

国寿安保沪深 300 交易型开放式
指数证券投资基金
2024 年中期报告

2024 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：2024 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 2024 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 2024 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
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
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	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	10
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	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 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	33
7.1 期末基金资产组合情况	33
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	34
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	43

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	43
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	43
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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43
7.12 投资组合报告附注	44
§8 基金份额持有人信息	45
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
8.2 期末上市基金前十名持有人	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	45
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	45
§9 开放式基金份额变动	46
§10 重大事件揭示	46
10.1 基金份额持有人大会决议	46
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	46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	46
10.4 基金投资策略的改变	46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	46
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	46
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	47
10.8 其他重大事件	48
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	49
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 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	1,515,802,400.00 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	韩占锋	任航
	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	北京市西城区复兴门内大街 28

	盈泰商务中心 2 号楼 11 层	号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码	100033	100031
法定代表人	于泳	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(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-22,580,533.04
本期利润	16,039,298.17
加权平均基金份额本期利润	0.0116
本期加权平均净值利润率	1.19%
本期基金份额净值增长率	1.74%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-35,992,504.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0237
期末基金资产净值	1,479,809,895.89
期末基金份额净值	0.9763
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-2.37%

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

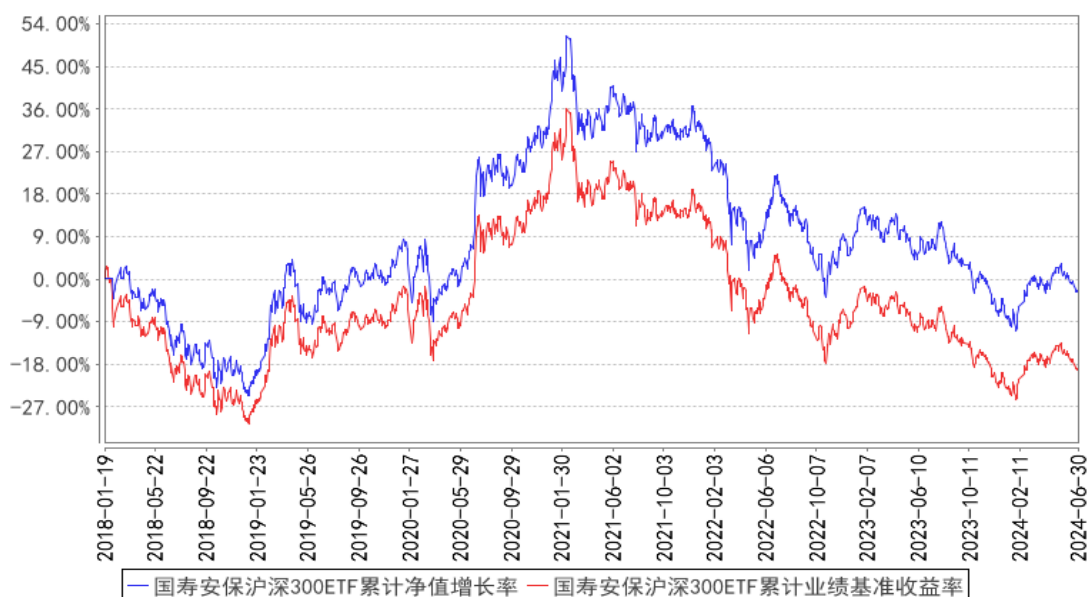
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-2.56%	0.48%	-3.30%	0.48%	0.74%	0.00%

过去三个月	-1.16%	0.75%	-2.14%	0.76%	0.98%	-0.01%
过去六个月	1.74%	0.89%	0.89%	0.90%	0.85%	-0.01%
过去一年	-8.23%	0.87%	-9.91%	0.87%	1.68%	0.00%
过去三年	-29.55%	1.04%	-33.74%	1.05%	4.19%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-2.37%	1.20%	-18.96%	1.22%	16.59%	-0.02%

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 2024 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可(2013)1308号文核准,于2013年10月29日设立,公司注册资本12.88亿元人民币,公司股东为中国人寿资产管理有

限公司，其持有股份85.03%，National Mutual Funds Management Ltd.（国家共同基金管理有限公司），其持有股份14.97%。

截至2024年6月30日，公司共管理102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3790.84亿元，其中公募证券投资基金管理规模为3101.27亿元。

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	-	15年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，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、国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数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联接基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3日内、5日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了T分布检验。经分析，本报告期未发现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

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0.9763元；本报告期基金份额净值增长率为1.74%，业绩比较基准收益率为0.89%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年权益市场表现一般，上证指数、沪深300指数、中证500指数和创业板指分别下跌0.25%，上涨0.89%，下跌8.96%，下跌10.99%。风格方面大市值明显占优，按申万行业划分来看，银行、煤炭和公共事业等代表的高股息大盘蓝筹上市公司获得青睐，计算机、商贸、社服等表现一般。

展望下半年，中国经济展现了较强的韧性，高质量发展成效显著，结合全年经济社会发展目标来看，扩大内需等政策有望持续发力，带动相关产业链进一步修复。流动性方面利率处于下行通道，北向和保险资金有望带来边际增量。外部因素方面，美国大选和地缘政治可能对市场有阶段性扰动，通胀数据回落和劳动力市场疲软，市场

对美国经济的衰退预期提升，联储逐步进入降息周期后，有利于汇率压力释放和政策空间打开。整体上看，历史数据显示当前股债收益差处于高性价比区间，A股市场具有中长期配置价值，其中无风险利率下行背景下的红利资产，代表未来产业发展的新质生产力和受益扩大内需政策的行业投资机会相对显著。

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

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、研究部负责人以及各投资部门负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经历。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分别签署服务协议，其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据，中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

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2024年01月01日至2024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合规守信、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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	11,726,532.41	6,064,152.18
结算备付金		74,820.86	71,232.18
存出保证金		124,764.89	24,490.16
交易性金融资产	6.4.7.2	1,470,125,122.88	1,302,855,346.71
其中：股票投资		1,470,125,122.88	1,302,855,346.71
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	10,891,818.37
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	15,934.54
资产总计		1,482,051,241.04	1,319,922,974.14
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		-	-
应付清算款		1,054,420.18	13,935,677.84
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		597,373.76	474,301.17
应付托管费		119,474.78	94,860.24
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	2,058.71
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	470,076.43	504,722.98
负债合计		2,241,345.15	15,011,620.94
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	1,515,802,400.00	1,359,802,400.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-35,992,504.11	-54,891,046.80
净资产合计		1,479,809,895.89	1,304,911,353.20
负债和净资产总计		1,482,051,241.04	1,319,922,974.14

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额净值 0.9763 元，基金份额总额 1,515,802,400.00 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至	上年度可比期间 2023年1月1日至
-----	-----	------------------	-----------------------

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		20,356,122.20	3,693,223.87
1. 利息收入		146,847.48	206,772.39
其中：存款利息收入	6.4.7.13	26,816.26	15,673.54
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		120,031.22	191,098.85
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-18,223,200.73	3,148,736.01
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-34,891,451.40	-10,435,837.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	63,981.42
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	16,668,250.67	13,520,591.59
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	38,619,831.21	345,699.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-187,355.76	-7,984.13
减：二、营业总支出		4,316,824.03	3,707,500.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	3,335,143.35	2,853,882.01
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	667,028.69	570,776.41
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		432.12	688.19
8. 其他费用	6.4.7.23	314,219.87	282,153.54
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		16,039,298.17	-14,276.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		16,039,298.17	-14,276.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		16,039,298.17	-14,276.28

6.3 净资产变动表

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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,359,802,400.00	-	-54,891,046.80	1,304,911,353.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,359,802,400.00	-	-54,891,046.80	1,304,911,353.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	156,000,000.00	-	18,898,542.69	174,898,542.69
（一）、综合收益总额	-	-	16,039,298.17	16,039,298.17
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	156,000,000.00	-	2,859,244.52	158,859,244.52
其中：1. 基金申购款	315,000,000.00	-	-4,674,108.40	310,325,891.60
2. 基金赎回款	-159,000,000.00	-	7,533,352.92	-151,466,647.08
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,515,802,400.00	-	-35,992,504.11	1,479,809,895.89
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,029,802,400.00	-	63,586,412.01	1,093,388,812.01
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,029,802,400.00	-	63,586,412.01	1,093,388,812.01
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	27,000,000.00	-	3,788,145.93	30,788,145.93
(一)、综合收益总额	-	-	-14,276.28	-14,276.28
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	27,000,000.00	-	3,802,422.21	30,802,422.21
其中：1. 基金申购款	87,000,000.00	-	9,336,361.01	96,336,361.01
2. 基金赎回款	-60,000,000.00	-	-5,533,938.80	-65,533,938.80
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,056,802,400.00	-	67,374,557.94	1,124,176,957.94

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：

鄂华

王文英

于晓树

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》注册，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(以下简称“国寿安保”)，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“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

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《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》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、

地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	11,726,532.41
等于：本金	11,724,360.81
加：应计利息	2,171.60
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-

合计	11,726,532.41
----	---------------

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,580,309,920.78	-	1,470,125,122.88	-110,184,797.90
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,580,309,920.78	-	1,470,125,122.88	-110,184,797.90

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 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 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	-
应付交易费用	160,569.47
其中：交易所市场	160,569.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,398.38
应付指数使用费	200,108.58
合计	470,076.43

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,359,802,400.00	1,359,802,400.00
本期申购	315,000,000.00	315,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-159,000,000.00	-159,000,000.00
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	1,515,802,400.00	1,515,802,400.00

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 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	579,557,570.30	-634,448,617.10	-54,891,046.80
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	579,557,570.30	-634,448,617.10	-54,891,046.80
本期利润	-22,580,533.04	38,619,831.21	16,039,298.17
本期基金份额交易产生的变动数	62,995,989.15	-60,136,744.63	2,859,244.52
其中：基金申购款	128,947,035.90	-133,621,144.30	-4,674,108.40
基金赎回款	-65,951,046.75	73,484,399.67	7,533,352.92
本期已分配利润	-	-	-

本期末	619,973,026.41	-655,965,530.52	-35,992,504.11
-----	----------------	-----------------	----------------

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入	22,889.09	
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	3,155.88	
其他	771.29	
合计	26,816.26	

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	-27,744,699.21	
股票投资收益——赎回差价收入	-7,146,752.19	
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	-34,891,451.40	

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额	130,776,160.98	
减：卖出股票成本总额	158,129,637.51	
减：交易费用	391,222.68	
买卖股票差价收入	-27,744,699.21	

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
赎回基金份额对价总额	151,466,647.08	
减：现金支付赎回款总额	54,145,422.08	
减：赎回股票成本总额	104,467,977.19	
减：交易费用	-	
赎回差价收入	-7,146,752.19	

6.4.7.15 债券投资收益

本基金于本报告期间无债券投资产生的收益/损失。

6.4.7.16 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。

6.4.7.17 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。

6.4.7.18 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	16,668,250.67
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,668,250.67

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	38,619,831.21
股票投资	38,619,831.21
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	38,619,831.21

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日

基金赎回费收入	-
替代损益	-187,355.76
合计	-187,355.76

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代成分证券的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	4,712.91
指数使用费	200,108.58
合计	314,219.87

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本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
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	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均未通过关联方交易单元进行交易。

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,335,143.35	2,853,882.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	3,335,143.35	2,853,882.01

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	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	667,028.69	570,776.41

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

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均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 2024年6月30日		上年度末 2023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	1,433,249,900.00	94.55	1,286,249,900.00	94.59

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023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	11,726,532.41	22,889.09	7,921,511.34	13,898.28

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，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

于 2024 年 06 月 30 日，本基金持有 2,643,400.00 股农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 9,712,648.11 元，估值总额为人民币 11,525,224.00 元，占基金资产净值的比例为 0.78%；持有 137,900.00 股中国人寿的普通股，成本总额为人民币 4,106,842.07 元，估值总额为人民币 4,281,795.00 元，占基金资产净值的比例为 0.29%。

于 2023 年 12 月 31 日，本基金持有 2,392,500.00 股农业银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 8,388,124.98 元，估值总额为人民币 8,708,700.00 元，占基金资产净值的比例为 0.67%；持有 125,400.00 股中国人寿的普通股，成本总额为人民币 3,732,244.38 元，估值总额为人民币 3,555,090.00 元，占基金资产净值的比例为 0.27%。

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（2024 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	受限期	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
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	5日	新股未上市	18.65	18.65	1,158	21,596.70	21,596.70	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	6个月	新股流通受限	18.65	18.65	129	2,405.85	2,405.85	-

603350	安乃达	2024年6月26日	5日	新股未上市	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024年6月26日	6个月	新股流通受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603381	永臻股份	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
688692	达梦数据	2024年6月4日	6个月	新股流通受限	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

3、基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起12个月内不得转让。

4、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有因暂时停牌等而流通受限的证券。

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

无。

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。

本基金管理人建立了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。董事会负责公司整体风险的预防和控制，确定公司风险战略，审核、监督公司风险控制制度的有效执行，对有效的风险管理承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查。监事会对董事会、管理层履职情况进行监督。管理层对有效的风险管理承担直接责任，保证风险管理体系的持续有效运转，使公司风险管理的战略和政策要求及其各方面的具体工作落到实处。公司设督察长一名，负责牵头开展风险管理工作，监督检查公司内部风险控制情况，参与各项决策的风险评估及审批。公司设立合规管理部、监察稽核部两个独立的风险管理职能部门，由督察长领导，对督察长负责，并向督察长汇报工作。

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的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。本基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人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。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关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，因此除附注 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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未来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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	11,726,532.41	-	-	-	11,726,532.41
结算备付金	74,820.86	-	-	-	74,820.86
存出保证金	124,764.89	-	-	-	124,764.89
交易性金融资产	-	-	-	1,470,125,122.88	1,470,125,122.88
资产总计	11,926,118.16	-	-	1,470,125,122.88	1,482,051,241.04
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	597,373.76	597,373.76
应付托管费	-	-	-	119,474.78	119,474.78
应付清算款	-	-	-	1,054,420.18	1,054,420.18
其他负债	-	-	-	470,076.43	470,076.43
负债总计	-	-	-	2,241,345.15	2,241,345.15
利率敏感度缺口	11,926,118.16	-	-	1,467,883,777.73	1,479,809,895.89
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,064,152.18	-	-	-	6,064,152.18
结算备付金	71,232.18	-	-	-	71,232.18
存出保证金	24,490.16	-	-	-	24,490.16
交易性金融资产	-	-	-	1,302,855,346.71	1,302,855,346.71
应收清算款	-	-	-	10,891,818.37	10,891,818.37
其他资产	-	-	-	15,934.54	15,934.54
资产总计	6,159,874.52	-	-	1,313,763,099.62	1,319,922,974.14
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	474,301.17	474,301.17
应付托管费	-	-	-	94,860.24	94,860.24
应付清算款	-	-	-	13,935,677.84	13,935,677.84
应交税费	-	-	-	2,058.71	2,058.71
其他负债	-	-	-	504,722.98	504,722.98
负债总计	-	-	-	15,011,620.94	15,011,620.94
利率敏感度缺口	6,159,874.52	-	-	1,298,751,478.68	1,304,911,353.20

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 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券投资（2023 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2023 年 12 月 31 日：同）。

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。本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股，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 2024年6月30日		上年度末 2023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	1,470,125,122.88	99.35	1,302,855,346.71	99.84
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	1,470,125,122.88	99.35	1,302,855,346.71	99.84

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。		
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（2024 年 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
	+5%	73,455,718.35	64,915,822.19
	-5%	-73,455,718.35	-64,915,822.19

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 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	1,470,017,613.24	1,302,855,346.71

第二层次	45,611.11	-
第三层次	61,898.53	-
合计	1,470,125,122.88	1,302,855,346.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	1,470,125,122.88	99.20
	其中：股票	1,470,125,122.88	99.20
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	11,801,353.27	0.80
8	其他各项资产	124,764.89	0.01
9	合计	1,482,051,241.04	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	18,592,990.00	1.26
B	采矿业	89,577,420.62	6.05
C	制造业	765,638,025.10	51.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,008,078.64	4.66
E	建筑业	32,895,703.36	2.22
F	批发和零售业	3,786,410.79	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	55,092,034.46	3.72
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,405,815.73	4.49
J	金融业	328,170,585.71	22.18
K	房地产业	13,525,717.00	0.91
L	租赁和商务服务业	11,806,024.39	0.80
M	科学研究和技术服务业	11,641,403.88	0.79
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,984,913.20	0.27
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,470,125,122.88	99.35

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

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	52,018	76,330,693.02	5.16
2	300750	宁德时代	218,460	39,329,353.80	2.66
3	601318	中国平安	890,807	36,843,777.52	2.49
4	600036	招商银行	1,024,676	35,033,672.44	2.37

5	600900	长江电力	1,013,040	29,297,116.80	1.98
6	000333	美的集团	404,100	26,064,450.00	1.76
7	601899	紫金矿业	1,363,186	23,951,178.02	1.62
8	601166	兴业银行	1,203,425	21,204,348.50	1.43
9	000858	五粮液	160,601	20,563,352.04	1.39
10	002594	比亚迪	75,026	18,775,256.50	1.27
11	601328	交通银行	2,274,900	16,993,503.00	1.15
12	601398	工商银行	2,901,500	16,538,550.00	1.12
13	002475	立讯精密	416,005	16,353,156.55	1.11
14	600030	中信证券	808,345	14,736,129.35	1.00
15	000651	格力电器	373,014	14,629,609.08	0.99
16	300760	迈瑞医疗	50,200	14,603,682.00	0.99
17	600276	恒瑞医药	369,828	14,223,584.88	0.96
18	600887	伊利股份	526,801	13,612,537.84	0.92
19	600309	万华化学	155,998	12,613,998.28	0.85
20	000725	京东方 A	3,057,600	12,505,584.00	0.85
21	601088	中国神华	273,162	12,120,197.94	0.82
22	601288	农业银行	2,643,400	11,525,224.00	0.78
23	300059	东方财富	1,044,890	11,034,038.40	0.75
24	601816	京沪高铁	2,032,300	10,913,451.00	0.74
25	300308	中际旭创	74,240	10,236,211.20	0.69
26	002714	牧原股份	226,290	9,866,244.00	0.67
27	601857	中国石油	938,000	9,680,160.00	0.65
28	002415	海康威视	308,800	9,545,008.00	0.65
29	601668	中国建筑	1,721,700	9,142,227.00	0.62
30	600919	江苏银行	1,216,000	9,034,880.00	0.61
31	601138	工业富联	328,900	9,011,860.00	0.61
32	600690	海尔智家	313,412	8,894,632.56	0.60
33	000568	泸州老窖	60,900	8,738,541.00	0.59
34	300498	温氏股份	440,300	8,726,746.00	0.59
35	600809	山西汾酒	40,398	8,519,130.24	0.58
36	002371	北方华创	26,300	8,413,107.00	0.57
37	601985	中国核电	781,200	8,327,592.00	0.56
38	600406	国电南瑞	332,274	8,293,559.04	0.56
39	601225	陕西煤业	321,300	8,279,901.00	0.56
40	603259	药明康德	208,992	8,190,396.48	0.55
41	601919	中远海控	528,280	8,183,057.20	0.55
42	000001	平安银行	803,000	8,150,450.00	0.55
43	600031	三一重工	491,400	8,108,100.00	0.55
44	601988	中国银行	1,743,200	8,053,584.00	0.54
45	600941	中国移动	74,667	8,026,702.50	0.54
46	600000	浦发银行	971,498	7,995,428.54	0.54
47	300124	汇川技术	155,150	7,959,195.00	0.54

48	601728	中国电信	1,285,100	7,903,365.00	0.53
49	601601	中国太保	283,309	7,892,988.74	0.53
50	000792	盐湖股份	449,500	7,843,775.00	0.53
51	600028	中国石化	1,208,000	7,634,560.00	0.52
52	601766	中国中车	1,007,200	7,564,072.00	0.51
53	600150	中国船舶	185,200	7,539,492.00	0.51
54	688981	中芯国际	163,400	7,532,740.00	0.51
55	300274	阳光电源	120,120	7,451,043.60	0.50
56	600050	中国联通	1,578,300	7,418,010.00	0.50
57	000063	中兴通讯	263,900	7,381,283.00	0.50
58	000338	潍柴动力	449,000	7,291,760.00	0.49
59	002352	顺丰控股	202,400	7,223,656.00	0.49
60	601169	北京银行	1,224,724	7,152,388.16	0.48
61	601012	隆基绿能	501,768	7,034,787.36	0.48
62	603501	韦尔股份	70,478	7,003,398.86	0.47
63	600837	海通证券	798,600	6,836,016.00	0.46
64	000100	TCL 科技	1,556,150	6,722,568.00	0.45
65	600016	民生银行	1,761,300	6,675,327.00	0.45
66	002230	科大讯飞	153,100	6,575,645.00	0.44
67	600660	福耀玻璃	132,700	6,356,330.00	0.43
68	002142	宁波银行	273,150	6,025,689.00	0.41
69	601229	上海银行	822,635	5,972,330.10	0.40
70	600089	特变电工	418,200	5,800,434.00	0.39
71	600938	中国海油	173,200	5,715,600.00	0.39
72	601390	中国中铁	850,900	5,547,868.00	0.37
73	000625	长安汽车	411,410	5,525,236.30	0.37
74	688041	海光信息	77,016	5,415,765.12	0.37
75	600104	上汽集团	383,537	5,315,822.82	0.36
76	603986	兆易创新	55,189	5,277,172.18	0.36
77	601688	华泰证券	424,160	5,255,342.40	0.36
78	601006	大秦铁路	728,000	5,212,480.00	0.35
79	600048	保利发展	594,600	5,208,696.00	0.35
80	600905	三峡能源	1,186,400	5,172,704.00	0.35
81	600436	片仔癀	24,900	5,158,533.00	0.35
82	002027	分众传媒	838,040	5,078,522.40	0.34
83	688012	中微公司	35,900	5,071,234.00	0.34
84	601211	国泰君安	372,649	5,049,393.95	0.34
85	601888	中国中免	80,751	5,046,129.99	0.34
86	603019	中科曙光	121,140	5,027,310.00	0.34
87	601600	中国铝业	657,300	5,015,199.00	0.34
88	603993	洛阳钼业	585,500	4,976,750.00	0.34
89	601818	光大银行	1,538,300	4,876,411.00	0.33
90	600019	宝钢股份	731,796	4,866,443.40	0.33

91	603288	海天味业	138,315	4,767,718.05	0.32
92	600585	海螺水泥	198,954	4,693,324.86	0.32
93	601658	邮储银行	919,800	4,663,386.00	0.32
94	601989	中国重工	942,800	4,648,004.00	0.31
95	600886	国投电力	246,900	4,503,456.00	0.30
96	601009	南京银行	428,601	4,453,164.39	0.30
97	600795	国电电力	738,500	4,423,615.00	0.30
98	688111	金山办公	19,157	4,358,217.50	0.29
99	688008	澜起科技	75,592	4,320,838.72	0.29
100	601628	中国人寿	137,900	4,281,795.00	0.29
101	600999	招商证券	307,250	4,273,847.50	0.29
102	600438	通威股份	223,500	4,271,085.00	0.29
103	000938	紫光股份	189,318	4,231,257.30	0.29
104	000425	徐工机械	586,000	4,189,900.00	0.28
105	601939	建设银行	555,600	4,111,440.00	0.28
106	600547	山东黄金	149,532	4,094,186.16	0.28
107	300014	亿纬锂能	101,600	4,055,872.00	0.27
108	600893	航发动力	110,100	4,024,155.00	0.27
109	002304	洋河股份	49,800	4,020,852.00	0.27
110	002179	中航光电	105,314	4,007,197.70	0.27
111	601669	中国电建	714,024	3,991,394.16	0.27
112	300015	爱尔眼科	386,135	3,984,913.20	0.27
113	000002	万科A	562,900	3,900,897.00	0.26
114	002241	歌尔股份	197,600	3,855,176.00	0.26
115	600926	杭州银行	294,966	3,849,306.30	0.26
116	000538	云南白药	73,841	3,776,967.15	0.26
117	600584	长电科技	118,700	3,763,977.00	0.25
118	600760	中航沈飞	91,396	3,664,979.60	0.25
119	600111	北方稀土	209,200	3,598,240.00	0.24
120	600489	中金黄金	241,100	3,568,280.00	0.24
121	002050	三花智控	185,738	3,543,881.04	0.24
122	600011	华能国际	364,082	3,502,468.84	0.24
123	002252	上海莱士	441,000	3,448,620.00	0.23
124	601916	浙商银行	1,246,400	3,440,064.00	0.23
125	688256	寒武纪	17,200	3,417,124.00	0.23
126	600015	华夏银行	526,033	3,366,611.20	0.23
127	600009	上海机场	102,863	3,317,331.75	0.22
128	600958	东方证券	433,156	3,291,985.60	0.22
129	600426	华鲁恒升	122,900	3,274,056.00	0.22
130	601186	中国铁建	380,100	3,257,457.00	0.22
131	002311	海大集团	69,000	3,246,450.00	0.22
132	300408	三环集团	110,900	3,237,171.00	0.22
133	000166	申万宏源	746,900	3,219,139.00	0.22

134	601901	方正证券	409,194	3,163,069.62	0.21
135	600989	宝丰能源	182,200	3,157,526.00	0.21
136	000157	中联重科	410,900	3,155,712.00	0.21
137	000977	浪潮信息	85,341	3,103,852.17	0.21
138	600674	川投能源	161,200	3,022,500.00	0.20
139	003816	中国广核	651,700	3,017,371.00	0.20
140	300433	蓝思科技	164,999	3,011,231.75	0.20
141	688271	联影医疗	27,300	2,994,810.00	0.20
142	000776	广发证券	245,200	2,984,084.00	0.20
143	002049	紫光国微	56,316	2,962,221.60	0.20
144	002001	新和成	153,400	2,945,280.00	0.20
145	601377	兴业证券	572,450	2,896,597.00	0.20
146	688036	传音控股	37,362	2,859,687.48	0.19
147	000596	古井贡酒	13,500	2,849,445.00	0.19
148	601111	中国国航	385,400	2,844,252.00	0.19
149	600115	中国东航	706,900	2,834,669.00	0.19
150	300122	智飞生物	98,900	2,772,167.00	0.19
151	000768	中航西飞	115,300	2,770,659.00	0.19
152	002460	赣锋锂业	93,430	2,676,769.50	0.18
153	001979	招商蛇口	300,000	2,637,000.00	0.18
154	601800	中国交建	294,100	2,629,254.00	0.18
155	600029	南方航空	445,918	2,626,457.02	0.18
156	600010	宝钢股份	1,875,040	2,625,056.00	0.18
157	601633	长城汽车	103,200	2,610,960.00	0.18
158	600188	兖矿能源	114,250	2,596,902.50	0.18
159	002466	天齐锂业	85,700	2,563,287.00	0.17
160	002601	龙佰集团	138,000	2,562,660.00	0.17
161	002236	大华股份	163,900	2,533,894.00	0.17
162	002648	卫星化学	139,620	2,510,367.60	0.17
163	601117	中国化学	304,200	2,506,608.00	0.17
164	603799	华友钴业	112,426	2,487,987.38	0.17
165	000786	北新建材	83,800	2,485,508.00	0.17
166	000661	长春高新	26,900	2,468,613.00	0.17
167	002493	荣盛石化	251,850	2,432,871.00	0.16
168	600346	恒力石化	174,320	2,431,764.00	0.16
169	000983	山西焦煤	235,700	2,430,067.00	0.16
170	300782	卓胜微	30,941	2,405,353.34	0.16
171	603369	今世缘	52,000	2,402,400.00	0.16
172	600161	天坛生物	98,180	2,395,592.00	0.16
173	600372	中航机载	199,900	2,392,803.00	0.16
174	601838	成都银行	157,500	2,392,425.00	0.16
175	600023	浙能电力	332,300	2,362,653.00	0.16
176	601788	光大证券	161,400	2,359,668.00	0.16

177	688223	晶科能源	331,100	2,350,810.00	0.16
178	000807	云铝股份	172,500	2,330,475.00	0.16
179	600196	复星医药	105,100	2,326,914.00	0.16
180	002129	TCL 中环	267,325	2,312,361.25	0.16
181	300418	昆仑万维	71,600	2,308,384.00	0.16
182	002938	鹏鼎控股	57,700	2,294,152.00	0.16
183	601872	招商轮船	270,200	2,283,190.00	0.15
184	601868	中国能建	1,076,100	2,281,332.00	0.15
185	600845	宝信软件	71,388	2,279,418.84	0.15
186	601021	春秋航空	40,453	2,278,717.49	0.15
187	601360	三六零	295,000	2,265,600.00	0.15
188	300661	圣邦股份	27,345	2,263,619.10	0.15
189	600233	圆通速递	142,600	2,231,690.00	0.15
190	600570	恒生电子	125,525	2,216,771.50	0.15
191	600219	南山铝业	580,000	2,209,800.00	0.15
192	600176	中国巨石	199,323	2,202,519.15	0.15
193	600085	同仁堂	56,900	2,174,149.00	0.15
194	002180	纳思达	82,000	2,166,440.00	0.15
195	300896	爱美客	12,560	2,161,576.00	0.15
196	605499	东鹏饮料	10,000	2,157,500.00	0.15
197	601995	中金公司	72,600	2,149,686.00	0.15
198	600600	青岛啤酒	29,400	2,139,438.00	0.14
199	600741	华域汽车	130,500	2,137,590.00	0.14
200	300347	泰格医药	42,909	2,085,377.40	0.14
201	603392	万泰生物	31,612	2,082,598.56	0.14
202	601066	中信建投	107,800	2,074,072.00	0.14
203	002736	国信证券	238,400	2,071,696.00	0.14
204	601336	新华保险	68,900	2,069,067.00	0.14
205	601100	恒立液压	44,418	2,068,990.44	0.14
206	600183	生益科技	98,200	2,068,092.00	0.14
207	601689	拓普集团	38,500	2,063,985.00	0.14
208	002271	东方雨虹	167,250	2,063,865.00	0.14
209	000895	双汇发展	86,100	2,046,597.00	0.14
210	600362	江西铜业	85,700	2,029,376.00	0.14
211	600745	闻泰科技	71,810	2,028,632.50	0.14
212	000963	华东医药	72,659	2,020,646.79	0.14
213	001965	招商公路	169,100	2,005,526.00	0.14
214	002920	德赛西威	23,000	2,003,070.00	0.14
215	601881	中国银河	180,000	1,954,800.00	0.13
216	600027	华电国际	280,800	1,948,752.00	0.13
217	601898	中煤能源	151,600	1,891,968.00	0.13
218	688126	沪硅产业	136,500	1,885,065.00	0.13
219	300033	同花顺	17,818	1,847,726.60	0.12

220	002459	晶澳科技	163,808	1,834,649.60	0.12
221	601618	中国中冶	589,800	1,828,380.00	0.12
222	000999	华润三九	42,500	1,809,650.00	0.12
223	600026	中远海能	115,500	1,802,955.00	0.12
224	601699	潞安环能	99,000	1,794,870.00	0.12
225	002916	深南电路	16,900	1,787,513.00	0.12
226	600515	海南机场	566,600	1,779,124.00	0.12
227	601607	上海医药	92,400	1,765,764.00	0.12
228	300832	新产业	26,000	1,753,440.00	0.12
229	000301	东方盛虹	218,300	1,739,851.00	0.12
230	601878	浙商证券	160,700	1,722,704.00	0.12
231	600332	白云山	58,400	1,712,872.00	0.12
232	000876	新希望	187,400	1,712,836.00	0.12
233	600039	四川路桥	216,880	1,711,183.20	0.12
234	601998	中信银行	255,100	1,709,170.00	0.12
235	601877	正泰电器	89,100	1,698,246.00	0.11
236	600875	东方电气	92,000	1,697,400.00	0.11
237	600588	用友网络	169,251	1,692,510.00	0.11
238	002074	国轩高科	88,100	1,687,115.00	0.11
239	600415	小商品城	226,600	1,681,372.00	0.11
240	002709	天赐材料	95,700	1,680,492.00	0.11
241	002555	三七互娱	128,400	1,675,620.00	0.11
242	688396	华润微	43,799	1,639,834.56	0.11
243	600025	华能水电	149,500	1,611,610.00	0.11
244	600803	新奥股份	76,800	1,597,440.00	0.11
245	000408	藏格矿业	65,400	1,574,178.00	0.11
246	300316	晶盛机电	54,100	1,554,293.00	0.11
247	300223	北京君正	27,900	1,546,776.00	0.10
248	002812	恩捷股份	48,682	1,540,785.30	0.10
249	300628	亿联网络	41,820	1,537,721.40	0.10
250	688599	天合光能	90,177	1,525,794.84	0.10
251	300450	先导智能	90,760	1,509,338.80	0.10
252	300142	沃森生物	132,627	1,509,295.26	0.10
253	605117	德业股份	19,932	1,481,744.88	0.10
254	600460	士兰微	82,700	1,448,077.00	0.10
255	002007	华兰生物	90,945	1,436,021.55	0.10
256	601238	广汽集团	182,800	1,414,872.00	0.10
257	300496	中科创达	30,500	1,390,495.00	0.09
258	301269	华大九天	17,900	1,379,195.00	0.09
259	603260	合盛硅业	29,400	1,373,274.00	0.09
260	300751	迈为股份	11,460	1,369,240.80	0.09
261	300759	康龙化成	73,500	1,365,630.00	0.09
262	601319	中国人保	264,400	1,361,660.00	0.09

263	300999	金龙鱼	49,404	1,351,199.40	0.09
264	600018	上港集团	230,900	1,334,602.00	0.09
265	601799	星宇股份	11,900	1,333,276.00	0.09
266	000733	振华科技	32,100	1,333,113.00	0.09
267	600918	中泰证券	231,700	1,313,739.00	0.09
268	002821	凯莱英	19,800	1,302,840.00	0.09
269	300413	芒果超媒	62,212	1,300,230.80	0.09
270	688009	中国通号	215,300	1,291,800.00	0.09
271	601865	福莱特	63,100	1,268,310.00	0.09
272	603806	福斯特	86,095	1,265,596.50	0.09
273	603659	璞泰来	87,953	1,242,775.89	0.08
274	603195	公牛集团	15,992	1,233,303.04	0.08
275	600132	重庆啤酒	20,000	1,214,000.00	0.08
276	600061	国投资本	213,916	1,208,625.40	0.08
277	300919	中伟股份	38,880	1,204,891.20	0.08
278	000617	中油资本	210,200	1,160,304.00	0.08
279	601059	信达证券	80,600	1,145,326.00	0.08
280	000708	中信特钢	83,500	1,133,095.00	0.08
281	688303	大全能源	53,464	1,090,130.96	0.07
282	688187	时代电气	21,700	1,071,546.00	0.07
283	002410	广联达	110,260	1,056,290.80	0.07
284	002603	以岭药业	68,700	1,053,171.00	0.07
285	300454	深信服	20,800	1,051,024.00	0.07
286	002841	视源股份	34,700	1,024,691.00	0.07
287	300442	润泽科技	42,600	1,020,270.00	0.07
288	603899	晨光股份	30,693	960,077.04	0.06
289	688363	华熙生物	15,900	899,463.00	0.06
290	601808	中海油服	49,000	842,800.00	0.06
291	600732	爱旭股份	90,780	821,559.00	0.06
292	603833	欧派家居	15,197	813,951.32	0.06
293	300979	华利集团	12,500	760,625.00	0.05
294	601236	红塔证券	117,750	755,955.00	0.05
295	601698	中国卫通	53,000	746,770.00	0.05
296	300957	贝泰妮	13,900	671,648.00	0.05
297	688082	盛美上海	7,300	616,923.00	0.04
298	000800	一汽解放	77,500	606,825.00	0.04
299	603296	华勤技术	7,600	419,748.00	0.03
300	001289	龙源电力	12,800	220,800.00	0.01
301	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
302	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
303	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
304	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
305	301580	爱迪特	202	13,317.86	0.00

306	603381	永臻股份	178	4,473.14	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	300750	宁德时代	8,435,644.00	0.65
2	000333	美的集团	5,552,520.00	0.43
3	600900	长江电力	5,485,603.00	0.42
4	000858	五粮液	4,877,127.99	0.37
5	002594	比亚迪	4,416,259.00	0.34
6	000651	格力电器	3,142,915.00	0.24
7	300760	迈瑞医疗	3,064,240.00	0.23
8	002371	北方华创	3,008,785.00	0.23
9	300059	东方财富	2,875,206.00	0.22
10	002475	立讯精密	2,705,343.00	0.21
11	000725	京东方 A	2,682,141.00	0.21
12	300124	汇川技术	2,520,829.00	0.19
13	000807	云铝股份	2,506,846.00	0.19
14	600161	天坛生物	2,480,078.60	0.19
15	300418	昆仑万维	2,470,638.00	0.19
16	601998	中信银行	2,370,661.00	0.18
17	002714	牧原股份	2,286,536.00	0.18
18	000568	泸州老窖	2,245,544.00	0.17
19	002415	海康威视	2,163,585.00	0.17
20	300274	阳光电源	1,983,570.00	0.15

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	300750	宁德时代	4,165,734.00	0.32
2	002594	比亚迪	3,064,876.00	0.23
3	000333	美的集团	3,030,547.00	0.23
4	300124	汇川技术	2,858,952.00	0.22
5	000858	五粮液	2,560,732.00	0.20
6	601998	中信银行	2,398,223.00	0.18
7	600919	江苏银行	2,363,523.00	0.18
8	600028	中国石化	2,277,562.00	0.17
9	002142	宁波银行	2,140,189.00	0.16
10	002202	金风科技	1,914,224.00	0.15

11	688065	凯赛生物	1,734,293.55	0.13
12	300763	锦浪科技	1,720,737.00	0.13
13	300059	东方财富	1,716,226.76	0.13
14	300760	迈瑞医疗	1,694,583.00	0.13
15	300751	迈为股份	1,690,351.00	0.13
16	601615	明阳智能	1,600,152.00	0.12
17	000725	京东方 A	1,598,638.00	0.12
18	000651	格力电器	1,580,074.00	0.12
19	000661	长春高新	1,408,200.00	0.11
20	002475	立讯精密	1,387,254.00	0.11

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	192,225,900.66
卖出股票收入（成交）总额	130,776,160.98

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 本基金投资股指期货的投资政策

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局、国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分行的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局地方监管局、国家外汇管理局、中国人民银行分行的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期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	124,764.89
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	124,764.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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 (%)
346	4,380,931.79	1,513,612,500.00	99.86	2,189,900.00	0.14

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	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	1.99
2	中国人民保险集团股份有限公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	5,091,400.00	0.34
3	香港中央结算有限公司	2,836,900.00	0.19
4	福建省叁号职业年金计划—中信银行	2,345,900.00	0.15
5	国寿养老配置 10 号混合型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	2,275,500.00	0.15
6	创金合信基金—中国银行—创金合信鼎泰 33 号集合资产管理计划	2,100,000.00	0.14
7	中信证券股份有限公司	2,055,200.00	0.14
8	河南省农村信用社联合社企业年金计划—中信银行股份有限公司	2,020,500.00	0.13
9	国寿永颐企业年金集合计划—中国建设银行股份有限公司	1,995,300.00	0.13
10	广发银行股份有限公司企业年金计划—中国民生银行股份有限公司	1,780,700.00	0.12
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	1,433,249,900.00	94.55

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
-----------------	---

§ 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	1,359,802,400.00
本报告期基金总申购份额	315,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	159,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,515,802,400.00

§ 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

本报告期内，基金管理人于 2024 年 3 月 27 日发布公告，王大朋先生于 2024 年 3 月 25 日离任公司总经理助理；基金管理人于 2024 年 6 月 15 日发布公告，王文英女士于 2024 年 6 月 14 日任公司副总经理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金于 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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.6.2 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，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
中信证券	2	264,931,659.67	82.13	250,603.41	82.13	-
海通证券	2	57,656,436.62	17.87	54,538.05	17.87	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
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，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	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
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

无。

§ 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	20240101~20240630	1,286,249,900.00	276,000,000.00	129,000,000.00	1,433,249,900.00	94.55
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。

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.gsfoods.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

2024 年 8 月 31 日