

国寿安保中证沪港深 300 交易型  
开放式指数证券投资基金  
2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 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。本年度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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 03 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。

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2021 年 02 月 04 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 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                         | 6         |
| 2.4 信息披露方式                              | 6         |
| 2.5 其他相关资料                              | 6         |
| <b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>         | <b>6</b>  |
| 3.1 主要会计数据和财务指标                         | 6         |
| 3.2 基金净值表现                              | 7         |
| 3.3 其他指标                                | 8         |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况                       | 8         |
| <b>§ 4 管理人报告</b>                        | <b>8</b>  |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况                        | 8         |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明              | 9         |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明                 | 10        |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明             | 10        |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望             | 11        |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况                 | 11        |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明                | 11        |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明                 | 12        |
| 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明       | 12        |
| <b>§ 5 托管人报告</b>                        | <b>12</b> |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 12        |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12        |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见      | 12        |
| <b>§ 6 审计报告</b>                         | <b>12</b> |
| 6.1 审计报告基本信息                            | 12        |
| 6.2 审计报告的基本内容                           | 13        |
| <b>§ 7 年度财务报表</b>                       | <b>15</b> |
| 7.1 资产负债表                               | 15        |
| 7.2 利润表                                 | 16        |
| 7.3 所有者权益（基金净值）变动表                      | 17        |
| 7.4 报表附注                                | 17        |
| <b>§ 8 投资组合报告</b>                       | <b>45</b> |
| 8.1 期末基金资产组合情况                          | 45        |

|  |           |
|--|-----------|
| 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....                 | 45        |
| 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....     | 46        |
| 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....                  | 56        |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....                 | 57        |
| 8.6 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.....    | 58        |
| 8.7 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..... | 58        |
| 8.8 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..... | 58        |
| 8.9 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.....    | 58        |
| 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....            | 58        |
| 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....            | 58        |
| 8.12 投资组合报告附注 .....                        | 58        |
| <b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>                 | <b>59</b> |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....                | 59        |
| 9.2 期末上市基金前十名持有人 .....                     | 60        |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....             | 60        |
| 9.4 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.....      | 60        |
| <b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>                | <b>60</b> |
| <b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>                   | <b>61</b> |
| 11.1 基金份额持有人大会决议 .....                     | 61        |
| 11.2 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.....      | 61        |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....          | 61        |
| 11.4 基金投资策略的改变 .....                       | 61        |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....                | 61        |
| 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....        | 61        |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....               | 61        |
| 11.8 其他重大事件 .....                          | 63        |
| <b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>           | <b>64</b> |
| 12.1 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 .....   | 64        |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....                  | 64        |
| <b>§ 13 备查文件目录 .....</b>                   | <b>64</b> |
| 13.1 备查文件目录 .....                          | 64        |
| 13.2 存放地点 .....                            | 65        |
| 13.3 查阅方式 .....                            | 65        |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|              |                              |
|--------------|------------------------------|
| 基金名称         | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称         | 国寿安保中证沪港深 300ETF             |
| 场内简称         | AH300ETF                     |
| 基金主代码        | 517300                       |
| 基金运作方式       | 交易型开放式                       |
| 基金合同生效日      | 2021 年 2 月 4 日               |
| 基金管理人        | 国寿安保基金管理有限公司                 |
| 基金托管人        | 招商银行股份有限公司                   |
| 报告期末基金份额总额   | 2,961,434,450.00 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         | 2021 年 2 月 24 日              |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。   |
| 投资策略   | <p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>1、组合复制策略</p> <p>本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证沪港深 300 指数   |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数、标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资标的包括港股通投资标的的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>  |

## 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                     | 招商银行股份有限公司             |
| 信息披露<br>负责人 | 姓名   | 申梦玉                              | 张燕                     |
|             | 联系电话 | 010-50850744                     | 0755-83199084          |
|             | 电子邮箱 | public@gsfunds.com.cn            | yan_zhang@cmbchina.com |
| 客户服务电话      |      | 4009-258-258                     | 95555                  |
| 传真          |      | 010-50850776                     | 0755-83195201          |
| 注册地址        |      | 上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号        | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦   |
| 邮政编码        |      | 100033                           | 518040                 |
| 法定代表人       |      | 王军辉                              | 缪建民                    |

## 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   |
| 登载基金年度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> |
| 基金年度报告备置地点          | 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                                 |
|--------|----------------------|--------------------------------------|
| 会计师事务所 | 普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙) | 上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼 |
| 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、基金净值表现及利润分配情况

### 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 | 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）-2021 年 12 月 31 日 |
| 本期已实现收益       | -128,189,183.58                          |
| 本期利润          | -545,459,331.60                          |
| 加权平均基金份额本期利润  | -0.1621                                  |
| 本期加权平均净值利润率   | -18.20%                                  |
| 本期基金份额净值增长率   | -15.13%                                  |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2021 年末                                  |
| 期末可供分配利润      | -448,006,932.43                          |
| 期末可供分配基金份额利润  | -0.1513                                  |
| 期末基金资产净值      | 2,513,427,517.57                         |
| 期末基金份额净值      | 0.8487                                   |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2021 年末                                  |
| 基金份额累计净值增长率   | -15.13%                                  |

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。

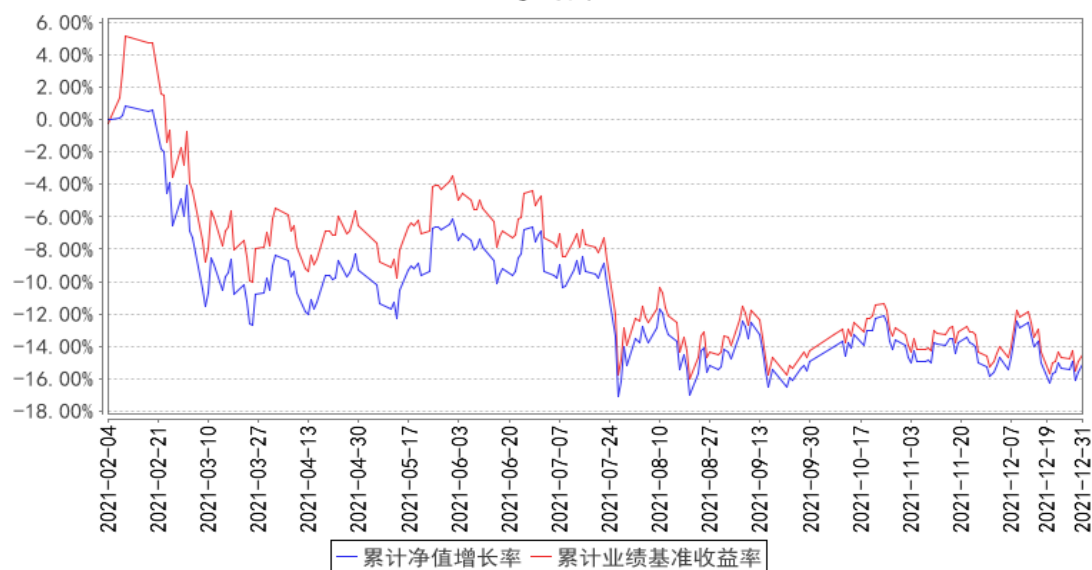
## 3.2 基金净值表现

### 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    |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|--------|--------|
| 过去三个月      | -0.20%   | 0.77%       | -0.26%     | 0.77%         | 0.06%  | 0.00%  |
| 过去六个月      | -8.62%   | 1.07%       | -10.03%    | 1.07%         | 1.41%  | 0.00%  |
| 自基金合同生效起至今 | -15.13%  | 1.12%       | -14.49%    | 1.15%         | -0.64% | -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

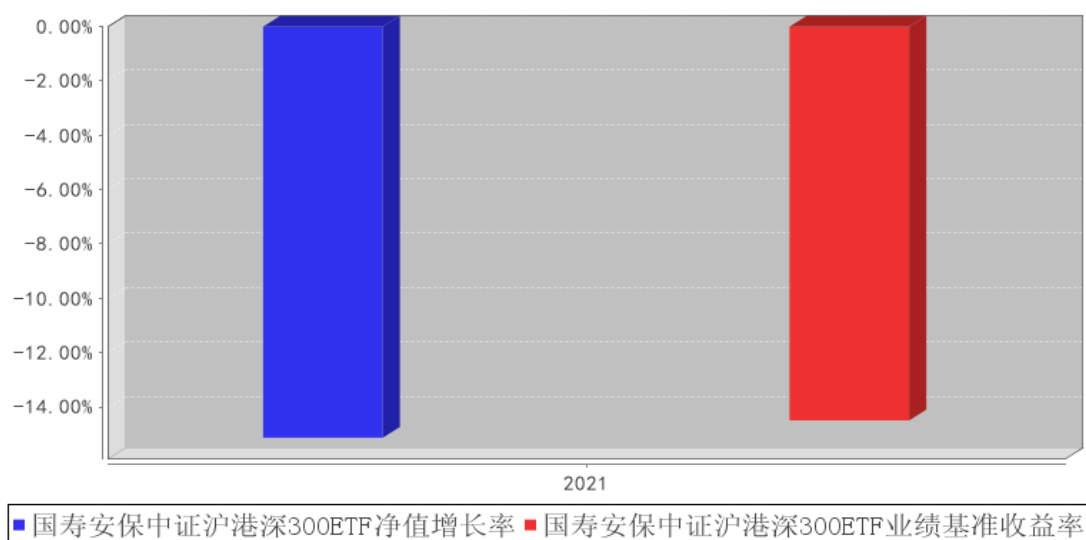
国寿安保中证沪港深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 02 月 04 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2021 年 02 月 04 日至 2021 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

国寿安保中证沪港深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至 2021 年 12 月 31 日，公司共管理 87 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 3404.72 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2594.03 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  | 本基金的基金经理 | 2021年2月4日       | -    | 12年    | 李康先生，博士研究生。2009年10月至2012年12月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012年12月至2013年11月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保稳丰6个月持有期混合型证券投资基金和国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。 |
| 苏天醒 | 本基金的基金经理 | 2021年3月1日       | -    | 11年    | 苏天醒，北京邮电大学电子工程专业硕士，2010年3月至2012年11月任中国国际金融有限公司研究员；2013年2月至2014年6月任新华资产管理股份有限公司交易员；2014年6月至2015年5月任宁波灵均投资管理合伙企业（有限合伙）投资交易总监；2015年5月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金基金经理。   |

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于基金份额持有人为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的

前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，不存在违反基金合同和损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规制定了《国寿安保基金管理有限公司公平交易制度》以及其配套实施细则。公司以科学、制衡的投资决策体系，通过完善集中交易制度、优化工作流程、加强技术手段，保证公平交易原则的实现。同时，公司通过监察稽核、盘中监控、事后分析和信息披露来加强对于公平交易过程和结果的监督。

##### 4.3.2 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。

##### 4.3.3 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

本基金为 2021 年新发基金，跟踪误差主要来自成立初期仓位不足、成分股调整、股票停牌等因素引起的成份股权重偏离、以及汇率波动等因素。日常申赎、市场波动和港股交易备付金占用等，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 0.8487 元；本报告期基金份额净值增长率为 -15.13%，业绩比较基准收益率为 -14.49%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年 A 股市场主要指数整体大多有一定幅度上涨，春节前后有较明显的风格切换，全年呈结构化行情，整体小盘风格占优，双碳半导体等科技类公司受到市场青睐。展望 2022 年，中国经济进入短周期下行的后半段，稳增长力度逐步加大，社融增速正在触底回升，同时金融市场流动性相对充裕，稳增长相关的赛道具有较好的投资机会。中长期行情仍看好技术产业升级主线，科技类成长股基本面并未出现大的变化，待前期偏高的估值修复后，高景气成长板块有望迎来配置价值。整体上，在宏观政策支持 and 上市公司业绩向好的背景下，A 股权益资产具有较好的投资价值，需要关注结构化行情演绎下的风格再平衡。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人根据监管要求的发展变化以及公司业务开展情况，不断推进相关业务制度及流程的建立和完善，进一步完善公司内部控制制度体系；针对投资交易业务，建立了事前、事中、事后三层监控体系，保障基金投资交易合法合规；对基金产品的宣传推介、销售协议、营销活动等市场营销方面展开各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续秉承以基金份额持有人利益优先的原则，以风险控制为核心，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 4.9 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

|            |         |
|------------|---------|
| 财务报表是否经过审计 | 是       |
| 审计意见类型     | 标准无保留意见 |

|        |                         |
|--------|-------------------------|
| 审计报告编号 | 普华永道中天审字(2022)第 20825 号 |
|--------|-------------------------|

## 6.2 审计报告的基本内容

|                 |  |
|-----------------|--|
| 审计报告标题          | 审计报告   |
| 审计报告收件人         | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 审计意见            | <p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“国寿安保中证沪港深 300ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了国寿安保中证沪港深 300ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p> |
| 形成审计意见的基础       | <p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于国寿安保中证沪港深 300ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>  |
| 强调事项            | 无。   |
| 其他事项            | 无。   |
| 其他信息            | <p>国寿安保中证沪港深 300ETF 基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括 2021 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>   |
| 管理层和治理层对财务报表的责任 | 基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重   |

|                        |  |
|------------------------|--|
|                        | <p>大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估国寿安保中证沪港深 300ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算国寿安保中证沪港深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国寿安保中证沪港深 300ETF 基金的财务报告过程。</p>  |
| <p>注册会计师对财务报表审计的责任</p> | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国寿安保中证沪港深 300ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国寿安保中证沪港深 300ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| <p>会计师事务所的名称</p>       | <p>普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)</p>  |
| <p>注册会计师的姓名</p>        | <p>张勇   周祎</p>   |
| <p>会计师事务所的地址</p>       | <p>中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 113 楼</p>  |
| <p>审计报告日期</p>          | <p>2022 年 3 月 30 日</p>   |

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 资产              | 附注号        | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日         |
|-----------------|------------|---------------------------------|
| <b>资产：</b>      |            |                                 |
| 银行存款            | 7.4.7.1    | 28,737,679.02                   |
| 结算备付金           |            | 403,278.51                      |
| 存出保证金           |            | 86,632.04                       |
| 交易性金融资产         | 7.4.7.2    | 2,486,626,632.36                |
| 其中：股票投资         |            | 2,483,293,632.36                |
| 基金投资            |            | -                               |
| 债券投资            |            | 3,333,000.00                    |
| 资产支持证券投资        |            | -                               |
| 贵金属投资           |            | -                               |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | -                               |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | -                               |
| 应收证券清算款         |            | 105,782.15                      |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 12,180.13                       |
| 应收股利            |            | 30,832.00                       |
| 应收申购款           |            | -                               |
| 递延所得税资产         |            | -                               |
| 其他资产            | 7.4.7.6    | -                               |
| 资产总计            |            | 2,516,003,016.21                |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2021 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          | 7.4.7.3    | -                               |
| 卖出回购金融资产款       |            | -                               |
| 应付证券清算款         |            | 597,595.93                      |
| 应付赎回款           |            | -                               |
| 应付管理人报酬         |            | 1,086,807.22                    |
| 应付托管费           |            | 217,361.43                      |
| 应付销售服务费         |            | -                               |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 256,167.87                      |
| 应交税费            |            | 215.34                          |
| 应付利息            |            | -                               |

|               |          |                  |
|---------------|----------|------------------|
| 应付利润          |          | -                |
| 递延所得税负债       |          | -                |
| 其他负债          | 7.4.7.8  | 417,350.85       |
| 负债合计          |          | 2,575,498.64     |
| <b>所有者权益：</b> |          |                  |
| 实收基金          | 7.4.7.9  | 2,961,434,450.00 |
| 未分配利润         | 7.4.7.10 | -448,006,932.43  |
| 所有者权益合计       |          | 2,513,427,517.57 |
| 负债和所有者权益总计    |          | 2,516,003,016.21 |

注：本基金合同生效日为 2021 年 02 月 04 日，本报告期自基金合同生效日 2021 年 02 月 04 日起至 2021 年 12 月 31 日止。报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8487 元，基金份额总额 2,961,434,450.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项 目                    | 附注号        | 本期  |
|------------------------|------------|---|
|                        |            | 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
| 一、收入                   |            | -521,843,254.50                           |
| 1. 利息收入                |            | 1,854,924.33                              |
| 其中：存款利息收入              | 7.4.7.11   | 1,596,201.09                              |
| 债券利息收入                 |            | 820.47                                    |
| 资产支持证券利息收入             |            | -   |
| 买入返售金融资产收入             |            | 135,081.12                                |
| 证券出借利息收入               |            | 122,821.65                                |
| 其他利息收入                 |            | -   |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列）      |            | -108,121,384.86                           |
| 其中：股票投资收益              | 7.4.7.12   | -160,416,617.13                           |
| 基金投资收益                 |            | -   |
| 债券投资收益                 | 7.4.7.13   | 1,424,502.86                              |
| 资产支持证券投资收益             | 7.4.7.13.3 | -   |
| 贵金属投资收益                | 7.4.7.14   | -   |
| 衍生工具收益                 | 7.4.7.15   | -   |
| 股利收益                   | 7.4.7.16   | 50,870,729.41                             |
| 3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 7.4.7.17   | -417,270,148.02                           |
| 4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）     |            | -   |
| 5. 其他收入（损失以“-”号填列）     | 7.4.7.18   | 1,693,354.05                              |
| 减：二、费用                 |            | 23,616,077.10                             |
| 1. 管理人报酬               | 7.4.10.2.1 | 13,623,724.93                             |



|                     |            |                 |
|---------------------|------------|-----------------|
| 2. 托管费              | 7.4.10.2.2 | 2,724,744.95    |
| 3. 销售服务费            | 7.4.10.2.3 | -               |
| 4. 交易费用             | 7.4.7.19   | 6,208,616.60    |
| 5. 利息支出             |            | -               |
| 其中：卖出回购金融资产支出       |            | -               |
| 6. 税金及附加            |            | 444.00          |
| 7. 其他费用             | 7.4.7.20   | 1,058,546.62    |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） |            | -545,459,331.60 |
| 减：所得税费用             |            | -               |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列）   |            | -545,459,331.60 |

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

| 项目                                     | 本期<br>2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |                 |                  |
|--|---|-----------------|------------------|
|  | 实收基金  | 未分配利润           | 所有者权益合计          |
| 一、期初所有者权益（基金净值）                        | 3,936,434,450.00                                | -               | 3,936,434,450.00 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）               | -   | -545,459,331.60 | -545,459,331.60  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数<br>（净值减少以“-”号填列）  | -975,000,000.00                                 | 97,452,399.17   | -877,547,600.83  |
| 其中：1. 基金申购款                            | 21,000,000.00                                   | -2,854,935.19   | 18,145,064.81    |
| 2. 基金赎回款                               | -996,000,000.00                                 | 100,307,334.36  | -895,692,665.64  |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列） | -   | -               | -                |
| 五、期末所有者权益（基金净值）                        | 2,961,434,450.00                                | -448,006,932.43 | 2,513,427,517.57 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

国寿安保中证沪港深 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[2020]3525号《关于准予国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准,由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证沪港深 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。本基金为交易型开放式,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 3,936,141,500.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0157 号予以验证。经向中国证监会备案,《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合同》于 2021 年 02 月 04 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,936,434,450.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 292,950.00 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”),基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2021]65 号核准,本基金 3,936,434,450.00 份基金份额于 2021 年 2 月 24 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《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标,本基金还可投资于其他股票(包含港股通标的股票、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%,且不低于非现金基金资产的 80%。本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金通过港股通投资标的指数的成份股、备选成份股,未来如果港股通业务规则发生变化或出现法律法规或监管部门允许投资的其他模式,基金管理人可在履行适当程序后相应调整。本基金将根据法律法规参与转融通证券出借业务,以提高投资效率及进行风险管理。本基金的业绩比较基准为:中证沪港深 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

了国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿沪港深 300ETFETF 联接基金”)。国寿沪港深 300ETFETF 联接基金为交易型开放式基金,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。

本财务报表由本基金的基金管理人国寿安保于 2022 年 3 月 30 日批准报出。

#### 7.4.2 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》、《国寿安保中证沪港深 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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2021 年 2 月 4 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

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

#### (2) 金融负债的分类

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确

定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确

认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一基金份额享有同等分配权。本基金的收益分配方式是现金分红。当基金累计报酬率超过同期标的指数累计报酬率达到 1%以上,可进行收益分配。在符合有关基金收益分配条件的前提下,本基金收益每年最多分配 12 次,每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。基于本基金的性质和特点,本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提,收益分配后有可能使基金份额净值低于面值。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目,于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币,所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券和私募债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 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[2014]81号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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]127号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充



通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

| 项目           | 本期末<br>2021年12月31日 |
|--------------|--------------------|
| 活期存款         | 28,737,679.02      |
| 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           | 28,737,679.02      |

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021年12月31日 |                  |                 |
|---------------|--------------------|------------------|-----------------|
|               | 成本                 | 公允价值             | 公允价值变动          |
| 股票            | 2,900,563,780.38   | 2,483,293,632.36 | -417,270,148.02 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | -                  | -                | -               |
| 债券            | 交易所市场              | 3,333,000.00     | 3,333,000.00    |
|               | 银行间市场              | -                | -               |
|               | 合计                 | 3,333,000.00     | 3,333,000.00    |
| 资产支持证券        | -                  | -                | -               |
| 基金            | -                  | -                | -               |
| 其他            | -                  | -                | -               |
| 合计            | 2,903,896,780.38   | 2,486,626,632.36 | -417,270,148.02 |

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 7.4.7.4 买入返售金融资产

#### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 7.4.7.4.2 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。

### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目         | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|------------|-------------------------|
| 应收活期存款利息   | 9,447.83                |
| 应收定期存款利息   | -                       |
| 应收其他存款利息   | -                       |
| 应收结算备付金利息  | 1,943.11                |
| 应收债券利息     | 73.05                   |
| 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   | 674.23                  |
| 其他         | 41.91                   |
| 合计         | 12,180.13               |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |
|-------------|-------------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 256,167.87              |
| 银行间市场应付交易费用 | -                       |
| 合计          | 256,167.87              |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2021 年 12 月 31 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        | 220,000.00              |
| 应付指数使用费     | 197,350.85              |
| 合计          | 417,350.85              |

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |                  |
|---------|---|------------------|
|         | 基金份额（份）   | 账面金额             |
| 基金合同生效日 | 3,936,434,450.00                                | 3,936,434,450.00 |

|               |                  |                  |
|---------------|------------------|------------------|
| 本期申购          | 21,000,000.00    | 21,000,000.00    |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -996,000,000.00  | -996,000,000.00  |
| - 基金拆分/份额折算前  | -                | -                |
| 基金拆分/份额折算调整   | -                | -                |
| 本期申购          | -                | -                |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -                | -                |
| 本期末           | 2,961,434,450.00 | 2,961,434,450.00 |

注：1. 本期申购包含基金红利再投资、转入的份额及金额；本期赎回包含基金转出的份额及金额。

2. 本基金自 2021 年 1 月 25 日至 2021 年 1 月 29 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币 3,936,141,500.00 元。折合为 3,936,141,500.00 份基金份额。根据《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币 292,950.00 元在本基金成立后，折算为 292,950.00 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3. 根据《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合同》、《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》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份额发售公告》的规定，本基金于 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 2 月 23 日止期间暂不向投资人开放基金交易。

#### 7.4.7.10 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         |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 基金合同生效日        | -               | -               | -               |
| 本期利润           | -128,189,183.58 | -417,270,148.02 | -545,459,331.60 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 13,058,784.54   | 84,393,614.63   | 97,452,399.17   |
| 其中：基金申购款       | -322,547.18     | -2,532,388.01   | -2,854,935.19   |
| 基金赎回款          | 13,381,331.72   | 86,926,002.64   | 100,307,334.36  |
| 本期已分配利润        | -               | -               | -               |
| 本期末            | -115,130,399.04 | -332,876,533.39 | -448,006,932.43 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期  |
|-----------|---|
|           | 2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
| 活期存款利息收入  | 1,422,418.34                              |
| 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 | 150,323.83                                |

|    |              |
|----|--------------|
| 其他 | 23,458.92    |
| 合计 | 1,596,201.09 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目               | 本期                             |
|------------------|--------------------------------|
|                  | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -116,722,306.44                |
| 股票投资收益——赎回差价收入   | -43,694,310.69                 |
| 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               | -160,416,617.13                |

##### 7.4.7.12.2 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2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 卖出股票成交总额   | 1,224,682,931.60               |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,341,405,238.04               |
| 买卖股票差价收入   | -116,722,306.44                |

##### 7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目          | 本期                             |
|-------------|--------------------------------|
|             | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 赎回基金份额对价总额  | 895,692,665.64                 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 522,675,554.64                 |
| 减：赎回股票成本总额  | 416,711,421.69                 |
| 赎回差价收入      | -43,694,310.69                 |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期                             |
|-------------------------------|--------------------------------|
|                               | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 1,424,502.86                   |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | -                              |
| 债券投资收益——申购差价收入                | -                              |
| 合计                            | 1,424,502.86                   |

## 7.4.7.13.2 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2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 8,045,065.55                   |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 6,619,800.00                   |
| 减：应收利息总额                | 762.69                         |
| 买卖债券差价收入                | 1,424,502.86                   |

## 7.4.7.13.3 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收益。

## 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资收益。

## 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期无买卖衍生工具差价收入。

## 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目            | 本期                             |
|---------------|--------------------------------|
|               | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 股票投资产生的股利收益   | 50,870,729.41                  |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 107,380.77                     |
| 基金投资产生的股利收益   | -                              |
| 合计            | 50,870,729.41                  |

## 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称       | 本期                             |
|------------|--------------------------------|
|            | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 1. 交易性金融资产 | -417,270,148.02                |
| 股票投资       | -417,270,148.02                |
| 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                     | -417,270,148.02 |

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期                             |
|---------|--------------------------------|
|         | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 基金赎回费收入 | -                              |
| 替代损益    | 1,213,028.91                   |
| 其他      | 480,325.14                     |
| 合计      | 1,693,354.05                   |

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期                             |
|-----------|--------------------------------|
|           | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 交易所市场交易费用 | 6,208,616.60                   |
| 银行间市场交易费用 | -                              |
| 合计        | 6,208,616.60                   |

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目      | 本期                             |
|---------|--------------------------------|
|         | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 审计费用    | 120,000.00                     |
| 信息披露费   | 100,000.00                     |
| 证券出借违约金 | -                              |
| 银行费用    | 20,723.05                      |
| 指数使用费   | 817,423.57                     |
| 其他      | 400.00                         |
| 合计      | 1,058,546.62                   |

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

| 关联方名称                    | 与本基金的关系           |
|--------------------------|-------------------|
| 国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”） | 基金管理人             |
| 招商银行股份有限公司（简称“招商银行”）     | 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”）   | 国寿安保的最终控制人        |
| 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         |
| 广发银行股份有限公司（简称“广发银行”）     | 基金管理人股东之股东的联营企业   |

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目              | 本期                             |
|-----------------|--------------------------------|
|                 | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 13,623,724.93                  |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 11,184.74                      |

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

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目             | 本期                             |
|----------------|--------------------------------|
|                | 2021年2月4日（基金合同生效日）至2021年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 2,724,744.95                   |



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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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

本基金于本报告期末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。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金于本报告期末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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 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末未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 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<br>2021 年 12 月 31 日 |                          |
|-------|-------------------------|--------------------------|
|       | 持有的<br>基金份额             | 持有的基金份额<br>占基金总份额的比例 (%) |
| 中国人寿  | 1,820,000,000.00        | 61.46                    |

#### 7.4.10.6 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<br>2021 年 2 月 4 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日 |
|-------|---|
|-------|---|

|      | 期末余额          | 当期利息收入       |
|------|---------------|--------------|
| 招商银行 | 28,737,679.02 | 1,422,418.34 |

注：本基金的银行存款由基金托管人招商银行保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有 1,178,600.00 股招商银行的 A 股普通股，成本总额为人民币 64,613,338.20 元，估值总额为人民币 57,409,606.00 元，占基金资产净值的比例为 2.28%；本基金持有 203,000.00 股招商银行的 H 股，成本总额为人民币 10,887,028.47 元，估值总额为人民币 10,049,653.04 元，占基金资产净值的比例为 0.40%。

本基金持有 158,700.00 股中国人寿的 A 股普通股，成本总额为人民币 5,373,426.59 元，估值总额为人民币 4,775,283.00 元，占基金资产净值的比例为 0.19%；本基金持有 328,000.00 股中国人寿的 H 股，成本总额为人民币 4,559,364.86 元，估值总额为人民币 3,464,792.58 元，占基金资产净值的比例为 0.14%。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 7.4.12 期末(2021 年 12 月 31 日)本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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

| 7.4.12.1.1 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 |
| 001234               | 泰慕士  | 2021 年 12 月 31 日 | 2022 年 1 月 11 日 | 新股未上市  | 16.53 | 16.53  | 333      | 5,504.49 | 5,504.49  | -  |
| 300774               | 倍杰特  | 2021 年 7 月 26 日  | 2022 年 2 月 16 日 | 新股流通受限 | 4.57  | 21.08  | 444      | 2,029.08 | 9,359.52  | -  |
| 300814               | 中富电路 | 2021 年 8 月 4 日   | 2022 年 2 月 14 日 | 新股流通受限 | 8.40  | 23.88  | 328      | 2,755.20 | 7,832.64  | -  |
| 300854               | 中兰环保 | 2021 年 9 月 8 日   | 2022 年 3 月 16 日 | 新股流通受限 | 9.96  | 27.29  | 203      | 2,021.88 | 5,539.87  | -  |
| 300994               | 久祺股份 | 2021 年 8 月 2 日   | 2022 年 2 月 14 日 | 新股流通受限 | 11.90 | 45.45  | 420      | 4,998.00 | 19,089.00 | -  |
| 301017               | 漱玉平民 | 2021 年 6 月 23 日  | 2022 年 1 月 5 日  | 新股流通受限 | 8.86  | 23.80  | 555      | 4,917.30 | 13,209.00 | -  |
| 301020               | 密封科技 | 2021 年 6 月 28 日  | 2022 年 1 月 6 日  | 新股流通受限 | 10.64 | 30.44  | 421      | 4,479.44 | 12,815.24 | -  |
| 301021               | 英诺激光 | 2021 年 6 月 28 日  | 2022 年 1 月 6 日  | 新股流通受限 | 9.46  | 41.43  | 290      | 2,743.40 | 12,014.70 | -  |
| 301025               | 读客文化 | 2021 年 7 月 6 日   | 2022 年 1 月 24 日 | 新股流通受限 | 1.55  | 20.88  | 403      | 624.65   | 8,414.64  | -  |

|        |      |             |            |        |       |        |       |           |           |   |
|--------|------|-------------|------------|--------|-------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 301026 | 浩通科技 | 2021年7月8日   | 2022年1月17日 | 新股流通受限 | 18.03 | 62.73  | 203   | 3,660.09  | 12,734.19 | - |
| 301027 | 华蓝集团 | 2021年7月8日   | 2022年1月19日 | 新股流通受限 | 11.45 | 16.65  | 286   | 3,274.70  | 4,761.90  | - |
| 301028 | 东亚机械 | 2021年7月12日  | 2022年1月20日 | 新股流通受限 | 5.31  | 13.50  | 733   | 3,892.23  | 9,895.50  | - |
| 301029 | 怡合达  | 2021年7月14日  | 2022年1月24日 | 新股流通受限 | 14.14 | 89.87  | 462   | 6,532.68  | 41,519.94 | - |
| 301030 | 仕净科技 | 2021年7月15日  | 2022年1月24日 | 新股流通受限 | 6.10  | 31.52  | 242   | 1,476.20  | 7,627.84  | - |
| 301032 | 新柴股份 | 2021年7月15日  | 2022年1月24日 | 新股流通受限 | 4.97  | 12.51  | 513   | 2,549.61  | 6,417.63  | - |
| 301035 | 润丰股份 | 2021年7月21日  | 2022年1月28日 | 新股流通受限 | 22.04 | 56.28  | 644   | 14,193.76 | 36,244.32 | - |
| 301036 | 双乐股份 | 2021年7月21日  | 2022年2月16日 | 新股流通受限 | 23.38 | 29.93  | 205   | 4,792.90  | 6,135.65  | - |
| 301037 | 保立佳  | 2021年7月21日  | 2022年2月7日  | 新股流通受限 | 14.82 | 24.26  | 193   | 2,860.26  | 4,682.18  | - |
| 301038 | 深水规院 | 2021年7月22日  | 2022年2月7日  | 新股流通受限 | 6.68  | 20.23  | 266   | 1,776.88  | 5,381.18  | - |
| 301039 | 中集车辆 | 2021年7月1日   | 2022年1月10日 | 新股流通受限 | 6.96  | 12.51  | 2,064 | 14,365.44 | 25,820.64 | - |
| 301040 | 中环海陆 | 2021年7月26日  | 2022年2月7日  | 新股流通受限 | 13.57 | 38.51  | 241   | 3,270.37  | 9,280.91  | - |
| 301041 | 金百泽  | 2021年8月2日   | 2022年2月11日 | 新股流通受限 | 7.31  | 28.21  | 215   | 1,571.65  | 6,065.15  | - |
| 301045 | 天禄科技 | 2021年8月6日   | 2022年2月17日 | 新股流通受限 | 15.81 | 28.37  | 335   | 5,296.35  | 9,503.95  | - |
| 301046 | 能辉科技 | 2021年8月10日  | 2022年2月17日 | 新股流通受限 | 8.34  | 48.99  | 290   | 2,418.60  | 14,207.10 | - |
| 301048 | 金鹰重工 | 2021年8月11日  | 2022年2月28日 | 新股流通受限 | 4.13  | 12.96  | 843   | 3,481.59  | 10,925.28 | - |
| 301049 | 超越科技 | 2021年8月17日  | 2022年2月24日 | 新股流通受限 | 19.34 | 32.92  | 196   | 3,790.64  | 6,452.32  | - |
| 301050 | 雷电微力 | 2021年8月17日  | 2022年2月24日 | 新股流通受限 | 60.64 | 234.74 | 233   | 14,129.12 | 54,694.42 | - |
| 301052 | 果麦文化 | 2021年8月23日  | 2022年2月28日 | 新股流通受限 | 8.11  | 33.64  | 252   | 2,043.72  | 8,477.28  | - |
| 301053 | 远信工业 | 2021年8月25日  | 2022年3月1日  | 新股流通受限 | 11.87 | 28.78  | 155   | 1,839.85  | 4,460.90  | - |
| 301055 | 张小泉  | 2021年8月26日  | 2022年3月7日  | 新股流通受限 | 6.90  | 21.78  | 355   | 2,449.50  | 7,731.90  | - |
| 301056 | 森赫股份 | 2021年8月27日  | 2022年3月7日  | 新股流通受限 | 3.93  | 11.09  | 572   | 2,247.96  | 6,343.48  | - |
| 301057 | 汇隆新材 | 2021年8月31日  | 2022年3月9日  | 新股流通受限 | 8.03  | 19.02  | 218   | 1,750.54  | 4,146.36  | - |
| 301058 | 中粮工科 | 2021年9月1日   | 2022年3月9日  | 新股流通受限 | 3.55  | 18.24  | 1,386 | 4,920.30  | 25,280.64 | - |
| 301059 | 金三江  | 2021年9月3日   | 2022年3月14日 | 新股流通受限 | 8.09  | 19.30  | 259   | 2,095.31  | 4,998.70  | - |
| 301060 | 兰卫医学 | 2021年9月6日   | 2022年3月14日 | 新股流通受限 | 4.17  | 30.94  | 587   | 2,447.79  | 18,161.78 | - |
| 301062 | 上海艾录 | 2021年9月7日   | 2022年3月14日 | 新股流通受限 | 3.31  | 17.01  | 523   | 1,731.13  | 8,896.23  | - |
| 301063 | 海锅股份 | 2021年9月9日   | 2022年3月24日 | 新股流通受限 | 17.40 | 36.11  | 153   | 2,662.20  | 5,524.83  | - |
| 301066 | 万事利  | 2021年9月13日  | 2022年3月22日 | 新股流通受限 | 5.24  | 22.84  | 344   | 1,802.56  | 7,856.96  | - |
| 301069 | 凯盛新材 | 2021年9月16日  | 2022年3月28日 | 新股流通受限 | 5.17  | 44.21  | 539   | 2,786.63  | 23,829.19 | - |
| 301073 | 君亭酒店 | 2021年9月22日  | 2022年3月30日 | 新股流通受限 | 12.24 | 32.00  | 144   | 1,762.56  | 4,608.00  | - |
| 301078 | 孩子王  | 2021年9月30日  | 2022年4月14日 | 新股流通受限 | 5.77  | 12.14  | 756   | 4,362.12  | 9,177.84  | - |
| 301079 | 邵阳液压 | 2021年10月11日 | 2022年4月19日 | 新股流通受限 | 11.92 | 24.82  | 140   | 1,668.80  | 3,474.80  | - |
| 301081 | 严牌股份 | 2021年10月13日 | 2022年4月20日 | 新股流通受限 | 12.95 | 17.44  | 403   | 5,218.85  | 7,028.32  | - |
| 301082 | 久盛电气 | 2021年10月14日 | 2022年4月27日 | 新股流通受限 | 15.48 | 21.53  | 915   | 14,164.20 | 19,699.95 | - |
| 301083 | 百胜智能 | 2021年10月13日 | 2022年4月21日 | 新股流通受限 | 9.08  | 14.21  | 416   | 3,777.28  | 5,911.36  | - |
| 301087 | 可孚医疗 | 2021年10月15日 | 2022年4月25日 | 新股流通受限 | 93.09 | 75.34  | 848   | 78,940.32 | 63,888.32 | - |
| 301088 | 戎美股份 | 2021年10月19日 | 2022年4月28日 | 新股流通受限 | 33.16 | 24.67  | 704   | 23,344.64 | 17,367.68 | - |
| 301089 | 拓新药业 | 2021年10月20日 | 2022年4月27日 | 新股流通受限 | 19.11 | 67.93  | 220   | 4,204.20  | 14,944.60 | - |
| 301090 | 华润材料 | 2021年10月19日 | 2022年4月26日 | 新股流通受限 | 10.45 | 11.22  | 2,764 | 28,883.80 | 31,012.08 | - |
| 301091 | 深城交  | 2021年10月20日 | 2022年4月29日 | 新股流通受限 | 36.50 | 31.31  | 524   | 19,126.00 | 16,406.44 | - |
| 301092 | 争光股份 | 2021年10月21日 | 2022年5月5日  | 新股流通受限 | 36.31 | 35.52  | 323   | 11,728.13 | 11,472.96 | - |

|        |      |             |            |        |        |        |        |              |            |   |
|--------|------|-------------|------------|--------|--------|--------|--------|--------------|------------|---|
| 301093 | 华兰股份 | 2021年10月21日 | 2022年5月5日  | 新股流通受限 | 58.08  | 49.85  | 409    | 23,754.72    | 20,388.65  | - |
| 301096 | 百诚医药 | 2021年12月13日 | 2022年6月20日 | 新股流通受限 | 79.60  | 78.53  | 272    | 21,651.20    | 21,360.16  | - |
| 301098 | 金埔园林 | 2021年11月4日  | 2022年5月12日 | 新股流通受限 | 12.36  | 22.17  | 307    | 3,794.52     | 6,806.19   | - |
| 301099 | 雅创电子 | 2021年11月10日 | 2022年5月23日 | 新股流通受限 | 21.99  | 71.36  | 351    | 7,718.49     | 25,047.36  | - |
| 301100 | 风光股份 | 2021年12月10日 | 2022年6月17日 | 新股流通受限 | 27.81  | 31.14  | 599    | 16,658.19    | 18,652.86  | - |
| 301101 | 明月镜片 | 2021年12月9日  | 2022年6月16日 | 新股流通受限 | 26.91  | 43.36  | 371    | 9,983.61     | 16,086.56  | - |
| 301108 | 洁雅股份 | 2021年11月25日 | 2022年6月6日  | 新股流通受限 | 57.27  | 53.71  | 280    | 16,035.60    | 15,038.80  | - |
| 301111 | 粤万年青 | 2021年11月30日 | 2022年6月7日  | 新股流通受限 | 10.48  | 36.68  | 379    | 3,971.92     | 13,901.72  | - |
| 301118 | 恒光股份 | 2021年11月9日  | 2022年5月18日 | 新股流通受限 | 22.70  | 49.02  | 315    | 7,150.50     | 15,441.30  | - |
| 301126 | 达嘉维康 | 2021年11月30日 | 2022年6月7日  | 新股流通受限 | 12.37  | 19.23  | 662    | 8,188.94     | 12,730.26  | - |
| 301127 | 天源环保 | 2021年12月23日 | 2022年6月30日 | 新股流通受限 | 12.03  | 17.12  | 1,685  | 20,270.55    | 28,847.20  | - |
| 301133 | 金钟股份 | 2021年11月19日 | 2022年5月26日 | 新股流通受限 | 14.33  | 26.95  | 286    | 4,098.38     | 7,707.70   | - |
| 301136 | 招标股份 | 2021年12月31日 | 2022年7月11日 | 新股流通受限 | 10.52  | 10.52  | 7,172  | 75,449.44    | 75,449.44  | - |
| 301138 | 华研精机 | 2021年12月8日  | 2022年6月15日 | 新股流通受限 | 26.17  | 44.86  | 285    | 7,458.45     | 12,785.10  | - |
| 301149 | 隆华新材 | 2021年11月3日  | 2022年5月10日 | 新股流通受限 | 10.07  | 16.76  | 1,214  | 12,224.98    | 20,346.64  | - |
| 301166 | 优宁维  | 2021年12月21日 | 2022年6月28日 | 新股流通受限 | 86.06  | 94.50  | 253    | 21,773.18    | 23,908.50  | - |
| 301168 | 通灵股份 | 2021年12月2日  | 2022年6月10日 | 新股流通受限 | 39.08  | 52.13  | 329    | 12,857.32    | 17,150.77  | - |
| 301177 | 迪阿股份 | 2021年12月8日  | 2022年6月15日 | 新股流通受限 | 116.88 | 116.08 | 792    | 92,568.96    | 91,935.36  | - |
| 301179 | 泽宇智能 | 2021年12月1日  | 2022年6月8日  | 新股流通受限 | 43.99  | 50.77  | 295    | 12,977.05    | 14,977.15  | - |
| 301180 | 万祥科技 | 2021年11月9日  | 2022年5月16日 | 新股流通受限 | 12.20  | 22.72  | 654    | 7,978.80     | 14,858.88  | - |
| 301185 | 鸥玛软件 | 2021年11月11日 | 2022年5月19日 | 新股流通受限 | 11.88  | 21.16  | 578    | 6,866.64     | 12,230.48  | - |
| 301189 | 奥尼电子 | 2021年12月21日 | 2022年6月28日 | 新股流通受限 | 66.18  | 56.62  | 435    | 28,788.30    | 24,629.70  | - |
| 301190 | 善水科技 | 2021年12月17日 | 2022年6月24日 | 新股流通受限 | 27.85  | 27.46  | 575    | 16,013.75    | 15,789.50  | - |
| 301193 | 家联科技 | 2021年12月2日  | 2022年6月9日  | 新股流通受限 | 30.73  | 29.14  | 297    | 9,126.81     | 8,654.58   | - |
| 301198 | 喜悦智行 | 2021年11月25日 | 2022年6月2日  | 新股流通受限 | 21.76  | 29.20  | 262    | 5,701.12     | 7,650.40   | - |
| 301199 | 迈赫股份 | 2021年11月30日 | 2022年6月7日  | 新股流通受限 | 29.28  | 32.00  | 402    | 11,770.56    | 12,864.00  | - |
| 688091 | 上海谊众 | 2021年9月1日   | 2022年3月9日  | 新股流通受限 | 38.10  | 42.81  | 3,294  | 125,501.40   | 141,016.14 | - |
| 688151 | 华强科技 | 2021年11月29日 | 2022年6月6日  | 新股流通受限 | 35.09  | 33.82  | 12,238 | 429,431.42   | 413,889.16 | - |
| 688226 | 威腾电气 | 2021年6月28日  | 2022年1月7日  | 新股流通受限 | 6.42   | 15.76  | 2,693  | 17,289.06    | 42,441.68  | - |
| 688236 | 春立医疗 | 2021年12月23日 | 2022年6月30日 | 新股流通受限 | 29.81  | 26.43  | 4,052  | 120,790.12   | 107,094.36 | - |
| 688262 | 国芯科技 | 2021年12月28日 | 2022年1月6日  | 新股未上市  | 41.98  | 41.98  | 7,129  | 299,275.42   | 299,275.42 | - |
| 688285 | 高铁电气 | 2021年10月12日 | 2022年4月20日 | 新股流通受限 | 7.18   | 9.14   | 15,159 | 108,841.62   | 138,553.26 | - |
| 688305 | 科德数控 | 2021年7月2日   | 2022年1月10日 | 新股流通受限 | 11.03  | 105.68 | 1,496  | 16,500.88    | 158,097.28 | - |
| 688739 | 成大生物 | 2021年10月21日 | 2022年4月28日 | 新股流通受限 | 110.00 | 70.32  | 9,882  | 1,087,020.00 | 694,902.24 | - |
| 688776 | 国光电气 | 2021年8月24日  | 2022年3月1日  | 新股流通受限 | 51.44  | 184.99 | 1,447  | 74,433.68    | 267,680.53 | - |

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

| 证券代码   | 证券名称 | 成功认购日       | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格   | 期末估值单价 | 数量<br>(单位:张) | 期末成本总额       | 期末估值总额       | 备注 |
|--------|------|-------------|------------|--------|--------|--------|--------------|--------------|--------------|----|
| 113052 | 兴业转债 | 2021年12月27日 | 2022年1月14日 | 新债未上市  | 100.00 | 100.00 | 33,330       | 3,333,000.00 | 3,333,000.00 | -  |

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行

办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的 2020 年 2 月 14 日前发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 12 个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股份，采取集中竞价交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 1%，且自股份解除限售之日起 12 个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股份数量的 50%；采取大宗交易方式的，在任意连续 90 日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的 2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的 2020 年 2 月 14 日(含)后发行完毕的非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股份不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、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。

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

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

5、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。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 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。

#### 7.4.12.3.2 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。

### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码   | 证券名称 | 出借到期日                 | 期末估值单价 | 数量(单位:股) | 期末估值总额       |
|----|--------|------|-----------------------|--------|----------|--------------|
| 1  | 000625 | 长安汽车 | 2022年1月4日             | 15.19  | 4,300    | 65,317.00    |
| 2  | 000768 | 中航西飞 | 2022年1月14日            | 36.50  | 27,700   | 1,011,050.00 |
| 3  | 000876 | 新希望  | 2022年1月5日             | 15.21  | 45,000   | 684,450.00   |
| 4  | 600010 | 包钢股份 | 2022年1月10日-2022年1月12日 | 2.79   | 194,600  | 542,934.00   |
| 5  | 600025 | 华能水电 | 2022年1月10日            | 6.59   | 35,000   | 230,650.00   |
| 6  | 600588 | 用友网络 | 2022年1月13日            | 35.88  | 30,000   | 1,076,400.00 |
| 7  | 601238 | 广汽集团 | 2022年1月4日-2022年1月11日  | 15.19  | 40,000   | 607,600.00   |
| 8  | 601985 | 中国核电 | 2022年1月14日            | 8.30   | 100,000  | 830,000.00   |
| 9  | 601989 | 中国重工 | 2022年1月5日-2022年1月14日  | 4.22   | 66,700   | 281,474.00   |
| 合计 | -      | -    | -                     | -      | 543,300  | 5,329,875.00 |

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 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。

本基金管理人建立了以董事会风险管理委员会为核心的，由董事会风险管理委员会、经营管理层及各具体业务部门组成的三道风险监控防线；并在后两道监控防线中，由独立于公司管理层和其他业务部门的督察长和监察稽核部对公司合规风险状况及各部门风险控制措施进行检查、监督及报告。

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。

#### 7.4.13.2 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。

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，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易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。

#### 7.4.13.3 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 7.4.12.3 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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30% (完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 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度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



| 本期末<br>2021 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                    | 28,737,679.02 | -     | -            | -                | 28,737,679.02    |
| 结算备付金                   | 403,278.51    | -     | -            | -                | 403,278.51       |
| 存出保证金                   | 86,632.04     | -     | -            | -                | 86,632.04        |
| 交易性金融资产                 | -             | -     | 3,333,000.00 | 2,483,293,632.36 | 2,486,626,632.36 |
| 应收利息                    | -             | -     | -            | 12,180.13        | 12,180.13        |
| 应收股利                    | -             | -     | -            | 30,832.00        | 30,832.00        |
| 应收证券清算款                 | -             | -     | -            | 105,782.15       | 105,782.15       |
| 资产总计                    | 29,227,589.57 | -     | 3,333,000.00 | 2,483,442,426.64 | 2,516,003,016.21 |
| 负债                      |               |       |              |                  |                  |
| 应付管理人报酬                 | -             | -     | -            | 1,086,807.22     | 1,086,807.22     |
| 应付托管费                   | -             | -     | -            | 217,361.43       | 217,361.43       |
| 应付证券清算款                 | -             | -     | -            | 597,595.93       | 597,595.93       |
| 应付交易费用                  | -             | -     | -            | 256,167.87       | 256,167.87       |
| 应交税费                    | -             | -     | -            | 215.34           | 215.34           |
| 其他负债                    | -             | -     | -            | 417,350.85       | 417,350.85       |
| 负债总计                    | -             | -     | -            | 2,575,498.64     | 2,575,498.64     |
| 利率敏感度缺口                 | 29,227,589.57 | -     | 3,333,000.00 | 2,480,866,928.00 | 2,513,427,517.57 |

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资和资产支持证券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.13%，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动发生波动的风险。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金的基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |              |                |    |
|----------|-------------------------|--------------|----------------|----|
|          | 美元<br>折合人民币元            | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 |                         |              |                |    |

|               |   |                |   |                |
|---------------|---|----------------|---|----------------|
| 交易性金融资产       | - | 585,732,449.22 | - | 585,732,449.22 |
| 资产合计          | - | 585,732,449.22 | - | 585,732,449.22 |
| 以外币计价的负债      |   |                |   |                |
| 负债合计          | - | -              | - | -              |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 585,732,449.22 | - | 585,732,449.22 |

#### 7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

|    |                                 |                             |
|----|---------------------------------|-----------------------------|
| 假设 | 假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；       |                             |
|    | 此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。 |                             |
|    | 相关风险变量的变动                       | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） |
|    |                                 | 本期末（2021 年 12 月 31 日）       |
| 分析 | +5 个基准点                         | 29,286,622.46               |
|    | -5 个基准点                         | -29,286,622.46              |

注：此表为外汇风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，汇率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的股票公允价值的变动对基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目            | 本期末<br>2021 年 12 月 31 日 |               |
|---------------|-------------------------|---------------|
|               | 公允价值                    | 占基金资产净值比例 (%) |
| 交易性金融资产—股票投资  | 2,483,293,632.36        | 98.80         |
| 交易性金融资产—基金投资  | -                       | -             |
| 交易性金融资产—债券投资  | 3,333,000.00            | 0.13          |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | -                       | -             |
| 衍生金融资产—权证投资   | -                       | -             |
| 其他            | -                       | -             |
| 合计            | 2,486,626,632.36        | 98.93         |

## 7.4.13.4.3.2 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。 |                                 |
|    | 相关风险变量的变动                                  | 对资产负债表日基金资产净值的<br>影响金额（单位：人民币元） |
|    |  | 本期末（2021 年 12 月 31 日）           |
| 分析 | +5 个基准点                                    | 124,414,662.12                  |
|    | -5 个基准点                                    | -124,414,662.12                 |

## 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的

金融资产中属于第一层次的余额为 2,479,778,613.23 元，属于第二层次的余额为 3,713,229.35 元，属于第三层次的余额为 3,134,789.78 元。

(ii) 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。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

本基金对于证券交易所上市但尚在限售期间的股票进行估值所用的流动性折扣采用了平均价格亚式期权模型估值技术，不可观察输入值为该流通受限股票在剩余限售期内的股价的预期年化波动率，与公允价值为负相关关系。

于 2021 年度，本基金购买第三层次交易性金融资产 2,713,051.13 元，计入损益的利得或损失总额 421,738.65 元，于 2021 年 12 月 31 日本基金持有的第三层次交易性金融资产公允价值为 3,134,789.78 元，于 2021 年 12 月 31 日仍持有的资产计入 2021 年度损益的未实现利得或损失的变动为 421,738.65 元，计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动收益项目。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在

影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

### (3) 其他事项

截至资产负债表日，本基金除公允价值和执行新金融工具准则外，无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目                | 金额               | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|------------------|---------------|
| 1  | 权益投资              | 2,483,293,632.36 | 98.70         |
|    | 其中：股票             | 2,483,293,632.36 | 98.70         |
| 2  | 基金投资              | -                | -             |
| 3  | 固定收益投资            | 3,333,000.00     | 0.13          |
|    | 其中：债券             | 3,333,000.00     | 0.13          |
|    | 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      | 29,140,957.53    | 1.16          |
| 8  | 其他各项资产            | 235,426.32       | 0.01          |
| 9  | 合计                | 2,516,003,016.21 | 100.00        |

注：1. 上述表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额为人民币 585,732,449.22 元，占基金净资产的比例为 23.30%。

2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 5,329,875.00 元，占基金资产净值的比例为 0.21%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别     | 公允价值（元）          | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|----------|------------------|---------------|
| A  | 农、林、牧、渔业 | 21,496,638.16    | 0.86          |
| B  | 采矿业      | 41,816,420.10    | 1.66          |
| C  | 制造业      | 1,131,960,279.30 | 45.04         |

|   |                  |                  |       |
|---|------------------|------------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 40,878,526.00    | 1.63  |
| E | 建筑业              | 31,136,246.99    | 1.24  |
| F | 批发和零售业           | 193,376.00       | 0.01  |
| G | 交通运输、仓储和邮政业      | 48,790,525.39    | 1.94  |
| H | 住宿和餐饮业           | 4,608.00         | 0.00  |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业  | 61,432,094.01    | 2.44  |
| J | 金融业              | 407,638,763.85   | 16.22 |
| K | 房地产业             | 30,036,483.00    | 1.20  |
| L | 租赁和商务服务业         | 28,270,978.00    | 1.12  |
| M | 科学研究和技术服务业       | 33,186,982.66    | 1.32  |
| N | 水利、环境和公共设施管理业    | 50,198.91        | 0.00  |
| O | 居民服务、修理和其他服务业    | -                | -     |
| P | 教育               | 1,389,648.00     | 0.06  |
| Q | 卫生和社会工作          | 15,153,219.18    | 0.60  |
| R | 文化、体育和娱乐业        | 4,126,195.59     | 0.16  |
| S | 综合               | -                | -     |
|   | 合计               | 1,897,561,183.14 | 75.50 |

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别    | 公允价值（人民币）      | 占基金资产净值比例（%） |
|---------|----------------|--------------|
| 基础材料    | 1,079,980.10   | 0.04         |
| 消费者非必需品 | 95,525,509.32  | 3.80         |
| 消费者常用品  | 28,289,217.55  | 1.13         |
| 能源      | 8,540,952.11   | 0.34         |
| 金融      | 180,831,952.34 | 7.19         |
| 医疗保健    | 30,856,583.74  | 1.23         |
| 工业      | 25,514,070.57  | 1.02         |
| 信息技术    | 31,063,040.02  | 1.24         |
| 电信服务    | 126,589,637.55 | 5.04         |
| 公用事业    | 21,651,987.35  | 0.86         |
| 地产建筑业   | 35,789,518.57  | 1.42         |
| 合计      | 585,732,449.22 | 23.30        |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 8.3 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

#### 8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 数量（股）   | 公允价值（元）        | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|---------|----------------|--------------|
| 1  | 600519 | 贵州茅台 | 59,900  | 122,795,000.00 | 4.89         |
| 2  | 00700  | 腾讯控股 | 297,100 | 110,960,812.93 | 4.41         |
| 3  | 300750 | 宁德时代 | 133,202 | 78,322,776.00  | 3.12         |

|    |        |       |           |               |      |
|----|--------|-------|-----------|---------------|------|
| 4  | 600036 | 招商银行  | 1,178,600 | 57,409,606.00 | 2.28 |
| 4  | 03968  | 招商银行  | 203,000   | 10,049,653.04 | 0.40 |
| 5  | 601318 | 中国平安  | 1,031,100 | 51,977,751.00 | 2.07 |
| 5  | 02318  | 中国平安  | 329,500   | 15,126,765.08 | 0.60 |
| 6  | 03690  | 美团-W  | 271,000   | 49,941,787.84 | 1.99 |
| 7  | 000858 | 五粮液   | 184,659   | 41,116,172.94 | 1.64 |
| 8  | 601012 | 隆基股份  | 412,300   | 35,540,260.00 | 1.41 |
| 9  | 00005  | 汇丰控股  | 913,200   | 35,017,055.81 | 1.39 |
| 10 | 01299  | 友邦保险  | 534,600   | 34,355,192.26 | 1.37 |
| 11 | 000333 | 美的集团  | 465,175   | 34,334,566.75 | 1.37 |
| 12 | 002594 | 比亚迪   | 86,300    | 23,138,756.00 | 0.92 |
| 12 | 01211  | 比亚迪股份 | 39,000    | 8,500,914.24  | 0.34 |
| 13 | 601398 | 工商银行  | 3,338,000 | 15,454,940.00 | 0.61 |
| 13 | 01398  | 工商银行  | 3,835,000 | 13,796,182.40 | 0.55 |
| 14 | 300059 | 东方财富  | 787,037   | 29,206,943.07 | 1.16 |
| 15 | 601166 | 兴业银行  | 1,383,900 | 26,349,456.00 | 1.05 |
| 16 | 600900 | 长江电力  | 1,082,800 | 24,579,560.00 | 0.98 |
| 17 | 00939  | 建设银行  | 5,310,000 | 23,443,862.40 | 0.93 |
| 18 | 002415 | 海康威视  | 444,500   | 23,256,240.00 | 0.93 |
| 19 | 603259 | 药明康德  | 195,160   | 23,142,072.80 | 0.92 |
| 20 | 002475 | 立讯精密  | 469,906   | 23,119,375.20 | 0.92 |
| 21 | 600276 | 恒瑞医药  | 426,358   | 21,620,614.18 | 0.86 |
| 22 | 600030 | 中信证券  | 811,600   | 21,434,356.00 | 0.85 |
| 23 | 00388  | 香港交易所 | 56,100    | 20,887,995.74 | 0.83 |
| 24 | 601888 | 中国中免  | 92,900    | 20,383,189.00 | 0.81 |
| 25 | 600887 | 伊利股份  | 487,300   | 20,203,458.00 | 0.80 |
| 26 | 000568 | 泸州老窖  | 69,700    | 17,694,739.00 | 0.70 |
| 27 | 300760 | 迈瑞医疗  | 46,400    | 17,669,120.00 | 0.70 |
| 28 | 000651 | 格力电器  | 450,592   | 16,685,421.76 | 0.66 |
| 29 | 603501 | 韦尔股份  | 49,500    | 15,383,115.00 | 0.61 |
| 30 | 000001 | 平安银行  | 924,500   | 15,235,760.00 | 0.61 |
| 31 | 600309 | 万华化学  | 149,300   | 15,079,300.00 | 0.60 |
| 32 | 601328 | 交通银行  | 2,615,300 | 12,056,533.00 | 0.48 |
| 32 | 03328  | 交通银行  | 777,000   | 2,992,146.19  | 0.12 |
| 33 | 600809 | 山西汾酒  | 46,640    | 14,727,979.20 | 0.59 |
| 34 | 03988  | 中国银行  | 3,700,000 | 8,500,587.20  | 0.34 |
| 34 | 601988 | 中国银行  | 2,004,700 | 6,114,335.00  | 0.24 |
| 35 | 002142 | 宁波银行  | 377,452   | 14,448,862.56 | 0.57 |
| 36 | 300274 | 阳光电源  | 99,000    | 14,434,200.00 | 0.57 |
| 37 | 000725 | 京东方 A | 2,857,200 | 14,428,860.00 | 0.57 |
| 38 | 02269  | 药明生物  | 187,500   | 14,187,915.00 | 0.56 |
| 39 | 600690 | 海尔智家  | 360,700   | 10,781,323.00 | 0.43 |

|    |        |        |           |               |      |
|----|--------|--------|-----------|---------------|------|
| 39 | 06690  | 海尔智家   | 124,400   | 3,351,326.05  | 0.13 |
| 40 | 688981 | 中芯国际   | 184,800   | 9,792,552.00  | 0.39 |
| 40 | 00981  | 中芯国际   | 263,500   | 4,020,065.62  | 0.16 |
| 41 | 002714 | 牧原股份   | 250,181   | 13,349,658.16 | 0.53 |
| 42 | 601899 | 紫金矿业   | 1,371,203 | 13,300,669.10 | 0.53 |
| 43 | 600031 | 三一重工   | 565,700   | 12,897,960.00 | 0.51 |
| 44 | 002352 | 顺丰控股   | 186,990   | 12,887,350.80 | 0.51 |
| 45 | 601288 | 农业银行   | 3,343,700 | 9,830,478.00  | 0.39 |
| 45 | 01288  | 农业银行   | 1,359,000 | 2,977,797.31  | 0.12 |
| 46 | 000002 | 万科 A   | 647,700   | 12,798,552.00 | 0.51 |
| 47 | 300014 | 亿纬锂能   | 107,938   | 12,756,112.84 | 0.51 |
| 48 | 002812 | 恩捷股份   | 50,900    | 12,745,360.00 | 0.51 |
| 49 | 603288 | 海天味业   | 120,312   | 12,645,994.32 | 0.50 |
| 50 | 600436 | 片仔癀    | 28,800    | 12,589,920.00 | 0.50 |
| 51 | 002241 | 歌尔股份   | 227,890   | 12,328,849.00 | 0.49 |
| 52 | 300124 | 汇川技术   | 174,800   | 11,991,280.00 | 0.48 |
| 53 | 01810  | 小米集团-W | 772,400   | 11,935,619.14 | 0.47 |
| 54 | 600438 | 通威股份   | 257,020   | 11,555,619.20 | 0.46 |
| 55 | 600837 | 海通证券   | 919,400   | 11,271,844.00 | 0.45 |
| 56 | 601919 | 中远海控   | 601,970   | 11,250,819.30 | 0.45 |
| 57 | 002460 | 赣锋锂业   | 76,465    | 10,923,025.25 | 0.43 |
| 58 | 300015 | 爱尔眼科   | 256,980   | 10,865,114.40 | 0.43 |
| 59 | 600048 | 保利发展   | 684,500   | 10,698,735.00 | 0.43 |
| 60 | 600406 | 国电南瑞   | 263,600   | 10,551,908.00 | 0.42 |
| 61 | 002466 | 天齐锂业   | 98,500    | 10,539,500.00 | 0.42 |
| 62 | 00941  | 中国移动   | 272,000   | 10,407,720.96 | 0.41 |
| 63 | 00669  | 创科实业   | 81,000    | 10,278,213.12 | 0.41 |
| 64 | 603799 | 华友钴业   | 93,000    | 10,258,830.00 | 0.41 |
| 65 | 000063 | 中兴通讯   | 302,500   | 10,133,750.00 | 0.40 |
| 66 | 601668 | 中国建筑   | 1,997,400 | 9,987,000.00  | 0.40 |
| 67 | 600703 | 三安光电   | 255,500   | 9,596,580.00  | 0.38 |
| 68 | 600000 | 浦发银行   | 1,118,900 | 9,544,217.00  | 0.38 |
| 69 | 600111 | 北方稀土   | 207,500   | 9,503,500.00  | 0.38 |
| 70 | 300122 | 智飞生物   | 76,100    | 9,482,060.00  | 0.38 |
| 71 | 002304 | 洋河股份   | 57,300    | 9,439,029.00  | 0.38 |
| 72 | 600016 | 民生银行   | 2,362,949 | 9,215,501.10  | 0.37 |
| 73 | 600585 | 海螺水泥   | 228,600   | 9,212,580.00  | 0.37 |
| 74 | 002230 | 科大讯飞   | 174,896   | 9,183,788.96  | 0.37 |
| 75 | 600104 | 上汽集团   | 445,000   | 9,180,350.00  | 0.37 |
| 76 | 600745 | 闻泰科技   | 71,000    | 9,180,300.00  | 0.37 |
| 77 | 002049 | 紫光国微   | 40,300    | 9,067,500.00  | 0.36 |
| 78 | 601816 | 京沪高铁   | 1,871,400 | 9,038,862.00  | 0.36 |



|     |        |          |           |              |      |
|-----|--------|----------|-----------|--------------|------|
| 79  | 002129 | 中环股份     | 215,400   | 8,992,950.00 | 0.36 |
| 80  | 603986 | 兆易创新     | 50,746    | 8,923,684.10 | 0.36 |
| 81  | 002271 | 东方雨虹     | 168,200   | 8,860,776.00 | 0.35 |
| 82  | 601601 | 中国太保     | 325,600   | 8,830,272.00 | 0.35 |
| 83  | 600028 | 中国石化     | 1,275,800 | 5,396,634.00 | 0.21 |
| 83  | 00386  | 中国石油化工股份 | 1,128,000 | 3,347,777.66 | 0.13 |
| 84  | 601688 | 华泰证券     | 490,800   | 8,716,608.00 | 0.35 |
| 85  | 002371 | 北方华创     | 25,100    | 8,710,202.00 | 0.35 |
| 86  | 000661 | 长春高新     | 30,900    | 8,386,260.00 | 0.33 |
| 87  | 300142 | 沃森生物     | 149,000   | 8,373,800.00 | 0.33 |
| 88  | 601628 | 中国人寿     | 158,700   | 4,775,283.00 | 0.19 |
| 88  | 02628  | 中国人寿     | 328,000   | 3,464,792.58 | 0.14 |
| 89  | 000100 | TCL 科技   | 1,334,500 | 8,233,865.00 | 0.33 |
| 90  | 300498 | 温氏股份     | 423,000   | 8,146,980.00 | 0.32 |
| 91  | 02331  | 李宁       | 116,000   | 8,094,730.56 | 0.32 |
| 92  | 000338 | 潍柴动力     | 451,833   | 8,083,292.37 | 0.32 |
| 93  | 600893 | 航发动力     | 126,955   | 8,056,564.30 | 0.32 |
| 94  | 002027 | 分众传媒     | 963,100   | 7,887,789.00 | 0.31 |
| 95  | 300450 | 先导智能     | 104,400   | 7,764,228.00 | 0.31 |
| 96  | 601211 | 国泰君安     | 429,800   | 7,689,122.00 | 0.31 |
| 97  | 601658 | 邮储银行     | 1,037,300 | 5,290,230.00 | 0.21 |
| 97  | 01658  | 邮储银行     | 525,000   | 2,347,942.80 | 0.09 |
| 98  | 300782 | 卓胜微      | 22,260    | 7,274,568.00 | 0.29 |
| 99  | 601088 | 中国神华     | 314,100   | 7,073,532.00 | 0.28 |
| 100 | 601766 | 中国中车     | 1,156,300 | 7,041,867.00 | 0.28 |
| 101 | 600050 | 中国联通     | 1,768,700 | 6,950,991.00 | 0.28 |
| 102 | 600570 | 恒生电子     | 111,440   | 6,925,996.00 | 0.28 |
| 103 | 000776 | 广发证券     | 281,600   | 6,924,544.00 | 0.28 |
| 104 | 02382  | 舜宇光学科技   | 34,000    | 6,855,085.44 | 0.27 |
| 105 | 601229 | 上海银行     | 948,252   | 6,761,036.76 | 0.27 |
| 106 | 09633  | 农夫山泉     | 156,000   | 6,562,221.12 | 0.26 |
| 107 | 600919 | 江苏银行     | 1,124,700 | 6,557,001.00 | 0.26 |
| 108 | 300347 | 泰格医药     | 49,800    | 6,364,440.00 | 0.25 |
| 109 | 600660 | 福耀玻璃     | 133,844   | 6,309,406.16 | 0.25 |
| 110 | 601169 | 北京银行     | 1,411,800 | 6,268,392.00 | 0.25 |
| 111 | 002709 | 天赐材料     | 54,600    | 6,259,890.00 | 0.25 |
| 112 | 600999 | 招商证券     | 353,300   | 6,235,745.00 | 0.25 |
| 113 | 600905 | 三峡能源     | 814,500   | 6,116,895.00 | 0.24 |
| 114 | 002821 | 凯莱英      | 14,000    | 6,090,000.00 | 0.24 |
| 115 | 600019 | 宝钢股份     | 846,400   | 6,060,224.00 | 0.24 |
| 116 | 600010 | 包钢股份     | 2,168,800 | 6,050,952.00 | 0.24 |
| 117 | 601669 | 中国电建     | 727,500   | 5,878,200.00 | 0.23 |

|     |        |        |           |              |      |
|-----|--------|--------|-----------|--------------|------|
| 118 | 600958 | 东方证券   | 398,300   | 5,870,942.00 | 0.23 |
| 119 | 002311 | 海大集团   | 78,985    | 5,789,600.50 | 0.23 |
| 120 | 002410 | 广联达    | 90,392    | 5,783,280.16 | 0.23 |
| 121 | 00002  | 中电控股   | 89,500    | 5,762,547.00 | 0.23 |
| 122 | 02020  | 安踏体育   | 59,800    | 5,715,530.91 | 0.23 |
| 123 | 601633 | 长城汽车   | 116,700   | 5,664,618.00 | 0.23 |
| 124 | 002459 | 晶澳科技   | 60,800    | 5,636,160.00 | 0.22 |
| 125 | 600196 | 复星医药   | 115,000   | 5,628,100.00 | 0.22 |
| 126 | 601390 | 中国中铁   | 967,900   | 5,604,141.00 | 0.22 |
| 127 | 600588 | 用友网络   | 155,643   | 5,584,470.84 | 0.22 |
| 128 | 601985 | 中国核电   | 668,400   | 5,547,720.00 | 0.22 |
| 129 | 601877 | 正泰电器   | 102,394   | 5,518,012.66 | 0.22 |
| 130 | 000625 | 长安汽车   | 362,283   | 5,503,078.77 | 0.22 |
| 131 | 000166 | 申万宏源   | 1,071,600 | 5,486,592.00 | 0.22 |
| 132 | 603659 | 璞泰来    | 33,000    | 5,300,130.00 | 0.21 |
| 133 | 002179 | 中航光电   | 52,200    | 5,249,232.00 | 0.21 |
| 134 | 002493 | 荣盛石化   | 289,050   | 5,249,148.00 | 0.21 |
| 135 | 601818 | 光大银行   | 1,571,200 | 5,216,384.00 | 0.21 |
| 136 | 000895 | 双汇发展   | 165,100   | 5,208,905.00 | 0.21 |
| 137 | 00883  | 中国海洋石油 | 791,000   | 5,193,174.45 | 0.21 |
| 138 | 000538 | 云南白药   | 48,600    | 5,085,990.00 | 0.20 |
| 139 | 02319  | 蒙牛乳业   | 139,000   | 5,023,170.88 | 0.20 |
| 140 | 00016  | 新鸿基地产  | 64,500    | 4,988,749.92 | 0.20 |
| 141 | 06160  | 百济神州   | 37,700    | 4,962,586.72 | 0.20 |
| 142 | 00003  | 香港中华煤气 | 495,550   | 4,918,662.80 | 0.20 |
| 143 | 02313  | 申洲国际   | 40,000    | 4,902,329.60 | 0.20 |
| 144 | 300408 | 三环集团   | 109,500   | 4,883,700.00 | 0.19 |
| 145 | 00001  | 长和     | 118,500   | 4,873,345.68 | 0.19 |
| 146 | 000768 | 中航西飞   | 131,600   | 4,803,400.00 | 0.19 |
| 147 | 603806 | 福斯特    | 36,095    | 4,712,202.25 | 0.19 |
| 148 | 688111 | 金山办公   | 17,600    | 4,664,000.00 | 0.19 |
| 149 | 600346 | 恒力石化   | 201,400   | 4,626,158.00 | 0.18 |
| 150 | 601989 | 中国重工   | 1,085,900 | 4,582,498.00 | 0.18 |
| 151 | 002001 | 新和成    | 147,240   | 4,582,108.80 | 0.18 |
| 152 | 601857 | 中国石油   | 925,100   | 4,542,241.00 | 0.18 |
| 153 | 00175  | 吉利汽车   | 260,000   | 4,527,868.80 | 0.18 |
| 154 | 601138 | 工业富联   | 379,200   | 4,520,064.00 | 0.18 |
| 155 | 601225 | 陕西煤业   | 369,300   | 4,505,460.00 | 0.18 |
| 156 | 300896 | 爱美客    | 8,300     | 4,449,713.00 | 0.18 |
| 157 | 300433 | 蓝思科技   | 189,700   | 4,359,306.00 | 0.17 |
| 158 | 01024  | 快手-W   | 73,800    | 4,347,416.30 | 0.17 |
| 159 | 002050 | 三花智控   | 170,500   | 4,313,650.00 | 0.17 |

|     |        |       |           |              |      |
|-----|--------|-------|-----------|--------------|------|
| 160 | 600009 | 上海机场  | 91,741    | 4,283,387.29 | 0.17 |
| 161 | 601009 | 南京银行  | 476,900   | 4,273,024.00 | 0.17 |
| 162 | 600763 | 通策医疗  | 21,457    | 4,269,943.00 | 0.17 |
| 163 | 600741 | 华域汽车  | 150,200   | 4,250,660.00 | 0.17 |
| 164 | 01109  | 华润置地  | 158,000   | 4,237,130.24 | 0.17 |
| 165 | 600150 | 中国船舶  | 170,100   | 4,216,779.00 | 0.17 |
| 166 | 02688  | 新奥能源  | 34,900    | 4,188,826.43 | 0.17 |
| 167 | 600176 | 中国巨石  | 228,300   | 4,155,060.00 | 0.17 |
| 168 | 300413 | 芒果超媒  | 71,300    | 4,079,786.00 | 0.16 |
| 169 | 601100 | 恒立液压  | 49,500    | 4,049,100.00 | 0.16 |
| 170 | 001979 | 招商蛇口  | 302,400   | 4,034,016.00 | 0.16 |
| 171 | 002236 | 大华股份  | 170,600   | 4,005,688.00 | 0.16 |
| 172 | 00011  | 恒生银行  | 33,900    | 3,955,164.53 | 0.16 |
| 173 | 02388  | 中银香港  | 187,500   | 3,916,815.00 | 0.16 |
| 174 | 01113  | 长实集团  | 96,500    | 3,877,856.36 | 0.15 |
| 175 | 300601 | 康泰生物  | 39,200    | 3,862,768.00 | 0.15 |
| 176 | 600760 | 中航沈飞  | 55,820    | 3,797,992.80 | 0.15 |
| 177 | 300454 | 深信服   | 19,800    | 3,781,800.00 | 0.15 |
| 178 | 00291  | 华润啤酒  | 72,000    | 3,758,670.72 | 0.15 |
| 179 | 603993 | 洛阳钼业  | 672,300   | 3,751,434.00 | 0.15 |
| 180 | 600989 | 宝丰能源  | 209,700   | 3,640,392.00 | 0.14 |
| 181 | 688008 | 澜起科技  | 43,267    | 3,628,803.29 | 0.14 |
| 182 | 600926 | 杭州银行  | 282,600   | 3,622,932.00 | 0.14 |
| 183 | 601066 | 中信建投  | 123,800   | 3,621,150.00 | 0.14 |
| 184 | 601006 | 大秦铁路  | 565,000   | 3,616,000.00 | 0.14 |
| 185 | 688036 | 传音控股  | 22,867    | 3,587,832.30 | 0.14 |
| 186 | 300759 | 康龙化成  | 24,900    | 3,517,623.00 | 0.14 |
| 187 | 003816 | 中国广核  | 1,122,700 | 3,514,051.00 | 0.14 |
| 188 | 601360 | 三六零   | 272,600   | 3,467,472.00 | 0.14 |
| 189 | 600132 | 重庆啤酒  | 22,900    | 3,465,228.00 | 0.14 |
| 190 | 000786 | 北新建材  | 96,200    | 3,446,846.00 | 0.14 |
| 191 | 601186 | 中国铁建  | 437,800   | 3,414,840.00 | 0.14 |
| 192 | 06098  | 碧桂园服务 | 89,000    | 3,398,190.88 | 0.14 |
| 193 | 000157 | 中联重科  | 472,000   | 3,384,240.00 | 0.13 |
| 194 | 601868 | 中国能建  | 1,231,800 | 3,362,814.00 | 0.13 |
| 195 | 603486 | 科沃斯   | 21,700    | 3,275,615.00 | 0.13 |
| 196 | 600029 | 南方航空  | 480,800   | 3,274,248.00 | 0.13 |
| 197 | 600015 | 华夏银行  | 584,100   | 3,270,960.00 | 0.13 |
| 198 | 000876 | 新希望   | 214,800   | 3,267,108.00 | 0.13 |
| 199 | 002601 | 龙佰集团  | 113,800   | 3,253,542.00 | 0.13 |
| 200 | 600547 | 山东黄金  | 172,500   | 3,246,450.00 | 0.13 |
| 201 | 00027  | 银河娱乐  | 96,000    | 3,170,979.84 | 0.13 |

|     |        |          |         |              |      |
|-----|--------|----------|---------|--------------|------|
| 202 | 601238 | 广汽集团     | 208,200 | 3,162,558.00 | 0.13 |
| 203 | 002736 | 国信证券     | 274,400 | 3,150,112.00 | 0.13 |
| 204 | 601901 | 方正证券     | 393,004 | 3,081,151.36 | 0.12 |
| 205 | 601336 | 新华保险     | 79,100  | 3,075,408.00 | 0.12 |
| 206 | 002007 | 华兰生物     | 104,160 | 3,035,222.40 | 0.12 |
| 207 | 688012 | 中微公司     | 23,576  | 2,984,721.60 | 0.12 |
| 208 | 01093  | 石药集团     | 422,000 | 2,922,380.38 | 0.12 |
| 209 | 00688  | 中国海外发展   | 193,500 | 2,920,475.38 | 0.12 |
| 210 | 601800 | 中国交建     | 335,400 | 2,877,732.00 | 0.11 |
| 211 | 000596 | 古井贡酒     | 11,700  | 2,854,800.00 | 0.11 |
| 212 | 06618  | 京东健康     | 56,700  | 2,848,694.18 | 0.11 |
| 213 | 00066  | 港铁公司     | 82,500  | 2,822,866.20 | 0.11 |
| 214 | 002938 | 鹏鼎控股     | 66,100  | 2,804,623.00 | 0.11 |
| 215 | 300628 | 亿联网络     | 34,100  | 2,777,445.00 | 0.11 |
| 216 | 000301 | 东方盛虹     | 138,600 | 2,680,524.00 | 0.11 |
| 217 | 600918 | 中泰证券     | 266,200 | 2,654,014.00 | 0.11 |
| 218 | 00006  | 电能实业     | 66,000  | 2,622,533.76 | 0.10 |
| 219 | 01177  | 中国生物制药   | 585,000 | 2,611,496.16 | 0.10 |
| 220 | 601111 | 中国国航     | 285,400 | 2,605,702.00 | 0.10 |
| 221 | 06969  | 思摩尔国际    | 80,000  | 2,599,968.00 | 0.10 |
| 222 | 300999 | 金龙鱼      | 41,300  | 2,599,009.00 | 0.10 |
| 223 | 01997  | 九龙仓置业    | 80,000  | 2,590,156.80 | 0.10 |
| 224 | 603392 | 万泰生物     | 11,620  | 2,573,830.00 | 0.10 |
| 225 | 00968  | 信义光能     | 238,000 | 2,572,463.94 | 0.10 |
| 226 | 002841 | 视源股份     | 31,500  | 2,564,100.00 | 0.10 |
| 227 | 01801  | 信达生物     | 64,500  | 2,544,473.40 | 0.10 |
| 228 | 603833 | 欧派家居     | 17,200  | 2,537,000.00 | 0.10 |
| 229 | 601155 | 新城控股     | 86,000  | 2,505,180.00 | 0.10 |
| 230 | 00960  | 龙湖集团     | 81,000  | 2,430,479.52 | 0.10 |
| 231 | 00267  | 中信股份     | 385,000 | 2,423,775.20 | 0.10 |
| 232 | 00268  | 金蝶国际     | 123,000 | 2,413,555.20 | 0.10 |
| 233 | 02618  | 京东物流     | 108,800 | 2,352,856.58 | 0.09 |
| 234 | 00992  | 联想集团     | 320,000 | 2,344,222.72 | 0.09 |
| 235 | 02007  | 碧桂园      | 410,000 | 2,319,694.72 | 0.09 |
| 236 | 688561 | 奇安信      | 26,000  | 2,285,920.00 | 0.09 |
| 237 | 00322  | 康师傅控股    | 174,000 | 2,279,043.65 | 0.09 |
| 238 | 603899 | 晨光文具     | 35,300  | 2,277,203.00 | 0.09 |
| 239 | 01928  | 金沙中国有限公司 | 143,200 | 2,126,178.61 | 0.08 |
| 240 | 688169 | 石头科技     | 2,600   | 2,113,800.00 | 0.08 |
| 241 | 603260 | 合盛硅业     | 15,300  | 2,019,141.00 | 0.08 |
| 242 | 00868  | 信义玻璃     | 125,000 | 1,992,900.00 | 0.08 |
| 243 | 000708 | 中信特钢     | 96,600  | 1,978,368.00 | 0.08 |

|     |        |        |         |              |      |
|-----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 244 | 601728 | 中国电信   | 444,800 | 1,925,984.00 | 0.08 |
| 245 | 688126 | 沪硅产业   | 71,300  | 1,840,966.00 | 0.07 |
| 246 | 600018 | 上港集团   | 334,700 | 1,834,156.00 | 0.07 |
| 247 | 00012  | 恒基地产   | 64,000  | 1,737,236.48 | 0.07 |
| 248 | 06186  | 中国飞鹤   | 196,000 | 1,676,210.82 | 0.07 |
| 249 | 00017  | 新世界发展  | 66,000  | 1,664,715.36 | 0.07 |
| 250 | 688396 | 华润微    | 25,000  | 1,615,000.00 | 0.06 |
| 251 | 00881  | 中升控股   | 32,000  | 1,590,722.56 | 0.06 |
| 252 | 00288  | 万洲国际   | 395,000 | 1,579,235.28 | 0.06 |
| 253 | 01929  | 周大福    | 133,600 | 1,531,423.67 | 0.06 |
| 254 | 601995 | 中金公司   | 30,300  | 1,485,609.00 | 0.06 |
| 255 | 01193  | 华润燃气   | 40,000  | 1,440,611.20 | 0.06 |
| 256 | 688363 | 华熙生物   | 9,260   | 1,438,078.00 | 0.06 |
| 257 | 01038  | 长江基建集团 | 35,000  | 1,420,784.40 | 0.06 |
| 258 | 002607 | 中公教育   | 176,800 | 1,389,648.00 | 0.06 |
| 259 | 601881 | 中国银河   | 122,700 | 1,373,013.00 | 0.05 |
| 260 | 09992  | 泡泡玛特   | 37,000  | 1,352,228.64 | 0.05 |
| 261 | 601998 | 中信银行   | 290,500 | 1,342,110.00 | 0.05 |
| 262 | 00083  | 信和置业   | 168,000 | 1,333,734.53 | 0.05 |
| 263 | 00101  | 恒隆地产   | 99,000  | 1,298,316.10 | 0.05 |
| 264 | 00384  | 中国燃气   | 98,000  | 1,298,021.76 | 0.05 |
| 265 | 00241  | 阿里健康   | 240,000 | 1,293,116.16 | 0.05 |
| 266 | 01876  | 百威亚太   | 76,800  | 1,284,089.86 | 0.05 |
| 267 | 01918  | 融创中国   | 132,000 | 1,271,335.30 | 0.05 |
| 268 | 601319 | 中国人保   | 268,500 | 1,261,950.00 | 0.05 |
| 269 | 603195 | 公牛集团   | 7,500   | 1,254,750.00 | 0.05 |
| 270 | 000617 | 中油资本   | 242,200 | 1,254,596.00 | 0.05 |
| 271 | 600025 | 华能水电   | 170,000 | 1,120,300.00 | 0.04 |
| 272 | 300957 | 贝泰妮    | 5,700   | 1,095,996.00 | 0.04 |
| 273 | 01378  | 中国宏桥   | 160,500 | 1,079,980.10 | 0.04 |
| 274 | 00853  | 微创医疗   | 40,400  | 938,081.54   | 0.04 |
| 275 | 00285  | 比亚迪电子  | 39,500  | 922,027.96   | 0.04 |
| 276 | 01209  | 华润万象生活 | 30,400  | 903,480.70   | 0.04 |
| 277 | 00762  | 中国联通   | 274,000 | 873,687.36   | 0.03 |
| 278 | 01972  | 太古地产   | 51,200  | 817,966.28   | 0.03 |
| 279 | 03692  | 翰森制药   | 52,000  | 807,788.80   | 0.03 |
| 280 | 00656  | 复星国际   | 112,000 | 770,113.79   | 0.03 |
| 281 | 605499 | 东鹏饮料   | 4,200   | 763,728.00   | 0.03 |
| 282 | 06862  | 海底捞    | 50,000  | 719,488.00   | 0.03 |
| 283 | 300919 | 中伟股份   | 4,700   | 712,097.00   | 0.03 |
| 284 | 688739 | 成大生物   | 9,882   | 694,902.24   | 0.03 |
| 285 | 01579  | 颐海国际   | 23,000  | 677,913.04   | 0.03 |

|     |        |       |        |            |      |
|-----|--------|-------|--------|------------|------|
| 286 | 300979 | 华利集团  | 7,500  | 667,875.00 | 0.03 |
| 287 | 01833  | 平安好医生 | 25,400 | 588,745.58 | 0.02 |
| 288 | 688151 | 华强科技  | 12,238 | 413,889.16 | 0.02 |
| 289 | 688262 | 国芯科技  | 7,129  | 299,275.42 | 0.01 |
| 290 | 688690 | 纳微科技  | 3,477  | 277,534.14 | 0.01 |
| 291 | 688776 | 国光电气  | 1,447  | 267,680.53 | 0.01 |
| 292 | 688305 | 科德数控  | 1,496  | 158,097.28 | 0.01 |
| 293 | 688091 | 上海谊众  | 3,294  | 141,016.14 | 0.01 |
| 294 | 688285 | 高铁电气  | 15,159 | 138,553.26 | 0.01 |
| 295 | 688236 | 春立医疗  | 4,052  | 107,094.36 | 0.00 |
| 296 | 301177 | 迪阿股份  | 792    | 91,935.36  | 0.00 |
| 297 | 301136 | 招标股份  | 7,172  | 75,449.44  | 0.00 |
| 298 | 301087 | 可孚医疗  | 848    | 63,888.32  | 0.00 |
| 299 | 301050 | 雷电微力  | 233    | 54,694.42  | 0.00 |
| 300 | 688226 | 威腾电气  | 2,693  | 42,441.68  | 0.00 |
| 301 | 301029 | 怡合达   | 462    | 41,519.94  | 0.00 |
| 302 | 301035 | 润丰股份  | 644    | 36,244.32  | 0.00 |
| 303 | 301090 | 华润材料  | 2,764  | 31,012.08  | 0.00 |
| 304 | 603230 | 内蒙新华  | 1,141  | 29,517.67  | 0.00 |
| 305 | 301127 | 天源环保  | 1,685  | 28,847.20  | 0.00 |
| 306 | 301039 | 中集车辆  | 2,064  | 25,820.64  | 0.00 |
| 307 | 301058 | 中粮工科  | 1,386  | 25,280.64  | 0.00 |
| 308 | 301099 | 雅创电子  | 351    | 25,047.36  | 0.00 |
| 309 | 301189 | 奥尼电子  | 435    | 24,629.70  | 0.00 |
| 310 | 301166 | 优宁维   | 253    | 23,908.50  | 0.00 |
| 311 | 301069 | 凯盛新材  | 539    | 23,829.19  | 0.00 |
| 312 | 301096 | 百诚医药  | 272    | 21,360.16  | 0.00 |
| 313 | 301093 | 华兰股份  | 409    | 20,388.65  | 0.00 |
| 314 | 301149 | 隆华新材  | 1,214  | 20,346.64  | 0.00 |
| 315 | 301082 | 久盛电气  | 915    | 19,699.95  | 0.00 |
| 316 | 300994 | 久祺股份  | 420    | 19,089.00  | 0.00 |
| 317 | 301100 | 风光股份  | 599    | 18,652.86  | 0.00 |
| 318 | 001296 | 长江材料  | 310    | 18,376.80  | 0.00 |
| 319 | 301060 | 兰卫医学  | 587    | 18,161.78  | 0.00 |
| 320 | 301088 | 戎美股份  | 704    | 17,367.68  | 0.00 |
| 321 | 301168 | 通灵股份  | 329    | 17,150.77  | 0.00 |
| 322 | 301091 | 深城交   | 524    | 16,406.44  | 0.00 |
| 323 | 301101 | 明月镜片  | 371    | 16,086.56  | 0.00 |
| 324 | 301190 | 善水科技  | 575    | 15,789.50  | 0.00 |
| 325 | 301118 | 恒光股份  | 315    | 15,441.30  | 0.00 |
| 326 | 301108 | 洁雅股份  | 280    | 15,038.80  | 0.00 |
| 327 | 301179 | 泽宇智能  | 295    | 14,977.15  | 0.00 |

|     |        |      |     |           |      |
|-----|--------|------|-----|-----------|------|
| 328 | 301089 | 拓新药业 | 220 | 14,944.60 | 0.00 |
| 329 | 301180 | 万祥科技 | 654 | 14,858.88 | 0.00 |
| 330 | 301046 | 能辉科技 | 290 | 14,207.10 | 0.00 |
| 331 | 301111 | 粤万年青 | 379 | 13,901.72 | 0.00 |
| 332 | 301017 | 漱玉平民 | 555 | 13,209.00 | 0.00 |
| 333 | 301199 | 迈赫股份 | 402 | 12,864.00 | 0.00 |
| 334 | 301020 | 密封科技 | 421 | 12,815.24 | 0.00 |
| 335 | 301138 | 华研精机 | 285 | 12,785.10 | 0.00 |
| 336 | 301026 | 浩通科技 | 203 | 12,734.19 | 0.00 |
| 337 | 301126 | 达嘉维康 | 662 | 12,730.26 | 0.00 |
| 338 | 301185 | 鸥玛软件 | 578 | 12,230.48 | 0.00 |
| 339 | 301021 | 英诺激光 | 290 | 12,014.70 | 0.00 |
| 340 | 301092 | 争光股份 | 323 | 11,472.96 | 0.00 |
| 341 | 301048 | 金鹰重工 | 843 | 10,925.28 | 0.00 |
| 342 | 301028 | 东亚机械 | 733 | 9,895.50  | 0.00 |
| 343 | 301045 | 天禄科技 | 335 | 9,503.95  | 0.00 |
| 344 | 300774 | 倍杰特  | 444 | 9,359.52  | 0.00 |
| 345 | 301040 | 中环海陆 | 241 | 9,280.91  | 0.00 |
| 346 | 301078 | 孩子王  | 756 | 9,177.84  | 0.00 |
| 347 | 301062 | 上海艾录 | 523 | 8,896.23  | 0.00 |
| 348 | 301193 | 家联科技 | 297 | 8,654.58  | 0.00 |
| 349 | 301052 | 果麦文化 | 252 | 8,477.28  | 0.00 |
| 350 | 301025 | 读客文化 | 403 | 8,414.64  | 0.00 |
| 351 | 301066 | 万事利  | 344 | 7,856.96  | 0.00 |
| 352 | 300814 | 中富电路 | 328 | 7,832.64  | 0.00 |
| 353 | 301055 | 张小泉  | 355 | 7,731.90  | 0.00 |
| 354 | 301133 | 金钟股份 | 286 | 7,707.70  | 0.00 |
| 355 | 301198 | 喜悦智行 | 262 | 7,650.40  | 0.00 |
| 356 | 301030 | 仕净科技 | 242 | 7,627.84  | 0.00 |
| 357 | 301081 | 严牌股份 | 403 | 7,028.32  | 0.00 |
| 358 | 301098 | 金埔园林 | 307 | 6,806.19  | 0.00 |
| 359 | 301049 | 超越科技 | 196 | 6,452.32  | 0.00 |
| 360 | 301032 | 新柴股份 | 513 | 6,417.63  | 0.00 |
| 361 | 301056 | 森赫股份 | 572 | 6,343.48  | 0.00 |
| 362 | 301036 | 双乐股份 | 205 | 6,135.65  | 0.00 |
| 363 | 301041 | 金百泽  | 215 | 6,065.15  | 0.00 |
| 364 | 301083 | 百胜智能 | 416 | 5,911.36  | 0.00 |
| 365 | 300854 | 中兰环保 | 203 | 5,539.87  | 0.00 |
| 366 | 301063 | 海锅股份 | 153 | 5,524.83  | 0.00 |
| 367 | 001234 | 泰慕士  | 333 | 5,504.49  | 0.00 |
| 368 | 301038 | 深水规院 | 266 | 5,381.18  | 0.00 |
| 369 | 301059 | 金三江  | 259 | 4,998.70  | 0.00 |

|     |        |      |       |          |      |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 370 | 301027 | 华蓝集团 | 286   | 4,761.90 | 0.00 |
| 371 | 603176 | 汇通集团 | 1,924 | 4,713.80 | 0.00 |
| 372 | 301037 | 保立佳  | 193   | 4,682.18 | 0.00 |
| 373 | 301073 | 君亭酒店 | 144   | 4,608.00 | 0.00 |
| 374 | 301053 | 远信工业 | 155   | 4,460.90 | 0.00 |
| 375 | 301057 | 汇隆新材 | 218   | 4,146.36 | 0.00 |
| 376 | 301079 | 邵阳液压 | 140   | 3,474.80 | 0.00 |

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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       | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|----------------|----------------|
| 1  | 00700  | 腾讯控股  | 279,938,851.58 | 11.14          |
| 2  | 600519 | 贵州茅台  | 225,829,948.12 | 8.98           |
| 3  | 601318 | 中国平安  | 130,266,755.63 | 5.18           |
| 3  | 02318  | 中国平安  | 38,982,106.71  | 1.55           |
| 4  | 03690  | 美团-W  | 123,609,603.09 | 4.92           |
| 5  | 600036 | 招商银行  | 104,838,176.81 | 4.17           |
| 5  | 03968  | 招商银行  | 16,439,513.92  | 0.65           |
| 6  | 000858 | 五粮液   | 94,825,800.41  | 3.77           |
| 7  | 300750 | 宁德时代  | 74,154,958.55  | 2.95           |
| 8  | 000333 | 美的集团  | 71,333,182.89  | 2.84           |
| 9  | 01299  | 友邦保险  | 70,717,178.07  | 2.81           |
| 10 | 002352 | 顺丰控股  | 68,452,925.10  | 2.72           |
| 11 | 600276 | 恒瑞医药  | 57,760,464.79  | 2.30           |
| 12 | 601166 | 兴业银行  | 56,900,198.86  | 2.26           |
| 13 | 00005  | 汇丰控股  | 53,508,140.79  | 2.13           |
| 14 | 601398 | 工商银行  | 27,446,395.80  | 1.09           |
| 14 | 01398  | 工商银行  | 25,366,676.90  | 1.01           |
| 15 | 601888 | 中国中免  | 52,190,233.58  | 2.08           |
| 16 | 00939  | 建设银行  | 43,059,908.38  | 1.71           |
| 16 | 601939 | 建设银行  | 7,066,782.00   | 0.28           |
| 17 | 601012 | 隆基股份  | 48,732,176.78  | 1.94           |
| 18 | 002594 | 比亚迪   | 34,822,949.97  | 1.39           |
| 18 | 01211  | 比亚迪股份 | 10,637,912.13  | 0.42           |
| 19 | 300760 | 迈瑞医疗  | 43,827,528.54  | 1.74           |
| 20 | 000651 | 格力电器  | 42,777,905.10  | 1.70           |

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。



## 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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      | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 00700  | 腾讯控股  | 76,264,133.66 | 3.03           |
| 2  | 002352 | 顺丰控股  | 42,391,878.92 | 1.69           |
| 3  | 000858 | 五粮液   | 29,890,470.62 | 1.19           |
| 4  | 03690  | 美团-W  | 28,743,219.60 | 1.14           |
| 5  | 601318 | 中国平安  | 14,295,414.57 | 0.57           |
| 5  | 02318  | 中国平安  | 10,445,006.15 | 0.42           |
| 6  | 300750 | 宁德时代  | 24,256,502.75 | 0.97           |
| 7  | 01299  | 友邦保险  | 23,563,573.66 | 0.94           |
| 8  | 600036 | 招商银行  | 16,693,814.05 | 0.66           |
| 8  | 03968  | 招商银行  | 5,623,175.52  | 0.22           |
| 9  | 000333 | 美的集团  | 20,418,477.67 | 0.81           |
| 10 | 300760 | 迈瑞医疗  | 20,180,693.00 | 0.80           |
| 11 | 00005  | 汇丰控股  | 19,737,107.83 | 0.79           |
| 12 | 00939  | 建设银行  | 14,890,826.29 | 0.59           |
| 12 | 601939 | 建设银行  | 4,710,991.00  | 0.19           |
| 13 | 002594 | 比亚迪   | 11,887,627.00 | 0.47           |
| 13 | 01211  | 比亚迪股份 | 2,606,459.03  | 0.10           |
| 14 | 300059 | 东方财富  | 14,195,861.70 | 0.56           |
| 15 | 000651 | 格力电器  | 14,078,746.48 | 0.56           |
| 16 | 600519 | 贵州茅台  | 12,577,100.00 | 0.50           |
| 17 | 01398  | 工商银行  | 8,595,224.71  | 0.34           |
| 17 | 601398 | 工商银行  | 3,661,345.00  | 0.15           |
| 18 | 000001 | 平安银行  | 11,982,830.11 | 0.48           |
| 19 | 002415 | 海康威视  | 11,470,148.35 | 0.46           |
| 20 | 000568 | 泸州老窖  | 11,362,776.00 | 0.45           |

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。

## 8.4.3 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 | 4,651,326,251.11 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,224,682,931.60 |

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。

## 8.5 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） | 3,333,000.00 | 0.13          |
| 8  | 同业存单      | -            | -             |
| 9  | 其他        | -            | -             |
| 10 | 合计        | 3,333,000.00 | 0.13          |

### 8.6 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  | 113052 | 兴业转债 | 33,330 | 3,333,000.00 | 0.13          |

### 8.7 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。

### 8.8 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。

### 8.9 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。

### 8.10 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投资股指期货。

### 8.11 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投资国债期货。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1 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，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚；美团-W（股票代码：03690）在报告编制日前一年内曾受到国家市场监督管理总局的处罚。

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。

#### 8.12.2 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。

#### 8.12.3 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   | 86,632.04  |
| 2  | 应收证券清算款 | 105,782.15 |
| 3  | 应收股利    | 30,832.00  |
| 4  | 应收利息    | 12,180.13  |
| 5  | 应收申购款   | -          |
| 6  | 其他应收款   | -          |
| 7  | 待摊费用    | -          |
| 8  | 其他      | -          |
| 9  | 合计      | 235,426.32 |

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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。

#### 8.12.6 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数（户） | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 |           |       |           |
|----------|-----------|-------|-----------|-------|-----------|
|          |           | 机构投资者 |           | 个人投资者 |           |
|          |           | 持有份额  | 占总份额比例（%） | 持有份额  | 占总份额比例（%） |
|          |           |       |           |       |           |

|         |              |                      |        |                      |        |
|---------|--------------|----------------------|--------|----------------------|--------|
| 20, 223 | 146, 438. 93 | 1, 942, 313, 456. 00 | 65. 59 | 1, 019, 120, 994. 00 | 34. 41 |
|---------|--------------|----------------------|--------|----------------------|--------|

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称                                    | 持有份额（份）              | 占上市总份额比例（%） |
|----|--|----------------------|-------------|
| 1  | 中国人寿保险股份有限公司                             | 1, 820, 000, 000. 00 | 61. 46      |
| 2  | 中国人寿养老保险股份有限公司—国寿福盈今生个人养老保障管理产品开放式 4 号投资 | 39, 353, 900. 00     | 1. 33       |
| 3  | 宁波珑琪投资管理合伙企业（有限合伙）                       | 30, 460, 000. 00     | 1. 03       |
| 4  | 都邦财产保险股份有限公司                             | 15, 000, 000. 00     | 0. 51       |
| 5  | 孙华玲                                      | 10, 000, 000. 00     | 0. 34       |
| 6  | 杨传博                                      | 6, 000, 000. 00      | 0. 20       |
| 7  | 交银施罗德基金—建设银行—交银施罗德固收增强 1 号集合资产管理计划       | 5, 000, 000. 00      | 0. 17       |
| 8  | 中信证券—交通银行—中信证券固收多元 1 号集合资产管理计划           | 5, 000, 000. 00      | 0. 17       |
| 9  | 刘月明                                      | 3, 800, 000. 00      | 0. 13       |
| 10 | 中信证券股份有限公司                               | 3, 090, 690. 00      | 0. 10       |

## 9.3 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 | 200, 000. 00 | 0. 01       |

## 9.4 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、基金投资和研发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                 |

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

|                                    |                      |
|------------------------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 2 月 4 日）基金份额总额      | 3, 936, 434, 450. 00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额              | 21, 000, 000. 00     |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额            | 996, 000, 000. 00    |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | -                    |
| 本报告期期末基金份额总额                       | 2, 961, 434, 450. 00 |

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2021 年 3 月 3 日发布公告，岳海先生自 2021 年 3 月 3 日起任公司总经理助理；本基金管理人于 2021 年 9 月 2 日发布公告，石伟先生于 2021 年 8 月 31 日离任公司资产配置总监。

自 2021 年 10 月 27 日起，刘波先生不再担任招商银行股份有限公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

### 11.6 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，本基金管理人、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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 |    |
| 华泰证券 | 2      | 2,112,213,755.08 | 36.11%       | 883,219.42 | 30.80%     | -  |

|      |   |                  |        |              |        |   |
|------|---|------------------|--------|--------------|--------|---|
| 天风证券 | 2 | 1,973,926,256.88 | 33.75% | 1,230,624.17 | 42.91% | - |
| 中信证券 | 2 | 1,763,124,180.91 | 30.14% | 753,853.33   | 26.29% | - |
| 华创证券 | 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。

## 11.7.2 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 |
| 华创证券 | -            | -            | -              | -              | -    | -            |
| 华泰证券 | 438,933.47   | 5.46%        | -              | -              | -    | -            |
| 天风证券 | -            | -            | 400,000,000.00 | 100.00%        | -    | -            |
| 中信证券 | 7,606,132.08 | 94.54%       | -              | -              | -    | -            |

## 11.8 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  | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金份额发售公告                             | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 2  | 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合同及招募说明书提示性公告                    | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 3  | 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合同                               | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 4  | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议                               | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 5  | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书                              | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 1 月 15 日 |
| 6  | 国寿安保关于国泰君安证券股份有限公司暂停办理国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金网下股票认购的公告    | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 1 月 27 日 |
| 7  | 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合同生效公告                           | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 5 日  |
| 8  | 国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金投资关联方证券的公告           | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 8 日  |
| 9  | 关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年非港股通交易日暂停申购、赎回、转换及定投业务的公告 | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 19 日 |
| 10 | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购和赎回业务公告                      | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 19 日 |
| 11 | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书                            | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 19 日 |
| 12 | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告                          | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 19 日 |
| 13 | 国寿安保基金管理有限公司关于旗下国寿安保沪港深 300ETF 变更基金经理的公告                       | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 27 日 |
| 14 | 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产品资料概要更新                         | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 27 日 |
| 15 | 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招募说明书更新                          | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 2 月 27 日 |
| 16 | 关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——         | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 4 月 2 日  |

|    |   |                  |                  |
|----|---|------------------|------------------|
|    | 指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告 20210402                     |                  |                  |
| 17 | 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产品资料概要更新            | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 4 月 2 日   |
| 18 | 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合同                  | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 4 月 2 日   |
| 19 | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书 (2021 年第 2 号) | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 4 月 2 日   |
| 20 | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告       | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 7 月 21 日  |
| 21 | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告           | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 8 月 31 日  |
| 22 | 关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购、赎回业务的公告        | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 10 月 13 日 |
| 23 | 国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告       | 上证报、证监会指定网站及公司网站 | 2021 年 10 月 27 日 |

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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    | 1              | 20210204~20211231       | 2,000,269,500.00 | -    | 180,269,500.00 | 1,820,000,000.00 | 61.46    |
| 个人    | -              | -                       | -                | -    | -              | -                | -        |

#### 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基



## 金募集的文件

13.1.2 《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合同》

13.1.3 《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 报告期内国寿安保中证沪港深 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

13.1.6 中国证监会要求的其他文件

## 13.2 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

## 13.3 查阅方式

13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

13.3.2 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)

13.3.3 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

2022 年 3 月 31 日