬农化工	7,520	840,510.40	0.33
63	002250	联化科技	30,000	837,000.00	0.33
64	300088	长信科技	100,300	828,478.00	0.32
65	600315	上海家化	13,700	823,918.00	0.32
66	000630	铜陵有色	300,700	817,904.00	0.32
67	002507	涪陵榨菜	21,700	817,222.00	0.32
68	600201	生物股份	45,814	799,454.30	0.31
69	002013	中航机电	79,300	798,551.00	0.31
70	000039	中集集团	43,622	793,047.96	0.31
71	002075	沙钢股份	72,000	785,520.00	0.31
72	002127	南极电商	79,600	777,692.00	0.30
73	002028	思源电气	24,920	767,286.80	0.30
74	603605	珀莱雅	3,900	767,169.00	0.30
75	300223	北京君正	7,600	766,992.00	0.30
76	300001	特锐德	25,400	764,794.00	0.30
77	000513	丽珠集团	15,153	757,953.06	0.30
78	601997	贵阳银行	104,400	747,504.00	0.29
79	600177	雅戈尔	113,300	746,647.00	0.29
80	002511	中顺洁柔	26,900	741,095.00	0.29
81	002273	水晶光电	49,729	730,519.01	0.29
82	000021	深科技	38,100	729,234.00	0.29
83	601005	重庆钢铁	271,700	725,439.00	0.28
84	600549	厦门钨业	34,700	722,801.00	0.28
85	002299	圣农发展	30,200	721,176.00	0.28
86	002092	中泰化学	70,002	718,920.54	0.28
87	002080	中材科技	27,400	717,058.00	0.28
88	002603	以岭药业	24,500	714,420.00	0.28
89	002465	海格通信	75,300	712,338.00	0.28
90	300482	万孚生物	10,990	710,943.10	0.28
91	600988	赤峰黄金	47,100	706,029.00	0.28
92	600171	上海贝岭	23,200	705,976.00	0.28
93	000739	普洛药业	24,000	705,600.00	0.28
94	000050	深天马 A	49,500	701,910.00	0.27
95	000825	太钢不锈	93,200	698,068.00	0.27
96	300009	安科生物	46,732	696,306.80	0.27
97	000983	山西焦煤	83,620	694,882.20	0.27
98	600867	通化东宝	58,100	693,714.00	0.27
99	300168	万达信息	47,512	693,675.20	0.27

100	600516	方大炭素	93,200	693,408.00	0.27
101	601128	常熟银行	111,600	691,920.00	0.27
102	600066	宇通客车	55,300	690,697.00	0.27
103	300357	我武生物	10,700	686,084.00	0.27
104	600637	东方明珠	83,500	683,865.00	0.27
105	600536	中国软件	12,000	683,160.00	0.27
106	000998	隆平高科	42,500	681,700.00	0.27
107	300244	迪安诊断	17,780	680,974.00	0.27
108	300618	寒锐钴业	8,600	678,024.00	0.27
109	600316	洪都航空	17,600	677,248.00	0.27
110	300463	迈克生物	15,900	669,231.00	0.26
111	601689	拓普集团	17,870	668,874.10	0.26
112	600418	江淮汽车	53,800	668,734.00	0.26
113	600879	航天电子	88,700	667,024.00	0.26
114	600529	山东药玻	19,600	665,420.00	0.26
115	600909	华安证券	118,790	661,660.30	0.26
116	600827	百联股份	32,800	660,920.00	0.26
117	600369	西南证券	135,700	660,859.00	0.26
118	300070	碧水源	90,300	660,093.00	0.26
119	600487	亨通光电	57,900	660,060.00	0.26
120	000750	国海证券	155,420	658,980.80	0.26
121	002152	广电运通	50,500	658,015.00	0.26
122	600380	健康元	47,796	656,239.08	0.26
123	000723	美锦能源	86,800	656,208.00	0.26
124	000960	锡业股份	40,800	654,024.00	0.26
125	002156	通富微电	27,100	651,484.00	0.26
126	000932	华菱钢铁	98,480	649,968.00	0.25
127	600166	福田汽车	187,700	647,565.00	0.25
128	000975	银泰黄金	67,972	646,413.72	0.25
129	002131	利欧股份	275,609	644,925.06	0.25
130	300271	华宇软件	33,400	642,950.00	0.25
131	300296	利亚德	82,200	642,804.00	0.25
132	600038	中直股份	12,169	641,793.06	0.25
133	603290	斯达半导	2,000	640,000.00	0.25
134	002373	千方科技	38,200	637,940.00	0.25
135	601615	明阳智能	39,200	634,648.00	0.25
136	300383	光环新网	44,000	633,160.00	0.25
137	002572	索菲亚	26,100	631,620.00	0.25
138	002690	美亚光电	11,200	624,512.00	0.24
139	600642	申能股份	100,400	616,456.00	0.24
140	002926	华西证券	63,800	614,394.00	0.24
141	601198	东兴证券	56,200	614,266.00	0.24

142	002065	东华软件	76,300	605,059.00	0.24
143	601866	中远海发	161,200	604,500.00	0.24
144	688029	南微医学	1,938	604,055.22	0.24
145	300115	长盈精密	29,256	602,673.60	0.24
146	002294	信立泰	18,000	592,200.00	0.23
147	688208	道通科技	6,805	591,966.95	0.23
148	600271	航天信息	45,300	590,259.00	0.23
149	002500	山西证券	87,890	589,741.90	0.23
150	603156	养元饮品	20,600	588,748.00	0.23
151	300474	景嘉微	6,000	587,520.00	0.23
152	000623	吉林敖东	37,900	587,071.00	0.23
153	688538	和辉光电	172,571	583,289.98	0.23
154	600998	九州通	37,700	579,449.00	0.23
155	600415	小商品城	111,900	576,285.00	0.23
156	600895	张江高科	31,500	575,505.00	0.23
157	603638	艾迪精密	13,420	575,315.40	0.23
158	601699	潞安环能	48,600	573,966.00	0.22
159	000012	南玻A	55,975	573,184.00	0.22
160	600153	建发股份	69,900	566,190.00	0.22
161	300630	普利制药	10,713	561,361.20	0.22
162	600188	兖州煤业	36,400	559,104.00	0.22
163	600256	广汇能源	165,500	551,115.00	0.22
164	300418	昆仑万维	33,500	548,730.00	0.21
165	600390	五矿资本	91,700	548,366.00	0.21
166	600535	天士力	37,000	547,970.00	0.21
167	600667	太极实业	60,200	547,820.00	0.21
168	300024	机器人	51,000	544,170.00	0.21
169	600008	首创环保	179,720	540,957.20	0.21
170	002670	国盛金控	47,436	540,296.04	0.21
171	002372	伟星新材	26,100	539,487.00	0.21
172	600060	海信视像	31,900	539,110.00	0.21
173	000878	云南铜业	41,700	535,011.00	0.21
174	000027	深圳能源	58,320	534,794.40	0.21
175	002382	蓝帆医疗	25,600	533,760.00	0.21
176	600707	彩虹股份	56,700	533,547.00	0.21
177	600208	新湖中宝	175,300	532,912.00	0.21
178	600155	华创阳安	49,700	531,790.00	0.21
179	600497	驰宏锌锗	123,100	530,561.00	0.21
180	002557	洽洽食品	12,200	525,820.00	0.21
181	603858	步长制药	23,200	521,768.00	0.20
182	002019	亿帆医药	30,200	520,950.00	0.20
183	600372	中航电子	31,400	519,670.00	0.20

184	600765	中航重机	22,900	518,685.00	0.20
185	300251	光线传媒	47,800	516,718.00	0.20
186	002221	东华能源	47,100	515,745.00	0.20
187	600498	烽火通信	27,600	514,188.00	0.20
188	002683	宏大爆破	18,500	513,745.00	0.20
189	000718	苏宁环球	61,800	512,322.00	0.20
190	002174	游族网络	29,800	511,666.00	0.20
191	600409	三友化工	50,500	510,555.00	0.20
192	600511	国药股份	15,400	509,124.00	0.20
193	600141	兴发集团	26,980	508,033.40	0.20
194	600170	上海建工	182,000	502,320.00	0.20
195	002966	苏州银行	68,000	499,800.00	0.20
196	002506	协鑫集成	143,400	499,032.00	0.20
197	002390	信邦制药	47,600	498,848.00	0.20
198	000401	冀东水泥	40,300	497,705.00	0.19
199	600875	东方电气	45,300	496,941.00	0.19
200	000997	新大陆	29,819	494,697.21	0.19
201	002146	荣盛发展	87,700	494,628.00	0.19
202	300058	蓝色光标	81,400	492,470.00	0.19
203	603260	合盛硅业	6,400	492,224.00	0.19
204	601717	郑煤机	42,300	491,949.00	0.19
205	600801	华新水泥	27,872	489,711.04	0.19
206	002408	齐翔腾达	39,181	486,628.02	0.19
207	600160	巨化股份	54,920	485,492.80	0.19
208	002958	青农商行	113,400	485,352.00	0.19
209	000738	航发控制	23,300	485,339.00	0.19
210	000686	东北证券	57,400	485,030.00	0.19
211	600258	首旅酒店	20,320	484,835.20	0.19
212	603866	桃李面包	15,488	483,225.60	0.19
213	300315	掌趣科技	112,300	477,275.00	0.19
214	600663	陆家嘴	35,800	476,856.00	0.19
215	002195	二三四五	233,885	474,786.55	0.19
216	002268	卫士通	24,200	471,416.00	0.18
217	000540	中天金融	171,800	469,014.00	0.18
218	300017	网宿科技	80,100	468,585.00	0.18
219	603707	健友股份	11,200	467,600.00	0.18
220	600325	华发股份	69,270	466,879.80	0.18
221	002831	裕同科技	15,720	466,726.80	0.18
222	000060	中金岭南	102,100	461,492.00	0.18
223	601992	金隅集团	170,000	457,300.00	0.18
224	600027	华电国际	132,900	457,176.00	0.18
225	000961	中南建设	77,100	456,432.00	0.18



226	600567	山鹰国际	131,800	454,710.00	0.18
227	600732	爱旭股份	32,600	453,792.00	0.18
228	600859	王府井	15,675	452,694.00	0.18
229	688321	微芯生物	9,800	452,662.00	0.18
230	688088	虹软科技	8,100	451,575.00	0.18
231	603927	中科软	10,500	450,975.00	0.18
232	603077	和邦生物	216,360	450,028.80	0.18
233	603225	新凤鸣	22,140	449,442.00	0.18
234	601016	节能风电	120,100	449,174.00	0.18
235	000158	常山北明	39,070	448,914.30	0.18
236	002429	兆驰股份	73,900	448,573.00	0.18
237	603712	七一二	12,400	447,640.00	0.18
238	600282	南钢股份	125,500	446,780.00	0.17
239	600500	中化国际	56,420	443,461.20	0.17
240	600216	浙江医药	27,600	441,876.00	0.17
241	002191	劲嘉股份	41,500	441,560.00	0.17
242	601577	长沙银行	49,300	440,742.00	0.17
243	002081	金螳螂	55,600	440,352.00	0.17
244	600528	中铁工业	54,247	439,400.70	0.17
245	603198	迎驾贡酒	9,900	438,570.00	0.17
246	603883	老百姓	8,323	438,455.64	0.17
247	600839	四川长虹	150,500	437,955.00	0.17
248	002595	豪迈科技	16,400	437,880.00	0.17
249	600737	中粮糖业	43,700	437,437.00	0.17
250	300212	易华录	16,240	437,018.40	0.17
251	002056	横店东磁	33,600	436,800.00	0.17
252	000898	鞍钢股份	97,800	435,210.00	0.17
253	000671	阳光城	83,000	431,600.00	0.17
254	600598	北大荒	28,800	430,848.00	0.17
255	000581	威孚高科	20,600	429,098.00	0.17
256	000999	华润三九	16,000	428,000.00	0.17
257	000709	河钢股份	173,300	426,318.00	0.17
258	002203	海亮股份	40,000	425,600.00	0.17
259	600580	卧龙电驱	31,900	424,270.00	0.17
260	600728	佳都科技	57,200	423,852.00	0.17
261	002281	光迅科技	17,100	420,660.00	0.16
262	300182	捷成股份	84,100	419,659.00	0.16
263	600808	马钢股份	97,336	417,571.44	0.16
264	002010	传化智联	54,000	416,340.00	0.16
265	000729	燕京啤酒	57,500	416,300.00	0.16
266	002124	天邦股份	59,080	414,150.80	0.16
267	300166	东方国信	33,178	410,080.08	0.16

268	002396	星网锐捷	19,200	409,920.00	0.16
269	000930	中粮科技	45,400	409,054.00	0.16
270	000488	晨鸣纸业	49,950	406,593.00	0.16
271	600820	隧道股份	76,800	406,272.00	0.16
272	002745	木林森	30,200	404,680.00	0.16
273	002242	九阳股份	12,426	403,720.74	0.16
274	002387	维信诺	38,700	403,641.00	0.16
275	002004	华邦健康	64,850	402,718.50	0.16
276	002048	宁波华翔	20,600	401,700.00	0.16
277	000629	攀钢钒钛	175,300	401,437.00	0.16
278	600755	厦门国贸	48,300	396,543.00	0.16
279	002563	森马服饰	33,100	395,545.00	0.15
280	600970	中材国际	42,600	390,642.00	0.15
281	300002	神州泰岳	80,100	388,485.00	0.15
282	603000	人民网	22,500	386,775.00	0.15
283	600022	山东钢铁	223,770	384,884.40	0.15
284	600398	海澜之家	53,000	383,720.00	0.15
285	600803	新奥股份	23,100	381,381.00	0.15
286	000598	兴蓉环境	73,200	381,372.00	0.15
287	600037	歌华有线	39,600	380,556.00	0.15
288	002925	盈趣科技	9,720	378,205.20	0.15
289	600881	亚泰集团	132,400	377,340.00	0.15
290	600039	四川路桥	59,862	375,334.74	0.15
291	601106	中国一重	110,100	373,239.00	0.15
292	600811	东方集团	121,130	369,446.50	0.14
293	603885	吉祥航空	24,000	366,240.00	0.14
294	601880	辽港股份	213,940	365,837.40	0.14
295	000883	湖北能源	79,600	365,364.00	0.14
296	002002	鸿达兴业	92,908	365,128.44	0.14
297	601456	国联证券	23,700	364,980.00	0.14
298	600348	华阳股份	49,100	364,322.00	0.14
299	000778	新兴铸管	97,900	364,188.00	0.14
300	600782	新钢股份	65,000	362,700.00	0.14
301	000690	宝新能源	70,900	362,299.00	0.14
302	600260	凯乐科技	40,686	361,291.68	0.14
303	600597	光明乳业	25,002	360,278.82	0.14
304	000887	中鼎股份	29,800	359,984.00	0.14
305	002867	周大生	18,100	357,837.00	0.14
306	002701	奥瑞金	69,280	356,099.20	0.14
307	601118	海南橡胶	69,800	355,282.00	0.14
308	600967	内蒙一机	34,797	352,145.64	0.14
309	600908	无锡银行	60,700	352,060.00	0.14

310	002705	新宝股份	13,400	351,750.00	0.14
311	002249	大洋电机	66,900	351,225.00	0.14
312	002085	万丰奥威	62,300	348,880.00	0.14
313	603568	伟明环保	15,279	348,819.57	0.14
314	600410	华胜天成	44,920	348,579.20	0.14
315	600026	中远海能	56,559	348,403.44	0.14
316	600718	东软集团	35,600	348,168.00	0.14
317	600126	杭钢股份	67,830	347,967.90	0.14
318	002183	怡亚通	60,600	347,238.00	0.14
319	600645	中源协和	15,100	346,545.00	0.14
320	000528	柳工	42,199	346,031.80	0.14
321	601179	中国西电	83,500	344,020.00	0.13
322	600985	淮北矿业	28,100	343,101.00	0.13
323	603650	彤程新材	7,100	341,510.00	0.13
324	600572	康恩贝	76,154	338,123.76	0.13
325	002110	三钢闽光	50,150	338,011.00	0.13
326	002368	太极股份	16,758	336,165.48	0.13
327	000877	天山股份	25,700	334,871.00	0.13
328	000970	中科三环	34,800	332,340.00	0.13
329	600446	金证股份	23,000	332,120.00	0.13
330	600329	中新药业	11,800	331,462.00	0.13
331	300072	三聚环保	57,700	331,198.00	0.13
332	600167	联美控股	37,080	331,124.40	0.13
333	000402	金融街	48,900	330,075.00	0.13
334	601200	上海环境	27,470	328,815.90	0.13
335	002266	浙富控股	65,880	328,741.20	0.13
336	002128	露天煤业	31,440	327,290.40	0.13
337	600064	南京高科	35,220	327,193.80	0.13
338	000990	诚志股份	25,600	325,888.00	0.13
339	000089	深圳机场	41,800	324,786.00	0.13
340	601598	中国外运	64,200	324,210.00	0.13
341	002985	北摩高科	3,310	322,725.00	0.13
342	600158	中体产业	27,500	313,775.00	0.12
343	000400	许继电气	24,700	312,702.00	0.12
344	300026	红日药业	73,500	312,375.00	0.12
345	600517	国网英大	45,400	309,174.00	0.12
346	003035	南网能源	30,900	307,146.00	0.12
347	000519	中兵红箭	28,562	306,184.64	0.12
348	300376	易事特	37,800	303,912.00	0.12
349	600120	浙江东方	70,798	303,015.44	0.12
350	601975	招商南油	141,000	301,740.00	0.12
351	000959	首钢股份	53,400	300,108.00	0.12

352	601718	际华集团	106,300	299,766.00	0.12
353	001914	招商积余	17,400	298,932.00	0.12
354	002233	塔牌集团	29,020	298,325.60	0.12
355	600507	方大特钢	43,996	298,292.88	0.12
356	600195	中牧股份	24,800	296,608.00	0.12
357	600307	酒钢宏兴	127,500	295,800.00	0.12
358	000090	天健集团	53,471	295,694.63	0.12
359	000685	中山公用	36,200	295,392.00	0.12
360	600376	首开股份	52,600	294,560.00	0.12
361	601333	广深铁路	138,300	293,196.00	0.11
362	600435	北方导航	36,900	292,986.00	0.11
363	601000	唐山港	120,846	291,238.86	0.11
364	002440	闰土股份	32,600	288,510.00	0.11
365	002505	鹏都农牧	128,570	287,996.80	0.11
366	000559	万向钱潮	53,700	285,147.00	0.11
367	600804	鹏博士	58,500	283,140.00	0.11
368	002839	张家港行	51,700	281,248.00	0.11
369	603228	景旺电子	10,568	276,881.60	0.11
370	600673	东阳光	61,500	276,135.00	0.11
371	300133	华策影视	46,500	275,280.00	0.11
372	600373	中文传媒	27,800	274,108.00	0.11
373	600643	爱建集团	39,250	273,965.00	0.11
374	601860	紫金银行	74,400	270,072.00	0.11
375	000758	中色股份	56,400	267,900.00	0.10
376	601991	大唐发电	101,300	267,432.00	0.10
377	601608	中信重工	71,000	265,540.00	0.10
378	002038	双鹭药业	25,200	265,356.00	0.10
379	000967	盈峰环境	38,600	265,182.00	0.10
380	002155	湖南黄金	34,204	265,081.00	0.10
381	600582	天地科技	67,700	264,030.00	0.10
382	600056	中国医药	21,700	263,655.00	0.10
383	002936	郑州银行	71,460	262,258.20	0.10
384	600266	城建发展	54,958	260,500.92	0.10
385	000563	陕国投 A	80,700	259,854.00	0.10
386	600388	龙净环保	30,400	259,008.00	0.10
387	601098	中南传媒	29,200	257,544.00	0.10
388	601958	金铂股份	39,400	255,312.00	0.10
389	000681	视觉中国	19,691	254,604.63	0.10
390	002416	爱施德	25,380	254,561.40	0.10
391	300113	顺网科技	19,600	253,624.00	0.10
392	300741	华宝股份	5,000	253,600.00	0.10
393	600901	江苏租赁	48,700	253,240.00	0.10

394	600928	西安银行	54,300	253,038.00	0.10
395	600095	湘财股份	21,500	251,765.00	0.10
396	003022	联泓新科	8,200	251,740.00	0.10
397	600062	华润双鹤	21,132	251,682.12	0.10
398	600131	国网信通	19,000	251,560.00	0.10
399	600259	广晟有色	7,400	250,194.00	0.10
400	600959	江苏有线	81,700	249,185.00	0.10
401	300180	华峰超纤	50,300	248,985.00	0.10
402	600649	城投控股	51,800	246,568.00	0.10
403	600094	大名城	64,900	244,673.00	0.10
404	000415	渤海租赁	100,900	244,178.00	0.10
405	600776	东方通信	19,600	243,040.00	0.10
406	002458	益生股份	24,300	242,271.00	0.09
407	002399	海普瑞	15,200	242,136.00	0.09
408	600764	中国海防	8,400	237,720.00	0.09
409	600006	东风汽车	32,500	237,250.00	0.09
410	601611	中国核建	32,400	233,928.00	0.09
411	300257	开山股份	16,200	232,794.00	0.09
412	600546	山煤国际	32,300	231,914.00	0.09
413	600717	天津港	58,958	231,115.36	0.09
414	002317	众生药业	26,700	229,887.00	0.09
415	600633	浙数文化	31,800	228,324.00	0.09
416	600556	天下秀	21,600	228,096.00	0.09
417	000717	韶钢松山	49,500	227,205.00	0.09
418	000028	国药一致	6,000	227,040.00	0.09
419	600021	上海电力	32,700	225,957.00	0.09
420	600729	重庆百货	8,200	225,090.00	0.09
421	600648	外高桥	15,200	224,656.00	0.09
422	002434	万里扬	27,500	223,025.00	0.09
423	601928	凤凰传媒	31,100	222,054.00	0.09
424	000501	鄂武商 A	18,870	220,779.00	0.09
425	600863	内蒙华电	94,500	220,185.00	0.09
426	000078	海王生物	67,400	219,724.00	0.09
427	002375	亚厦股份	27,400	217,008.00	0.08
428	002244	滨江集团	51,700	216,623.00	0.08
429	600968	海油发展	83,000	214,970.00	0.08
430	000062	深圳华强	12,710	214,926.10	0.08
431	601828	美凯龙	17,900	214,800.00	0.08
432	002424	贵州百灵	28,800	211,968.00	0.08
433	603355	莱克电气	3,400	211,582.00	0.08
434	600835	上海机电	13,000	211,250.00	0.08
435	605358	立昂微	1,800	208,044.00	0.08

436	000869	张裕A	5,500	204,270.00	0.08
437	600623	华谊集团	22,900	201,749.00	0.08
438	600566	济川药业	11,000	196,900.00	0.08
439	600377	宁沪高速	20,100	196,176.00	0.08
440	600339	中油工程	68,400	194,256.00	0.08
441	600312	平高电气	33,200	193,888.00	0.08
442	600787	中储股份	36,000	191,880.00	0.08
443	002468	申通快递	25,000	190,500.00	0.07
444	000031	大悦城	52,500	189,000.00	0.07
445	600639	浦东金桥	13,800	188,370.00	0.07
446	000826	启迪环境	35,100	187,785.00	0.07
447	002583	海能达	37,200	187,488.00	0.07
448	600823	世茂股份	45,800	185,032.00	0.07
449	601778	晶科科技	33,800	184,548.00	0.07
450	601969	海南矿业	15,800	183,754.00	0.07
451	600466	蓝光发展	61,820	182,369.00	0.07
452	603888	新华网	8,450	178,886.50	0.07
453	603317	天味食品	6,064	178,463.52	0.07
454	601298	青岛港	28,700	177,366.00	0.07
455	002815	崇达技术	14,200	177,216.00	0.07
456	002532	天山铝业	21,000	176,190.00	0.07
457	000156	华数传媒	22,600	174,246.00	0.07
458	603708	家家悦	10,000	173,700.00	0.07
459	000937	冀中能源	43,400	170,562.00	0.07
460	002635	安洁科技	11,583	169,459.29	0.07
461	002948	青岛银行	33,800	167,986.00	0.07
462	000813	德展健康	36,700	166,618.00	0.07
463	000553	安道麦A	17,900	165,933.00	0.06
464	300010	豆神教育	28,600	162,162.00	0.06
465	601228	广州港	50,700	161,226.00	0.06
466	002302	西部建设	20,400	161,160.00	0.06
467	600350	山东高速	25,500	156,825.00	0.06
468	603377	东方时尚	14,648	156,587.12	0.06
469	600640	号百控股	12,800	156,032.00	0.06
470	603515	欧普照明	6,020	154,533.40	0.06
471	601139	深圳燃气	23,400	153,504.00	0.06
472	000061	农产品	27,800	153,456.00	0.06
473	600871	石化油服	77,800	153,266.00	0.06
474	001872	招商港口	8,800	148,896.00	0.06
475	000046	泛海控股	63,500	146,050.00	0.06
476	603786	科博达	1,900	143,450.00	0.06
477	300957	贝泰妮	562	141,601.52	0.06

478	601568	北元集团	16,300	139,528.00	0.05
479	002901	大博医疗	1,900	138,491.00	0.05
480	002653	海思科	6,400	137,728.00	0.05
481	603056	德邦股份	12,400	136,276.00	0.05
482	603379	三美股份	7,240	135,460.40	0.05
483	002419	天虹股份	19,800	129,888.00	0.05
484	600657	信达地产	35,100	122,148.00	0.05
485	601003	柳钢股份	20,600	121,540.00	0.05
486	000537	广宇发展	22,800	119,244.00	0.05
487	601869	长飞光纤	4,800	116,928.00	0.05
488	601512	中新集团	11,700	116,532.00	0.05
489	603983	丸美股份	2,200	114,642.00	0.04
490	601801	皖新传媒	24,200	114,224.00	0.04
491	601187	厦门银行	11,800	111,864.00	0.04
492	002946	新乳业	7,000	106,050.00	0.04
493	603719	良品铺子	2,300	103,500.00	0.04
494	600917	重庆燃气	12,500	102,125.00	0.04
495	603868	飞科电器	2,100	88,326.00	0.03
496	600903	贵州燃气	9,340	85,928.00	0.03
497	000732	泰禾集团	38,198	82,507.68	0.03
498	300979	华利集团	925	80,937.50	0.03
499	688314	康拓医疗	1,085	80,810.80	0.03
500	002818	富森美	6,040	72,842.40	0.03
501	002423	中粮资本	7,500	67,875.00	0.03
502	600956	新天绿能	5,600	65,576.00	0.03
503	603256	宏和科技	7,000	63,980.00	0.03
504	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.02
505	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.02
506	601068	中铝国际	12,800	44,160.00	0.02
507	300973	立高食品	360	41,655.60	0.02
508	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.01
509	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.01
510	300941	创识科技	399	19,926.06	0.01
511	300932	三友联众	492	15,601.32	0.01
512	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.01
513	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.01
514	300940	南极光	307	13,317.66	0.01
515	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.01
516	300937	药易购	244	13,105.24	0.01
517	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
518	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
519	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00

520	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
521	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
522	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
523	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
524	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
525	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
526	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
527	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
528	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
529	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
530	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
531	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
532	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
533	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
534	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
535	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
536	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
537	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
538	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
539	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
540	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
541	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
542	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
543	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
544	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
545	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
546	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
547	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
548	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
549	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	603486	科沃斯	3,047,103.00	0.38
2	688002	睿创微纳	2,589,476.83	0.32
3	688099	晶晨股份	2,534,926.50	0.31
4	603589	口子窖	2,513,434.00	0.31
5	000799	酒鬼酒	2,249,262.00	0.28
6	601799	星宇股份	2,071,710.00	0.26



7	603345	安井食品	1,880,635.40	0.23
8	002791	坚朗五金	1,779,287.86	0.22
9	603816	顾家家居	1,740,788.00	0.22
10	601865	福莱特	1,379,255.00	0.17
11	688088	虹软科技	1,376,234.74	0.17
12	603444	吉比特	1,297,424.00	0.16
13	688321	微芯生物	1,198,293.50	0.15
14	603638	艾迪精密	1,162,200.32	0.14
15	601636	旗滨集团	1,157,588.00	0.14
16	600089	特变电工	1,139,347.87	0.14
17	300253	卫宁健康	1,127,948.00	0.14
18	603806	福斯特	1,089,133.00	0.13
19	300037	新宙邦	1,076,364.00	0.13
20	601689	拓普集团	1,073,088.00	0.13

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	300274	阳光电源	14,248,061.46	1.76
2	300012	华测检测	8,121,160.00	1.00
3	300595	欧普康视	6,420,837.63	0.79
4	300496	中科创达	6,330,464.25	0.78
5	603345	安井食品	5,235,351.60	0.65
6	002709	天赐材料	5,184,510.00	0.64
7	002340	格林美	4,642,359.00	0.57
8	002568	百润股份	4,571,487.40	0.56
9	002791	坚朗五金	4,518,216.00	0.56
10	300285	国瓷材料	4,339,703.08	0.54
11	002074	国轩高科	3,847,865.90	0.48
12	300207	欣旺达	3,339,981.00	0.41
13	002185	华天科技	3,229,535.00	0.40
14	300146	汤臣倍健	3,115,960.00	0.38
15	000009	中国宝安	3,098,497.00	0.38
16	300357	我武生物	3,067,165.44	0.38
17	603444	吉比特	3,003,018.00	0.37
18	603486	科沃斯	2,935,830.00	0.36
19	300316	晶盛机电	2,926,473.81	0.36
20	002920	德赛西威	2,917,471.00	0.36

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	144,628,045.16
卖出股票收入（成交）总额	463,323,221.87

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）	66,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	66,000.00	0.03

#### 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	113051	节能转债	660	66,000.00	0.03

#### 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	107,795.14
2	应收证券清算款	50,795.16
3	应收股利	-
4	应收利息	2,212.55
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-426.00
9	合计	160,376.85

#### 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

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	600460	士兰微	1,808,835.00	0.71	重大事项停牌

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
426	399,809.12	168,688,295.00	99.04	1,630,392.00	0.96

### 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	中信证券股份有限公司	2,402,009.00	1.41
2	姜晓平	235,683.00	0.14
3	张红艳	197,700.00	0.12
4	陈妙琴	139,373.00	0.08
5	朱庆芳	115,758.00	0.07
6	李淑清	69,455.00	0.04
7	钮冰融	46,303.00	0.03
8	刘秀珍	46,303.00	0.03
9	卢泓名	44,100.00	0.03
10	陈志伟	27,900.00	0.02
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基	166,286,286.00	97.63

注：表中前十名持有人为除国寿安保中证 500ETF 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（2015年5月29日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	588,318,687.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	422,000,000.00
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	170,318,687.00
-------------	----------------

## § 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

本基金自基金合同生效日起聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

					总量的比例	
海通证券	2	303,804,613.40	50.53%	282,936.88	50.59%	-
国泰君安	2	290,242,254.40	48.27%	270,303.51	48.33%	-
中信证券	2	4,152,382.11	0.69%	3,867.07	0.69%	-
长城证券	2	3,034,731.99	0.50%	2,219.33	0.40%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	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，我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后，向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)综合实力较强、市场信誉良好；
- (2)财务状况良好，经营状况稳健；
- (3)经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4)研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；
- (5)具有丰富的投行资源和大宗交易信息，愿意积极为我公司提供相关投资机会，能够对公司业务发展形成支持；
- (6)具有费率优势，具备支持交易的安全、稳定、便捷、高效的通讯条件和交易环境，能提供全面的交易信息服务；
- (7)从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；
- (2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

## 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	38,445.10	4.31%	-	-	-	-
国泰君安	831,290.97	93.20%	-	-	-	-
中信证券	22,168.00	2.49%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
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	国寿安保中证 500 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	国寿安保中证 500 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
3	国寿安保中证 500 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
4	关于国寿安保中证 500 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
5	国寿安保中证 500 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
6	国寿安保中证 500 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
7	国寿安保中证 500 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 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	持有基金份额比	期初	申购	赎回	持有份额

	号	例达到或者超过 20%的时间区间	份额	份额	份额		占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20210101~20210630	585,486,286.00	2,800,000.00	422,000,000.00	166,286,286.00	97.63

#### 产品特有风险

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。

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。

## 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中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保中证 500 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 报告期内国寿安保中证 500 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](http://www.gsfunds.com.cn)

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258



国寿安保基金管理有限公司

2021 年 8 月 31 日