

# 国寿安保中证 500 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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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 01 月 01 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.....	5
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.....	6
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.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	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.....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	10
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.....	11
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	11
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>11</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	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.....	12
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>14</b>
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
7.4 报表附注.....	17

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>42</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	42
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	42
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.....	43
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	55
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.....	57
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.....	57
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.....	57
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.....	57
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	57
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	57
8.12 投资组合报告附注.....	58
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>58</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
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.....	59
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>59</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>60</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
11.4 基金投资策略的改变.....	60
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
11.8 其他重大事件.....	62
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>63</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.....	63
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>63</b>
13.1 备查文件目录.....	63
13.2 存放地点.....	63
13.3 查阅方式.....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保中证 500ETF
场内简称	国寿 500
基金主代码	510560
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 5 月 29 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	174,318,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 3 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求偏离度和误差最小化。
投资策略	本基金为完全被动式指数基金，采用完全复制法，即按照成份股在标的指数中的基准权重来构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变化进行相应调整。
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相近的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	秦一楠
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850776	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		王军辉	谷澍

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gs-funds.com.cn
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	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
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	2020年	2019年
本期已实现收益	137,113,025.32	55,940,018.79	-20,398,409.40
本期利润	73,201,604.26	160,034,633.22	55,523,284.09
加权平均基金份额本期利润	0.2210	0.2612	0.1150
本期加权平均净值利润率	15.30%	20.48%	10.80%
本期基金份额净值增长率	17.67%	21.94%	26.44%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末	2019年末
期末可供分配利润	-94,291,542.96	-515,682,836.17	-656,335,418.05
期末可供分配基金份额利润	-0.5409	-0.8765	-1.0315
期末基金资产净值	282,180,998.55	809,348,527.85	717,909,176.40
期末基金份额净值	1.6188	1.3757	1.1282
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末	2019年末
基金份额累计净值增长率	-25.04%	-36.30%	-47.76%

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

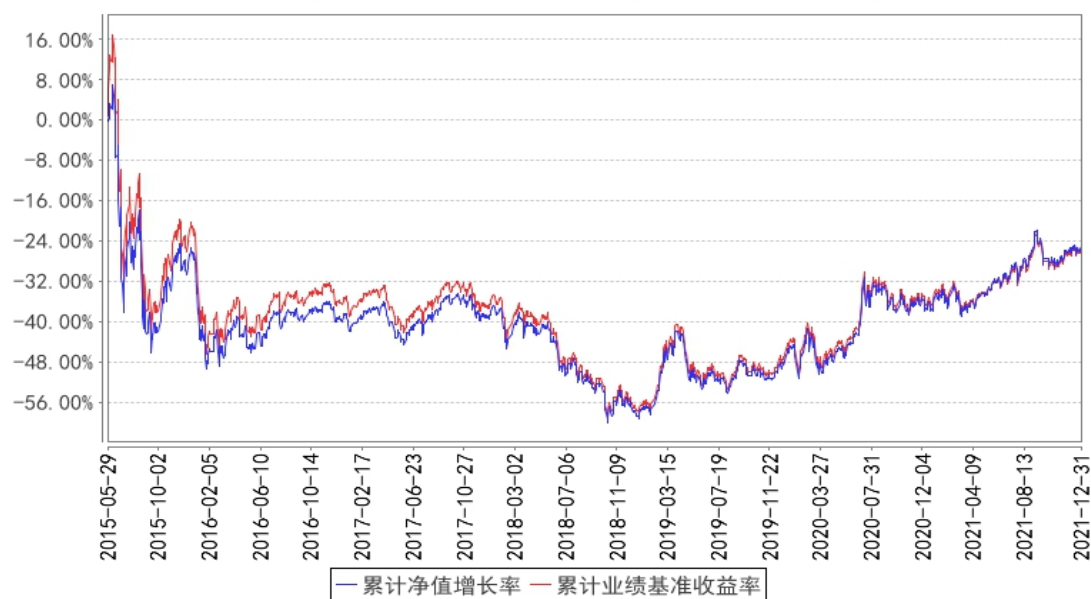
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	3.40%	0.75%	3.60%	0.76%	-0.20%	-0.01%
过去六个月	7.96%	0.95%	8.10%	0.96%	-0.14%	-0.01%
过去一年	17.67%	0.96%	15.58%	0.97%	2.09%	-0.01%

过去三年	81.42%	1.37%	76.57%	1.38%	4.85%	-0.01%
过去五年	24.60%	1.32%	17.49%	1.33%	7.11%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-25.04%	1.67%	-25.42%	1.70%	0.38%	-0.03%

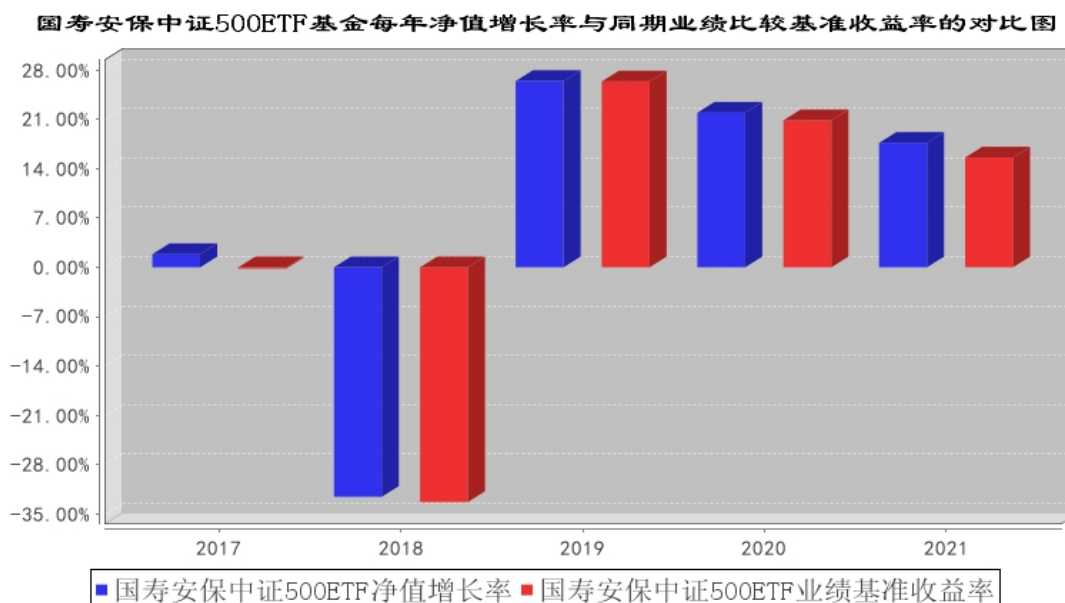
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国寿安保中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 05 月 29 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 05 月 29 日至 2021 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年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



### 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	说明
----	----	-----------------	----	----



		任职日期	离任日期	从业年限	
李康	基金经理	2015年5月29日	-	12年	李康先生，博士研究生。2009年10月至2012年12月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012年12月至2013年11月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013年11月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保沪深300交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选88交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保稳丰6个月持有期混合型证券投资基金和国寿安保中证沪港深300交易型开放式指数证券投资基金基金经理。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

报告期内，本基金严格遵守基金合同，紧密追踪标的指数。

本基金跟踪误差主要源自股票停牌和成份股调整等因素引起的成份股权重偏离。日常申赎和市场波动等因素，也带来一定的跟踪误差。本基金管理人采用量化分析手段，通过适当的策略尽量克服对跟踪误差不利因素的影响。并且，逐日跟踪实际组合与标的指数表现的偏离，定期分析优化跟踪偏离度管理方案。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.6188 元；本报告期基金份额净值增长率为 17.67%，业绩比较基准收益率为 15.58%。

#### 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

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

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

#### 4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，

对本基金基金管理人—国寿安保基金管理有限公司 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国寿安保基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

# § 6 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 20821 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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“国寿安保中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表,2021 年度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 500ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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

	<p>“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 500ETF 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 500ETF 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	<p>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 500ETF 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 500ETF 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 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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，</p>

	<p>根据获取的审计证据，就可能对国寿安保中证 500ETF 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 500ETF 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>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张勇	周祎
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 50 楼	
审计报告日期	2022 年 3 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	2,501,130.01	5,252,939.56
结算备付金		26,928.75	-
存出保证金		50,578.62	30,926.98
交易性金融资产	7.4.7.2	279,946,083.95	797,929,494.64
其中：股票投资		279,930,083.95	797,913,194.64
基金投资		-	-
债券投资		16,000.00	16,300.00
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		72,464.01	7,195,640.39
应收利息	7.4.7.5	583.02	1,203.80
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		282,597,768.36	810,410,205.37
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年12月31日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		118,761.17	339,894.74
应付托管费		23,752.21	67,978.95
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	69,256.17	423,318.14
应交税费		0.26	1.38
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	205,000.00	230,484.31
负债合计		416,769.81	1,061,677.52
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	376,472,541.51	1,270,579,965.54
未分配利润	7.4.7.10	-94,291,542.96	-461,231,437.69
所有者权益合计		282,180,998.55	809,348,527.85
负债和所有者权益总计		282,597,768.36	810,410,205.37

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6188 元，基金份额总额 174,318,687.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
一、收入		77,702,513.89	165,880,339.64
1. 利息收入		104,513.31	54,073.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	58,707.00	53,756.36
债券利息收入		186.55	317.60
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-

证券出借利息收入		45,619.76	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		140,185,282.78	61,687,010.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	134,841,157.06	52,444,129.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	159,881.34	334,960.84
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	5,184,244.38	8,907,919.83
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-63,911,421.06	104,094,614.43
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	1,324,138.86	44,640.85
减：二、费用		4,500,909.63	5,845,706.42
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,428,043.89	3,894,567.95
2. 托管费	7.4.10.2.2	485,608.75	778,913.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	1,233,300.27	715,006.80
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		164.64	1.10
7. 其他费用	7.4.7.20	353,792.08	457,217.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		73,201,604.26	160,034,633.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		73,201,604.26	160,034,633.22

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 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）	1,270,579,965.54	-461,231,437.69	809,348,527.85
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	73,201,604.26	73,201,604.26
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 （净值减少以“-”号填列）	-894,107,424.03	293,738,290.47	-600,369,133.56
其中：1. 基金申购款	21,596,797.68	-6,146,169.16	15,450,628.52
2. 基金赎回款	-915,704,221.71	299,884,459.63	-615,819,762.08



			8
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）	376,472,541.51	-94,291,542.96	282,180,998.55
项目	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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）	1,374,244,594.45	-656,335,418.05	717,909,176.40
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	160,034,633.22	160,034,633.22
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-103,664,628.91	35,069,347.14	-68,595,281.77
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-103,664,628.91	35,069,347.14	-68,595,281.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,270,579,965.54	-461,231,437.69	809,348,527.85

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 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]485号《关于准予国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金注册的批复》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 500 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 665,796,867.00 元(含募集股票市值),业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第 61090605\_A03 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2015 年 05 月 29 日正式生效,基金合同生效日

的基金份额总额为 665,869,631.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 72,764.00 份基金份额。本基金的基金管理人为国寿安保基金管理有限公司(以下简称“国寿安保”)，基金托管人为中国农业银行股份有限公司(以下简称“农业银行”)。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书 [2015]268 号核准，本基金 308,318,687.00 份基金份额于 2015 年 7 月 3 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 500 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，本基金可少量投资于非成份股(包含中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、债券资产(国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、证券公司短期公司债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货、国债期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在建仓完成后，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，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。本基金的业绩比较基准为：标的指数，本基金标的指数为中证 500 指数。

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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿中证 500ETF 联接基金”)。国寿中证 500ETF 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 500 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。

##### 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。

#### 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

本基金的每份基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采取现金分红。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为：使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。

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 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。

#### 7.4.4.13 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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

##### 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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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



## 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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	2,501,130.01	5,252,939.56
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	2,501,130.01	5,252,939.56

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	249,038,284.73	279,930,083.95	30,891,799.22
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,000.00	16,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	16,000.00	16,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	249,054,284.73	279,946,083.95	30,891,799.22
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	703,109,974.36	797,913,194.64	94,803,220.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	16,300.00	16,300.00
	银行间市场	-	-
	合计	16,300.00	16,300.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	703,126,274.36	797,929,494.64	94,803,220.28

### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于本报告期末及上年度末均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

本基金于本报告期末及上年度末均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

本基金于本报告期末及上年度末均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 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	542.22	1,187.01
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	13.31	-
应收债券利息	2.52	1.50
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	24.97	15.29
合计	583.02	1,203.80

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	69,256.17	423,318.14
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	69,256.17	423,318.14

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020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	170,000.00	170,000.00
应付指数使用费	35,000.00	60,484.31
合计	205,000.00	230,484.31

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	588,318,687.00	1,270,579,965.54
本期申购	10,000,000.00	21,596,797.68
本期赎回（以“-”号填列）	-424,000,000.00	-915,704,221.71
- 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	174,318,687.00	376,472,541.51

#### 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
上年度末	-515,682,836.17	54,451,398.48	-461,231,437.69
本期利润	137,113,025.32	-63,911,421.06	73,201,604.26
本期基金份额交易产生的变动数	308,504,506.05	-14,766,215.58	293,738,290.47
其中：基金申购款	-5,605,242.25	-540,926.91	-6,146,169.16
基金赎回款	314,109,748.30	-14,225,288.67	299,884,459.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-70,065,304.80	-24,226,238.16	-94,291,542.96

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
	活期存款利息收入	50,862.94
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,529.00	3,152.52
其他	1,315.06	269.87
合计	58,707.00	53,756.36

## 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1月1日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12 月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	99,947,415.02	47,250,133.55
股票投资收益——赎回差价收入	34,893,742.04	5,193,996.18
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	134,841,157.06	52,444,129.73

## 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1月1日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	518,887,448.87	249,599,934.79
减：卖出股票成本总额	418,940,033.85	202,349,801.24
买卖股票差价收入	99,947,415.02	47,250,133.55

## 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1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
赎回基金份额对价总额	615,819,762.08	68,595,281.77
减：现金支付赎回款总额	331,873,120.08	36,264,157.77
减：赎回股票成本总额	249,052,899.96	27,137,127.82
赎回差价收入	34,893,742.04	5,193,996.18

## 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1月1日至2021年12	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月
----	-------------------------	-------------------------------

	月31日	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	159,881.34	334,960.84
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	159,881.34	334,960.84

#### 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1月1日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,070,370.27	1,869,689.93
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	910,300.00	1,534,400.00
减：应收利息总额	188.93	329.09
买卖债券差价收入	159,881.34	334,960.84

#### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资产生的收益/损失。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期间及上年度可比期间均无衍生工具产生的收益/损失。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月 31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
股票投资产生的股利收益	5,184,244.38	8,907,919.83
其中：证券出借权益补偿收入	10,330.00	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	5,184,244.38	8,907,919.83

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-63,911,421.06	104,094,614.43
股票投资	-63,911,421.06	104,094,614.43
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	-63,911,421.06	104,094,614.43

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	1,324,138.86	44,640.85
合计	1,324,138.86	44,640.85

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 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	1,233,300.27	715,006.80
银行间市场交易费用	-	-
合计	1,233,300.27	715,006.80

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	8,458.84	3,542.99
指数使用费	175,333.24	233,674.05
律师费	-	40,000.00
持有人大会公证费	-	10,000.00
合计	353,792.08	457,217.04

#### 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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“国寿安保中证 500ETF 联接基金”）	本基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 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

###### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

### 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1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,428,043.89	3,894,567.95
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：基金管理费每日计提，按月支付。本基金的管理费按前一日基金资产净值的0.50%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	485,608.75	778,913.53

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

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

##### 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

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

#### 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及上年度可比期间均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 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
国寿安保中证 500ETF联接基金	170,286,286.00	97.69	585,486,286.00	99.52

#### 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
农业银行	2,501,130.01	50,862.94	5,252,939.56	50,333.97

注：本基金的银行存款由基金托管人农业银行保管，按银行约定利率计息。

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金于本报告期及上年度可比期间均未在承销期内参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金于本报告期及上年度可比期间均无其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

#### 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	-
301045	天禄科技	2021年8月6日	2022年2月14日	新股流通受限	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
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(单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113634	珀莱转债	2021年12月8日	2022年1月4日	新债未上市	100.00	100.00	160	16,000.00	16,000.00	-

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票，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票，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票数量的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票，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票不适用《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

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002683	广东宏大	2021 年 12 月 20 日	重大事项停牌	30.12	2022 年 1 月 4 日	31.00	17,900	593,144.73	539,148.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末未持有证券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

### 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，将风险控制在可接受的范围内。

#### 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时间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 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	2,501,130.01	-	-	-	2,501,130.01
结算备付金	26,928.75	-	-	-	26,928.75
存出保证金	50,578.62	-	-	-	50,578.62
交易性金融资产	-	-	16,000.00	279,930,083.95	279,946,083.95
应收利息	-	-	-	583.02	583.02
应收证券清算款	-	-	-	72,464.01	72,464.01
资产总计	2,578,637.38	-	16,000.00	280,003,130.98	282,597,768.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	118,761.17	118,761.17
应付托管费	-	-	-	23,752.21	23,752.21
应付交易费用	-	-	-	69,256.17	69,256.17
应交税费	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	205,000.00	205,000.00
负债总计	-	-	-	416,769.81	416,769.81
利率敏感度缺口	2,578,637.38	-	16,000.00	279,586,361.17	282,180,998.55
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,252,939.56	-	-	-	5,252,939.56
存出保证金	30,926.98	-	-	-	30,926.98
交易性金融资产	-	-	16,300.00	797,913,194.64	797,929,494.64
应收利息	-	-	-	1,203.80	1,203.80
应收证券清算款	-	-	-	7,195,640.39	7,195,640.39
资产总计	5,283,866.54	-	16,300.00	805,110,038.83	810,410,205.37
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	339,894.74	339,894.74
应付托管费	-	-	-	67,978.95	67,978.95
应付交易费用	-	-	-	423,318.14	423,318.14
应交税费	-	-	-	1.38	1.38
其他负债	-	-	-	230,484.31	230,484.31
负债总计	-	-	-	1,061,677.52	1,061,677.52
利率敏感度缺口	5,283,866.54	-	16,300.00	804,048,361.31	809,348,527.85

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 0.0057%(2020 年 12 月 31 日：0.0020%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2020 年 12 月 31 日：同)。

#### 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而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	279,930,083.95	99.20	797,913,194.64	98.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	16,000.00	0.01	16,300.00	0.00
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	279,946,083.95	99.21	797,929,494.64	98.59

## 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 影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）	
分析	+5%	13,967,959.43	40,201,924.80
	-5%	-13,967,959.43	-40,201,924.80

## 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 279,375,927.51 元，属于第二层次的余额为 560,652.49 元，属于第三层次的余额为 9,503.95 元(2020 年 12 月 31 日：第一层次 796,513,428.31 元，第二层次 1,416,066.33 元，无第三层次)。

(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 1 月 1 日，本基金无第三层次交易性金融资产余额。于 2021 年度，本基金购买第三层次交易性金融资产 5,296.35 元，计入损益的利得或损失总额 4,207.60 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 9,503.95 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 4,207.60 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(于 2020 年 1 月 1 日及 2020 年 12 月 31 日，本基金无第三层次交易性金融资产余额。于 2020 年度，本基金无第三层次交易性金融资产变动)。

(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(2020 年 12 月 31 日：同)。

(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	279,930,083.95	99.06
	其中：股票	279,930,083.95	99.06
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	16,000.00	0.01
	其中：债券	16,000.00	0.01
	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	2,528,058.76	0.89
8	其他各项资产	123,625.65	0.04
9	合计	282,597,768.36	100.00

### 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	3,113,251.20	1.10
B	采矿业	10,815,160.26	3.83
C	制造业	169,003,785.86	59.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	10,481,109.20	3.71
E	建筑业	5,317,422.05	1.88

F	批发和零售业	8,643,988.84	3.06
G	交通运输、仓储和邮政业	6,548,872.00	2.32
H	住宿和餐饮业	1,683,710.60	0.60
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,918,512.68	8.48
J	金融业	20,076,455.82	7.11
K	房地产业	7,259,197.00	2.57
L	租赁和商务服务业	3,425,480.00	1.21
M	科学研究和技术服务业	989,110.00	0.35
N	水利、环境和公共设施管理业	2,408,913.77	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	580,089.60	0.21
R	文化、体育和娱乐业	3,649,109.67	1.29
S	综合	2,015,915.40	0.71
	合计	279,930,083.95	99.20

## 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资沪港通股票。

## 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	002340	格林美	190,778	1,974,552.30	0.70
2	600522	中天科技	106,000	1,797,760.00	0.64
3	000733	振华科技	14,400	1,789,632.00	0.63
4	000723	美锦能源	102,100	1,657,083.00	0.59
5	601615	明阳智能	62,300	1,626,030.00	0.58
6	600157	永泰能源	885,100	1,610,882.00	0.57
7	600399	抚顺特钢	62,800	1,555,556.00	0.55
8	600885	宏发股份	20,740	1,548,033.60	0.55
9	600884	杉杉股份	46,210	1,514,301.70	0.54
10	000009	中国宝安	102,780	1,483,115.40	0.53
11	002384	东山精密	54,500	1,476,950.00	0.52
12	601117	中国化学	121,600	1,459,200.00	0.52
13	002013	中航机电	77,400	1,407,132.00	0.50
14	002385	大北农	131,900	1,383,631.00	0.49
15	601555	东吴证券	156,130	1,383,311.80	0.49
16	300285	国瓷材料	32,000	1,362,240.00	0.48
17	300751	迈为股份	2,100	1,348,830.00	0.48
18	002268	卫士通	23,600	1,320,184.00	0.47

19	605358	立昂微	10,900	1,308,109.00	0.46
20	300088	长信科技	97,900	1,300,112.00	0.46
21	300037	新宙邦	11,500	1,299,500.00	0.46
22	688099	晶晨股份	9,800	1,275,960.00	0.45
23	600765	中航重机	25,200	1,272,348.00	0.45
24	600563	法拉电子	5,400	1,254,960.00	0.44
25	688005	容百科技	10,700	1,236,706.00	0.44
26	600298	安琪酵母	19,900	1,201,164.00	0.43
27	600256	广汇能源	183,100	1,197,474.00	0.42
28	002028	思源电气	24,320	1,196,787.20	0.42
29	002180	纳思达	25,000	1,194,000.00	0.42
30	600862	中航高科	33,300	1,190,808.00	0.42
31	600141	兴发集团	30,980	1,173,522.40	0.42
32	300363	博腾股份	13,000	1,162,850.00	0.41
33	300253	卫宁健康	68,300	1,144,708.00	0.41
34	600487	亨通光电	75,300	1,138,536.00	0.40
35	002185	华天科技	89,400	1,136,274.00	0.40
36	603456	九洲药业	19,900	1,119,574.00	0.40
37	000988	华工科技	40,100	1,117,186.00	0.40
38	601636	旗滨集团	64,200	1,097,820.00	0.39
39	600392	盛和资源	55,895	1,096,659.90	0.39
40	600754	锦江酒店	18,200	1,066,520.00	0.38
41	300058	蓝色光标	99,300	1,065,489.00	0.38
42	600418	江淮汽车	60,400	1,050,960.00	0.37
43	300699	光威复材	12,400	1,047,552.00	0.37
44	601168	西部矿业	75,866	1,032,536.26	0.37
45	603613	国联股份	9,600	1,032,000.00	0.37
46	300223	北京君正	7,700	1,031,800.00	0.37
47	000630	铜陵有色	293,900	1,022,772.00	0.36
48	603589	口子窖	14,300	1,013,441.00	0.36
49	603267	鸿远电子	5,600	1,004,864.00	0.36
50	600516	方大炭素	91,000	984,620.00	0.35
51	002797	第一创业	134,100	981,612.00	0.35
52	002138	顺络电子	25,700	981,226.00	0.35
53	300136	信维通信	38,600	977,352.00	0.35
54	000998	隆平高科	42,000	976,920.00	0.35
55	600486	扬农化工	7,420	973,504.00	0.34
56	601077	渝农商行	246,800	950,180.00	0.34
57	600875	东方电气	44,300	948,906.00	0.34
58	300724	捷佳伟创	8,300	948,690.00	0.34
59	300308	中际旭创	22,300	947,750.00	0.34
60	600038	中直股份	11,769	945,050.70	0.33

61	000728	国元证券	121,700	937,090.00	0.33
62	601689	拓普集团	17,570	931,210.00	0.33
63	002409	雅克科技	11,400	925,338.00	0.33
64	688536	思瑞浦	1,200	921,600.00	0.33
65	688065	凯赛生物	5,000	921,400.00	0.33
66	002353	杰瑞股份	22,900	916,000.00	0.32
67	300474	景嘉微	6,000	913,200.00	0.32
68	600233	圆通速递	54,700	912,396.00	0.32
69	300146	汤臣倍健	33,800	911,248.00	0.32
70	002080	中材科技	26,700	908,334.00	0.32
71	002223	鱼跃医疗	23,950	905,310.00	0.32
72	002212	天融信	47,200	904,824.00	0.32
73	603893	瑞芯微	6,600	903,540.00	0.32
74	300763	锦浪科技	3,900	903,045.00	0.32
75	000519	中兵红箭	33,362	889,764.54	0.32
76	300418	昆仑万维	38,100	882,015.00	0.31
77	002673	西部证券	106,800	861,876.00	0.31
78	600733	北汽蓝谷	85,400	855,708.00	0.30
79	000547	航天发展	51,100	853,370.00	0.30
80	000636	风华高科	28,600	852,280.00	0.30
81	688208	道通科技	10,705	849,977.00	0.30
82	600482	中国动力	43,100	849,070.00	0.30
83	002439	启明星辰	29,700	847,341.00	0.30
84	600705	中航产融	213,400	847,198.00	0.30
85	000932	华菱钢铁	165,180	844,069.80	0.30
86	603077	和邦生物	246,660	841,110.60	0.30
87	688002	睿创微纳	10,700	840,699.00	0.30
88	600699	均胜电子	38,260	840,572.20	0.30
89	000039	中集集团	48,922	839,501.52	0.30
90	002444	巨星科技	27,400	835,974.00	0.30
91	600188	兖矿能源	35,500	835,315.00	0.30
92	000807	云铝股份	74,700	834,399.00	0.30
93	600529	山东药玻	19,000	834,100.00	0.30
94	600739	辽宁成大	42,700	833,504.00	0.30
95	603605	珀莱雅	4,000	833,240.00	0.30
96	300296	利亚德	81,100	831,275.00	0.29
97	000739	普洛药业	23,500	824,615.00	0.29
98	002465	海格通信	73,500	802,620.00	0.28
99	002507	涪陵榨菜	21,200	801,360.00	0.28
100	000738	航发控制	26,200	793,336.00	0.28
101	600988	赤峰黄金	53,000	789,700.00	0.28
102	002030	达安基因	39,144	785,228.64	0.28

103	601016	节能风电	119,800	779,898.00	0.28
104	000960	锡业股份	39,900	779,247.00	0.28
105	600521	华海药业	35,700	773,262.00	0.27
106	600637	东方明珠	81,700	772,065.00	0.27
107	002273	水晶光电	44,329	770,881.31	0.27
108	600549	厦门钨业	33,900	767,157.00	0.27
109	688521	芯原股份	9,900	765,864.00	0.27
110	603290	斯达半导	2,000	762,000.00	0.27
111	600177	雅戈尔	110,500	761,345.00	0.27
112	600732	爱旭股份	32,400	756,864.00	0.27
113	601198	东兴证券	64,400	748,972.00	0.27
114	002557	洽洽食品	12,100	742,456.00	0.26
115	603127	昭衍新药	6,400	738,752.00	0.26
116	002078	太阳纸业	64,200	737,658.00	0.26
117	002985	北摩高科	6,110	736,010.60	0.26
118	600704	物产中大	124,300	735,856.00	0.26
119	600201	生物股份	44,814	732,708.90	0.26
120	300383	光环新网	49,200	730,128.00	0.26
121	600642	申能股份	98,000	722,260.00	0.26
122	601128	常熟银行	109,200	721,812.00	0.26
123	002299	圣农发展	29,800	720,266.00	0.26
124	002156	通富微电	37,000	718,910.00	0.25
125	603444	吉比特	1,700	717,145.00	0.25
126	300357	我武生物	12,500	716,250.00	0.25
127	600879	航天电子	86,600	713,584.00	0.25
128	600497	驰宏锌锗	142,200	709,578.00	0.25
129	600369	西南证券	132,400	700,396.00	0.25
130	600027	华电国际	129,700	693,895.00	0.25
131	600160	巨化股份	53,720	693,525.20	0.25
132	000830	鲁西化工	45,400	692,804.00	0.25
133	600372	中航电子	30,800	689,612.00	0.24
134	300618	寒锐钴业	8,600	689,548.00	0.24
135	002739	万达电影	44,500	688,860.00	0.24
136	600039	四川路桥	57,062	687,026.48	0.24
137	002092	中泰化学	71,902	685,945.08	0.24
138	000623	吉林敖东	37,000	683,390.00	0.24
139	002508	老板电器	18,900	680,778.00	0.24
140	000983	山西焦煤	81,420	673,343.40	0.24
141	600580	卧龙电驱	36,600	669,414.00	0.24
142	600316	洪都航空	17,100	667,926.00	0.24
143	603198	迎驾贡酒	9,600	666,720.00	0.24
144	000629	攀钢钒钛	171,200	665,968.00	0.24

145	300115	长盈精密	33,556	665,751.04	0.24
146	002249	大洋电机	75,500	663,645.00	0.24
147	601997	贵阳银行	101,800	662,718.00	0.23
148	002131	利欧股份	269,009	661,762.14	0.23
149	002373	千方科技	44,100	659,295.00	0.23
150	300017	网宿科技	97,600	652,944.00	0.23
151	002603	以岭药业	33,300	652,680.00	0.23
152	002936	郑州银行	204,776	647,092.16	0.23
153	002422	科伦药业	34,000	643,620.00	0.23
154	600118	中国卫星	23,600	640,740.00	0.23
155	600170	上海建工	177,500	639,000.00	0.23
156	000825	太钢不锈	90,700	638,528.00	0.23
157	000887	中鼎股份	29,200	636,852.00	0.23
158	000050	深天马 A	48,900	636,678.00	0.23
159	603218	日月股份	19,300	635,935.00	0.23
160	300070	碧水源	88,300	634,877.00	0.22
161	600859	王府井	23,375	631,125.00	0.22
162	600166	福田汽车	183,100	629,864.00	0.22
163	000400	许继电气	24,100	629,010.00	0.22
164	600803	新奥股份	34,100	626,076.00	0.22
165	000750	国海证券	151,920	624,391.20	0.22
166	002191	劲嘉股份	41,100	621,843.00	0.22
167	600867	通化东宝	56,700	621,432.00	0.22
168	600153	建发股份	68,400	620,388.00	0.22
169	002506	协鑫集成	163,000	619,400.00	0.22
170	002926	华西证券	62,800	618,580.00	0.22
171	002372	伟星新材	25,400	617,728.00	0.22
172	600258	首旅酒店	23,620	617,190.60	0.22
173	300001	特锐德	24,800	616,776.00	0.22
174	300168	万达信息	47,312	616,002.24	0.22
175	000027	深圳能源	75,720	613,332.00	0.22
176	002056	横店东磁	32,500	613,275.00	0.22
177	002266	浙富控股	85,780	610,753.60	0.22
178	603707	健友股份	14,520	609,840.00	0.22
179	600909	华安证券	112,390	608,029.90	0.22
180	600236	桂冠电力	94,200	604,764.00	0.21
181	002002	鸿达兴业	99,508	603,018.48	0.21
182	300251	光线传媒	46,900	602,665.00	0.21
183	600008	首创环保	175,220	597,500.20	0.21
184	002065	东华软件	76,600	597,480.00	0.21
185	300009	安科生物	45,632	597,322.88	0.21
186	000513	丽珠集团	14,853	597,239.13	0.21

187	000997	新大陆	32,919	596,492.28	0.21
188	600066	宇通客车	54,100	596,182.00	0.21
189	600271	航天信息	44,300	593,177.00	0.21
190	000021	深科技	37,200	589,248.00	0.21
191	600536	中国软件	11,800	589,174.00	0.21
192	002152	广电运通	49,500	589,050.00	0.21
193	002408	齐翔腾达	55,793	585,826.50	0.21
194	600171	上海贝岭	22,800	585,048.00	0.21
195	000975	银泰黄金	66,472	583,624.16	0.21
196	002203	海亮股份	46,900	582,967.00	0.21
197	002221	东华能源	46,100	580,399.00	0.21
198	300244	迪安诊断	17,280	580,089.60	0.21
199	603156	养元饮品	20,200	573,882.00	0.20
200	300630	普利制药	10,413	573,131.52	0.20
201	600535	天士力	36,100	572,185.00	0.20
202	000656	金科股份	127,700	572,096.00	0.20
203	600348	华阳股份	48,000	568,800.00	0.20
204	002500	山西证券	85,990	567,534.00	0.20
205	002572	索菲亚	25,400	563,880.00	0.20
206	300212	易华录	15,940	563,479.00	0.20
207	300026	红日药业	71,900	562,977.00	0.20
208	601005	重庆钢铁	267,300	558,657.00	0.20
209	300024	机器人	49,800	556,266.00	0.20
210	600315	上海家化	13,600	549,576.00	0.19
211	600998	九州通	37,200	547,584.00	0.19
212	603568	伟明环保	14,979	547,182.87	0.19
213	000878	云南铜业	40,700	544,159.00	0.19
214	000970	中科三环	33,900	544,095.00	0.19
215	000012	南玻A	54,775	543,915.75	0.19
216	002127	南极电商	78,400	540,960.00	0.19
217	601699	潞安环能	47,700	539,487.00	0.19
218	002683	广东宏大	17,900	539,148.00	0.19
219	002745	木林森	35,500	537,115.00	0.19
220	002195	二三四五	228,685	535,122.90	0.19
221	000537	广宇发展	22,200	535,020.00	0.19
222	300315	掌趣科技	110,000	534,600.00	0.19
223	000999	华润三九	15,600	534,144.00	0.19
224	600673	东阳光	60,000	532,800.00	0.19
225	603712	七一二	12,300	532,590.00	0.19
226	002250	联化科技	29,500	530,115.00	0.19
227	600415	小商品城	109,300	530,105.00	0.19
228	601872	招商轮船	129,100	529,310.00	0.19



229	600801	华新水泥	27,172	524,419.60	0.19
230	002511	中顺洁柔	31,200	521,352.00	0.18
231	002019	亿帆医药	29,500	519,790.00	0.18
232	300182	捷成股份	81,900	518,427.00	0.18
233	300463	迈克生物	17,700	516,663.00	0.18
234	688006	杭可科技	4,799	516,276.42	0.18
235	002153	石基信息	17,900	514,446.00	0.18
236	000690	宝新能源	86,600	512,672.00	0.18
237	600863	内蒙华电	129,700	511,018.00	0.18
238	600208	新湖中宝	171,000	509,580.00	0.18
239	600970	中材国际	44,200	505,206.00	0.18
240	000060	中金岭南	102,000	500,820.00	0.18
241	002831	裕同科技	14,820	499,285.80	0.18
242	600517	国网英大	68,400	498,636.00	0.18
243	601778	晶科科技	57,700	492,181.00	0.17
244	000686	东北证券	55,900	490,802.00	0.17
245	300482	万孚生物	12,390	487,918.20	0.17
246	600380	健康元	37,996	487,868.64	0.17
247	600839	四川长虹	147,300	487,563.00	0.17
248	600498	烽火通信	27,100	487,258.00	0.17
249	601866	中远海发	149,800	486,850.00	0.17
250	002294	信立泰	17,800	486,296.00	0.17
251	600155	华创阳安	48,700	485,052.00	0.17
252	002505	鹏都农牧	126,670	483,879.40	0.17
253	000930	中粮科技	44,500	483,715.00	0.17
254	603858	步长制药	22,800	480,852.00	0.17
255	002939	长城证券	37,000	479,150.00	0.17
256	600390	五矿资本	89,800	477,736.00	0.17
257	000729	燕京啤酒	56,200	476,014.00	0.17
258	002701	奥瑞金	67,780	474,460.00	0.17
259	600667	太极实业	58,700	474,296.00	0.17
260	600511	国药股份	15,000	472,950.00	0.17
261	600500	中化国际	55,120	471,827.20	0.17
262	601992	金隅集团	166,100	471,724.00	0.17
263	000401	冀东水泥	39,400	471,224.00	0.17
264	600718	东软集团	34,700	470,532.00	0.17
265	600728	佳都科技	56,200	468,146.00	0.17
266	600895	张江高科	30,800	463,848.00	0.16
267	600158	中体产业	30,600	462,672.00	0.16
268	688188	柏楚电子	1,200	462,552.00	0.16
269	300376	易事特	46,000	462,300.00	0.16
270	600764	中国海防	11,300	459,458.00	0.16

271	600216	浙江医药	26,900	459,452.00	0.16
272	002430	杭氧股份	15,300	459,153.00	0.16
273	002004	华邦健康	63,250	457,930.00	0.16
274	002382	蓝帆医疗	28,100	457,749.00	0.16
275	688029	南微医学	2,138	454,688.46	0.16
276	601179	中国西电	81,800	453,990.00	0.16
277	002532	天山铝业	55,700	453,955.00	0.16
278	002128	电投能源	30,540	453,519.00	0.16
279	600282	南钢股份	122,500	453,250.00	0.16
280	603225	新凤鸣	30,440	452,034.00	0.16
281	000598	兴蓉环境	71,500	451,880.00	0.16
282	002966	苏州银行	66,500	450,205.00	0.16
283	300072	三聚环保	56,300	446,459.00	0.16
284	002368	太极股份	16,158	444,991.32	0.16
285	002670	国盛金控	46,336	444,825.60	0.16
286	002595	豪迈科技	16,000	444,160.00	0.16
287	600985	淮北矿业	39,700	443,846.00	0.16
288	002174	游族网络	29,100	443,484.00	0.16
289	000540	中天金融	167,600	442,464.00	0.16
290	002396	星网锐捷	18,600	438,402.00	0.16
291	600528	中铁工业	52,947	434,694.87	0.15
292	603866	桃李面包	15,188	431,339.20	0.15
293	000581	威孚高科	20,000	430,800.00	0.15
294	002048	宁波华翔	19,900	430,437.00	0.15
295	600297	广汇汽车	161,200	430,404.00	0.15
296	600409	三友化工	49,400	429,780.00	0.15
297	603638	艾迪精密	13,420	428,366.40	0.15
298	002958	青农商行	110,700	427,302.00	0.15
299	002010	传化智联	48,900	425,430.00	0.15
300	601717	郑煤机	36,700	425,353.00	0.15
301	600827	百联股份	31,900	425,227.00	0.15
302	600755	厦门国贸	58,900	424,669.00	0.15
303	600567	山鹰国际	128,700	423,423.00	0.15
304	002925	盈趣科技	12,420	422,652.60	0.15
305	600060	海信视像	31,300	420,985.00	0.15
306	300271	华宇软件	32,900	417,830.00	0.15
307	603885	吉祥航空	23,500	417,125.00	0.15
308	000709	河钢股份	169,000	415,740.00	0.15
309	600131	国网信通	19,000	415,150.00	0.15
310	000778	新兴铸管	95,600	413,948.00	0.15
311	600598	北大荒	28,200	410,592.00	0.15
312	002183	怡亚通	61,900	409,778.00	0.15

313	002075	沙钢股份	70,100	408,683.00	0.14
314	000883	湖北能源	77,800	407,672.00	0.14
315	600967	内蒙一机	33,997	406,264.15	0.14
316	600325	华发股份	67,270	404,965.40	0.14
317	002690	美亚光电	10,800	404,568.00	0.14
318	600820	隧道股份	75,100	404,038.00	0.14
319	600507	方大特钢	51,596	402,448.80	0.14
320	600566	济川药业	14,200	402,428.00	0.14
321	600782	新钢股份	76,100	401,808.00	0.14
322	600737	中粮糖业	42,700	401,380.00	0.14
323	600021	上海电力	31,300	401,266.00	0.14
324	603883	老百姓	8,123	401,113.74	0.14
325	601456	国联证券	28,600	399,542.00	0.14
326	000990	诚志股份	24,900	393,918.00	0.14
327	002434	万里扬	26,700	393,558.00	0.14
328	002281	光迅科技	16,800	391,272.00	0.14
329	600707	彩虹股份	57,300	390,786.00	0.14
330	600022	山东钢铁	218,170	390,524.30	0.14
331	601880	辽港股份	225,340	389,838.20	0.14
332	603927	中科软	14,200	388,512.00	0.14
333	000987	越秀金控	44,500	387,150.00	0.14
334	600663	陆家嘴	35,200	382,272.00	0.14
335	601106	中国一重	109,700	381,756.00	0.14
336	600435	北方导航	35,700	381,276.00	0.14
337	002124	天邦股份	58,580	377,255.20	0.13
338	002146	荣盛发展	86,700	377,145.00	0.13
339	600446	金证股份	26,300	376,616.00	0.13
340	601577	长沙银行	48,200	376,442.00	0.13
341	600572	康恩贝	74,654	373,270.00	0.13
342	603650	彤程新材	7,200	362,304.00	0.13
343	002390	信邦制药	48,500	359,870.00	0.13
344	601118	海南橡胶	68,000	359,040.00	0.13
345	000898	鞍钢股份	95,600	358,500.00	0.13
346	600329	中新药业	11,400	358,074.00	0.13
347	688088	虹软科技	8,100	356,886.00	0.13
348	000877	天山股份	23,300	356,723.00	0.13
349	600811	东方集团	118,330	356,173.30	0.13
350	600259	广晟有色	7,200	354,528.00	0.13
351	600597	光明乳业	24,402	354,317.04	0.13
352	000488	晨鸣纸业	48,750	352,950.00	0.13
353	002440	闰土股份	36,800	352,912.00	0.13
354	600808	马钢股份	95,436	352,158.84	0.12

355	603228	景旺电子	10,168	351,101.04	0.12
356	002233	塔牌集团	33,120	350,409.60	0.12
357	002429	兆驰股份	72,000	349,920.00	0.12
358	002155	湖南黄金	33,704	349,173.44	0.12
359	300166	东方国信	31,978	345,362.40	0.12
360	688321	微芯生物	9,800	343,098.00	0.12
361	001914	招商积余	16,900	342,394.00	0.12
362	002416	爱施德	29,780	338,896.40	0.12
363	601200	上海环境	26,870	338,293.30	0.12
364	600908	无锡银行	59,600	337,932.00	0.12
365	600037	歌华有线	38,900	337,652.00	0.12
366	002085	万丰奥威	61,000	334,890.00	0.12
367	000559	万向钱潮	52,500	334,425.00	0.12
368	600373	中文传媒	27,000	333,720.00	0.12
369	002110	三钢闽光	48,850	332,180.00	0.12
370	600398	海澜之家	51,600	330,756.00	0.12
371	600906	财达证券	25,800	329,208.00	0.12
372	600026	中远海能	55,459	328,317.28	0.12
373	600167	联美控股	36,380	327,783.80	0.12
374	002081	金螳螂	53,400	324,672.00	0.12
375	601000	唐山港	118,046	324,626.50	0.12
376	600546	山煤国际	39,500	324,295.00	0.11
377	002705	新宝股份	13,100	323,570.00	0.11
378	600064	南京高科	34,620	323,350.80	0.11
379	601991	大唐发电	99,100	321,084.00	0.11
380	000528	柳工	41,299	318,415.29	0.11
381	600195	中牧股份	24,300	317,601.00	0.11
382	603000	人民网	22,000	317,240.00	0.11
383	000961	中南建设	76,300	315,882.00	0.11
384	601611	中国核建	31,500	314,055.00	0.11
385	601718	际华集团	105,200	313,496.00	0.11
386	000685	中山公用	35,400	313,290.00	0.11
387	002867	周大生	17,500	311,150.00	0.11
388	002038	双鹭药业	28,700	310,247.00	0.11
389	601608	中信重工	69,400	309,524.00	0.11
390	000158	常山北明	44,470	307,732.40	0.11
391	002387	维信诺	33,100	307,168.00	0.11
392	300133	华策影视	45,300	306,681.00	0.11
393	600120	浙江东方	69,198	305,855.16	0.11
394	000959	首钢股份	53,200	304,836.00	0.11
395	000090	天健集团	51,871	304,482.77	0.11
396	601333	广深铁路	135,700	303,968.00	0.11

397	000758	中色股份	55,100	300,846.00	0.11
398	000089	深圳机场	41,000	300,120.00	0.11
399	000671	阳光城	98,900	298,678.00	0.11
400	600376	首开股份	51,600	292,056.00	0.10
401	003022	联泓新科	8,000	291,520.00	0.10
402	600582	天地科技	66,200	289,956.00	0.10
403	000415	渤海租赁	99,000	288,090.00	0.10
404	688289	圣湘生物	4,853	286,327.00	0.10
405	000718	苏宁环球	60,200	283,542.00	0.10
406	601598	中国外运	63,100	282,688.00	0.10
407	002242	九阳股份	12,126	281,323.20	0.10
408	000967	盈峰环境	37,900	277,807.00	0.10
409	600062	华润双鹤	20,732	277,186.84	0.10
410	600126	杭钢股份	53,930	276,660.90	0.10
411	601975	招商南油	137,400	276,174.00	0.10
412	600307	酒钢宏兴	124,500	273,900.00	0.10
413	601098	中南传媒	28,600	273,702.00	0.10
414	002458	益生股份	23,800	269,178.00	0.10
415	000402	金融街	47,500	268,850.00	0.10
416	600556	天下秀	21,700	267,995.00	0.09
417	001965	招商公路	34,500	264,615.00	0.09
418	601958	金钼股份	38,600	264,410.00	0.09
419	600959	江苏有线	80,000	263,200.00	0.09
420	600643	爱建集团	38,550	260,598.00	0.09
421	002399	海普瑞	15,000	256,500.00	0.09
422	000563	陕国投 A	78,800	254,524.00	0.09
423	600056	中国医药	21,400	252,734.00	0.09
424	300257	开山股份	15,800	250,904.00	0.09
425	002563	森马服饰	32,400	250,452.00	0.09
426	003035	南网能源	30,200	250,358.00	0.09
427	601928	凤凰传媒	30,500	246,745.00	0.09
428	601860	紫金银行	72,800	243,880.00	0.09
429	600266	城建发展	54,058	243,261.00	0.09
430	600717	天津港	57,858	242,425.02	0.09
431	600901	江苏租赁	47,400	241,266.00	0.09
432	603317	天味食品	8,964	240,324.84	0.09
433	600968	海油发展	81,200	237,916.00	0.08
434	300741	华宝股份	4,900	234,465.00	0.08
435	002815	崇达技术	13,900	234,215.00	0.08
436	000937	冀中能源	42,300	233,073.00	0.08
437	002244	滨江集团	49,700	231,602.00	0.08
438	600095	湘财股份	22,800	230,736.00	0.08

439	000717	韶钢松山	48,500	230,375.00	0.08
440	600928	西安银行	53,200	228,760.00	0.08
441	002423	中粮资本	27,400	221,940.00	0.08
442	000028	国药一致	6,000	221,880.00	0.08
443	002468	申通快递	24,400	221,796.00	0.08
444	600787	中储股份	34,900	217,776.00	0.08
445	600776	东方通信	18,900	217,539.00	0.08
446	600006	东风汽车	31,800	216,558.00	0.08
447	000062	深圳华强	12,510	215,547.30	0.08
448	002424	贵州百灵	28,300	215,080.00	0.08
449	600729	重庆百货	8,100	210,762.00	0.07
450	600649	城投控股	50,600	207,966.00	0.07
451	600623	华谊集团	22,700	206,570.00	0.07
452	600339	中油工程	66,600	205,128.00	0.07
453	600835	上海机电	12,800	203,776.00	0.07
454	601139	深圳燃气	23,000	203,090.00	0.07
455	002375	亚厦股份	26,800	200,732.00	0.07
456	600299	安迪苏	16,100	198,352.00	0.07
457	600648	外高桥	14,900	197,127.00	0.07
458	300869	康泰医学	4,800	194,640.00	0.07
459	601969	海南矿业	16,100	193,361.00	0.07
460	000031	大悦城	51,200	190,976.00	0.07
461	000156	华数传媒	22,000	186,120.00	0.07
462	600639	浦东金桥	13,600	173,672.00	0.06
463	002653	海思科	8,500	173,400.00	0.06
464	600871	石化油服	80,900	173,126.00	0.06
465	000869	张裕 A	5,400	172,044.00	0.06
466	600377	宁沪高速	19,800	170,676.00	0.06
467	601828	美凯龙	18,800	165,628.00	0.06
468	603379	三美股份	7,240	164,927.20	0.06
469	601228	广州港	49,400	164,502.00	0.06
470	002302	西部建设	20,000	160,600.00	0.06
471	601298	青岛港	28,100	159,889.00	0.06
472	603708	家家悦	9,600	159,744.00	0.06
473	601869	长飞光纤	4,800	157,152.00	0.06
474	000046	泛海控股	82,700	155,476.00	0.06
475	001872	招商港口	9,000	152,550.00	0.05
476	002948	青岛银行	32,700	151,401.00	0.05
477	601156	东航物流	6,900	150,972.00	0.05
478	600823	世茂股份	45,000	147,600.00	0.05
479	002945	华林证券	10,700	146,162.00	0.05
480	000553	安道麦 A	17,200	145,168.00	0.05

481	603786	科博达	1,800	144,540.00	0.05
482	001203	大中矿业	9,100	137,228.00	0.05
483	603719	良品铺子	3,200	135,904.00	0.05
484	603355	莱克电气	4,560	133,699.20	0.05
485	601568	北元集团	15,800	128,454.00	0.05
486	600657	信达地产	34,400	128,312.00	0.05
487	600350	山东高速	24,700	127,452.00	0.05
488	603056	德邦股份	12,200	124,806.00	0.04
489	600466	蓝光发展	60,620	123,664.80	0.04
490	603515	欧普照明	5,920	122,899.20	0.04
491	601665	齐鲁银行	19,900	111,042.00	0.04
492	002946	新乳业	6,900	109,986.00	0.04
493	601003	柳钢股份	20,600	107,532.00	0.04
494	600917	重庆燃气	12,600	105,714.00	0.04
495	600956	新天绿能	5,600	96,376.00	0.03
496	600903	贵州燃气	9,140	88,475.20	0.03
497	002901	大博医疗	1,700	86,054.00	0.03
498	603868	飞科电器	1,900	82,498.00	0.03
499	601187	厦门银行	11,600	80,040.00	0.03
500	603983	丸美股份	2,100	66,927.00	0.02
501	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.01
502	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
503	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
504	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
505	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00

### 8.3.2 期末积极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

## 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初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603486	科沃斯	3,105,520.00	0.38
2	688002	睿创微纳	2,709,379.83	0.33
3	688099	晶晨股份	2,678,754.50	0.33
4	603589	口子窖	2,531,641.00	0.31
5	000799	酒鬼酒	2,365,713.00	0.29
6	601799	星宇股份	2,071,710.00	0.26
7	603345	安井食品	1,880,635.40	0.23
8	600522	中天科技	1,833,228.00	0.23
9	002791	坚朗五金	1,779,287.86	0.22
10	603816	顾家家居	1,740,788.00	0.22

11	600157	永泰能源	1,690,973.00	0.21
12	000733	振华科技	1,643,361.00	0.20
13	300751	迈为股份	1,500,466.00	0.19
14	600399	抚顺特钢	1,488,282.00	0.18
15	002384	东山精密	1,413,418.00	0.17
16	605358	立昂微	1,410,340.00	0.17
17	688088	虹软科技	1,389,095.74	0.17
18	601865	福莱特	1,379,255.00	0.17
19	601555	东吴证券	1,321,510.70	0.16
20	688005	容百科技	1,311,167.21	0.16

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 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	14,248,061.46	1.76
2	002709	天赐材料	8,344,880.36	1.03
3	300012	华测检测	8,121,160.00	1.00
4	002074	国轩高科	6,484,895.90	0.80
5	300595	欧普康视	6,420,837.63	0.79
6	300496	中科创达	6,330,464.25	0.78
7	300207	欣旺达	5,636,150.94	0.70
8	603345	安井食品	5,235,351.60	0.65
9	300316	晶盛机电	4,971,137.81	0.61
10	002340	格林美	4,797,485.00	0.59
11	603486	科沃斯	4,639,111.00	0.57
12	002568	百润股份	4,571,487.40	0.56
13	002791	坚朗五金	4,518,216.00	0.56
14	300285	国瓷材料	4,439,864.08	0.55
15	600089	特变电工	3,655,017.44	0.45
16	002648	卫星化学	3,615,675.80	0.45
17	603737	三棵树	3,366,066.20	0.42
18	002625	光启技术	3,365,073.00	0.42
19	002185	华天科技	3,298,400.00	0.41
20	000009	中国宝安	3,241,296.00	0.40

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

#### 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	206,498,802.18
卖出股票收入（成交）总额	518,887,448.87

注：本项的“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 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）	16,000.00	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,000.00	0.01

## 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	113634	珀莱转债	160	16,000.00	0.01

## 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持有股指期货。

## 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持有国债期货。

## 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

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 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	50,578.62
2	应收证券清算款	72,464.01
3	应收股利	-
4	应收利息	583.02
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,625.65

### 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制的情况。

### 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 (%)
389	448,120.02	172,673,757.00	99.06	1,644,930.00	0.94

### 9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

### 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	中信证券股份有限公司	2,387,471.00	1.37
2	姜晓平	235,683.00	0.14
3	张红艳	197,700.00	0.11
4	陈妙琴	139,373.00	0.08
5	朱庆芳	115,758.00	0.07
6	李淑清	69,455.00	0.04
7	钮冰融	46,303.00	0.03
8	刘秀珍	46,303.00	0.03
9	陆鸣	32,000.00	0.02
10	江瑞明	29,400.00	0.02
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	170,286,286.00	97.69

注：表中前十名持有人为除国寿安保中证 500ETF 联接基金之外的前十名持有人。

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 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

本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2015年5月29日）基金份额总额	665,869,631.00
本报告期期初基金份额总额	588,318,687.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	424,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	174,318,687.00

## § 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。

2021 年 5 月，中国农业银行总行决定谭敦宇任托管业务部总裁。

2021 年 8 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部副总裁。

### 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安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，自 2021 年 10 月 20 日起，改聘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，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 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	
海通证券	2	309,072,212.24	43.11%	287,842.60	45.40%	-
国泰君安	2	290,279,298.80	40.48%	270,338.01	42.64%	-

中银国际	2	110,471,500.72	15.41%	69,740.96	11.00%	-
中信证券	2	4,152,382.11	0.58%	3,867.07	0.61%	-
长城证券	2	3,034,731.99	0.42%	2,219.33	0.35%	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

### 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
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
海通证券	60,227.20	5.63%	-	-	-	-
国泰君安	831,290.97	77.66%	-	-	-	-
中银国际	156,684.10	14.64%	-	-	-	-
中信证券	22,168.00	2.07%	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-

### 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 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年第 4 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 1 月 22 日
2	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2020 年年度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 3 月 31 日
3	关于国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同部分条款的公告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
4	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
6	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 2 日
7	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 1 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 4 月 22 日
8	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 2 季度报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 7 月 21 日
9	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年中期报告	中证报、证监会指定网站及公司网站	2021 年 8 月 31 日
10	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 3 季度报告	中证报、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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20210101~20211231	585,486,286.00	8,800,000.00	424,000,000.00	170,286,286.00	97.69
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形，可能存在大额赎回的风险，并导致基金净值波动。此外，机构投资者赎回后，可能导致基金规模大幅减小，不利于基金的正常运作。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>							

### 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 500 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 500 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 500 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 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

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