

国寿安保中证 500 交易型开放式
指数证券投资基金
2023 年年度报告

2023 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：2024 年 3 月 30 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 2024 年 03 月 29 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 2023 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	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 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	12
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	12
§ 5 托管人报告	12
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
§ 6 审计报告	12
6.1 审计报告基本信息	12
6.2 审计报告的基本内容	13
§ 7 年度财务报表	14
7.1 资产负债表	14
7.2 利润表	16
7.3 净资产变动表	17
7.4 报表附注	18

§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
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	58
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 本基金投资股指期货的投资政策	58
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
8.12 投资组合报告附注	59
§ 9 基金份额持有人信息	60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	60
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
§ 10 开放式基金份额变动	61
§ 11 重大事件揭示	61
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	62
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	62
11.8 其他重大事件	63
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	63
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	64
§ 13 备查文件目录	64
13.1 备查文件目录	64
13.2 存放地点	64
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	140,318,687.00 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	韩占锋	任航
	联系电话	010-50850744	010-66060069
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850776	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 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		于泳	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	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.gsfunds.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	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	2023 年	2022 年	2021 年
本期已实现收益	-4,666,306.91	-2,144,783.77	137,113,025.32
本期利润	-11,820,792.45	-51,427,151.03	73,201,604.26
加权平均基金份额本期利润	-0.0848	-0.2991	0.2210
本期加权平均净值利润率	-6.35%	-21.56%	15.30%
本期基金份额净值增长率	-6.45%	-19.02%	17.67%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-130,955,930.13	-117,397,141.64	-94,291,542.96
期末可供分配基金份额利润	-0.9333	-0.8487	-0.5409
期末基金资产净值	172,087,499.27	181,326,928.22	282,180,998.55
期末基金份额净值	1.2264	1.3109	1.6188
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-43.21%	-39.30%	-25.04%

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

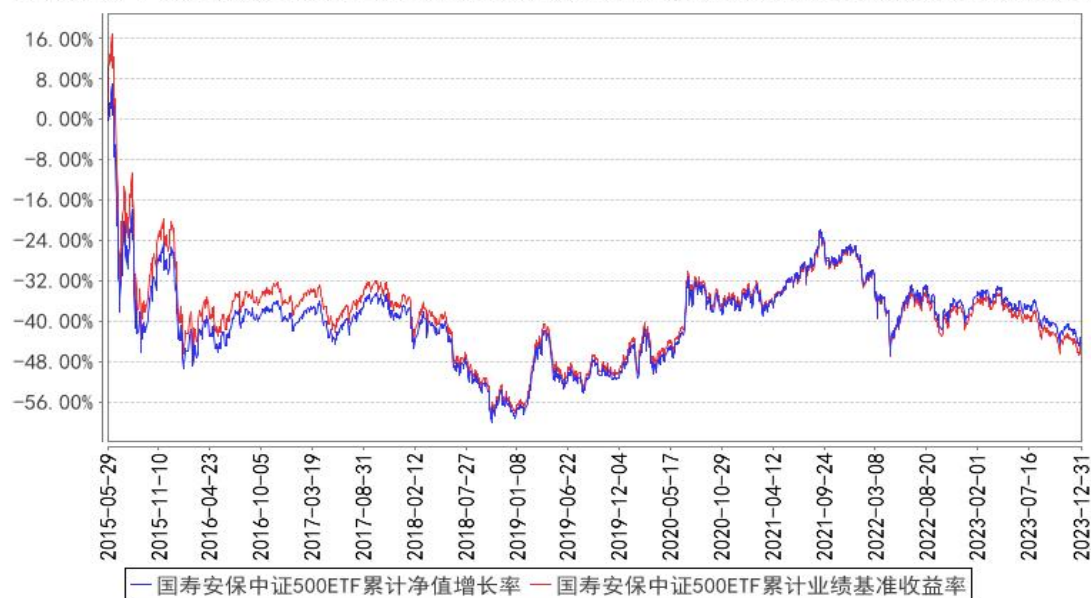
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-4.76%	0.85%	-4.60%	0.86%	-0.16%	-0.01%
过去六个月	-9.39%	0.85%	-9.49%	0.86%	0.10%	-0.01%

过去一年	-6.45%	0.82%	-7.42%	0.82%	0.97%	0.00%
过去三年	-10.85%	1.07%	-14.73%	1.08%	3.88%	-0.01%
过去五年	37.44%	1.28%	30.26%	1.29%	7.18%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-43.21%	1.56%	-44.98%	1.58%	1.77%	-0.02%

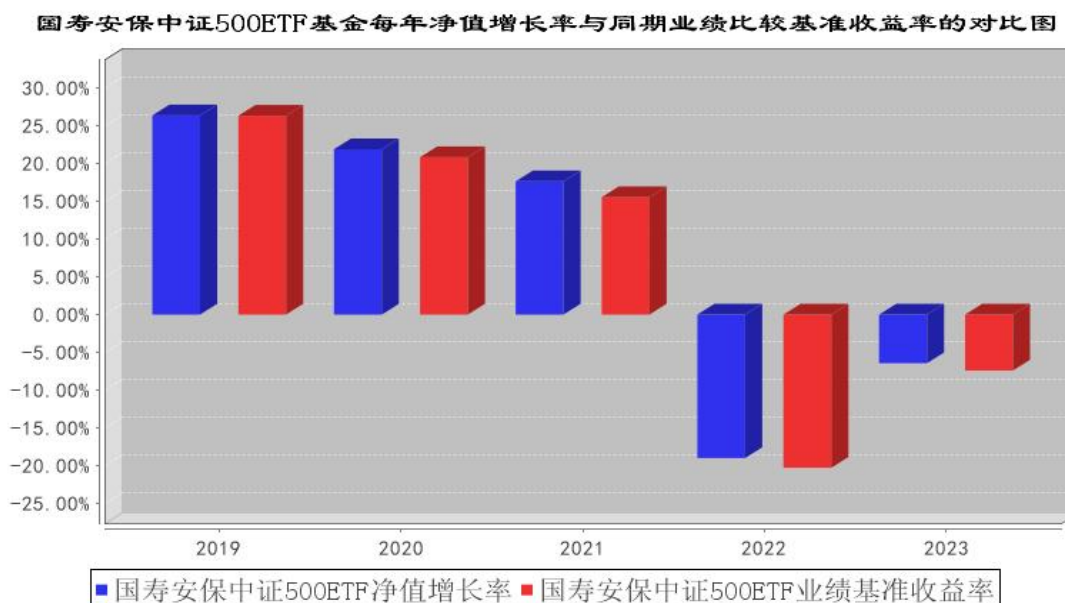
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国寿安保中证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 2023 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%，National Mutual Funds Management Ltd.（国家共同基金管理有限公司），其持有股份14.97%。

截至2023年12月31日，公司共管理98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3313.85亿元，其中公募证券投资基金管理规模为2706.95亿元。

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	-	13 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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日常申赎、预留现金头寸等因素引起的成份股权重偏离。市场波动、成分股调整和停复牌等因素，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 1.2264 元；本报告期基金份额净值增长率为 -6.45%，业绩比较基准收益率为 -7.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾 2023 年股票市场走势一波三折，年初疫情峰值平稳过度后，在经济修复预期下市场震荡上涨，但后续经济数据逐步低于预期，市场进入了“高预期、弱现实”的宏观环境。宏观政策托底意图明显，但并未像过去一样出台大规模强刺激政策，仍然遵循稳中求进，更多的是让经济符合规律地寻找新的平衡点。全年权益市场主要指数均有所下跌，其中创业板 50 跌幅达 24%，沪深 300 指数下跌 -11.38%，中证 500 和中证 1000 跌幅均超过 -6%，恒生指数全年跌幅达到 -13.82%。市场结构分化明显，小市值因子整体占优，受益人工智能业务发展的通信、传媒和计算机等行业成为贯穿全年的投资主线，中特估等板块也有阶段性演绎，新能源、消费和房地产等板块跌幅居前。

展望 2024 年，中国经济韧性十足、稳中向好的态势没有改变。2023 年 GDP 增速 5.2% 圆满完成预定目标，高质量发展结构调整初见成效。随着地产销售有望逐步企稳，受益于降首付、降利率和城中村改造等政策，前期观望的购房需求陆续释放，带动众

多相关产业链复苏。伴随经济企稳，居民收入预期也有望逐步向好，促进消费业绩修复。出口产业链特别是汽车、电子等高端制造行业出口逐步改善，经济整体向好态势有望延续。2023 年 CPI、PPI 处于低位运行，在联储加息顶部出现的背景下，随着汇率压力的缓解，货币政策留有充分空间。整体来看，企业利润有望稳步回升，带动权益市场业绩和估值修复，当前时点股债收益差运行在高性价比区间，权益市场具有良好的中长期配置价值。

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

4.8 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 2023 年 01 月 01 日至 2023 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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对本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，未发现有关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(2024)第 22358 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 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产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 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</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 500ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
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。其他信息包括国寿安保中证 500ETF 基金 2023 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	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

	<p>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 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 李哲虹
会计师事务所的地址	中国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
审计报告日期	2024 年 3 月 29 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：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	2,101,931.78	1,832,598.11

结算备付金		10,629.17	-
存出保证金		2,762.69	2,044.90
交易性金融资产	7.4.7.2	170,314,102.49	179,929,906.55
其中：股票投资		170,300,902.08	179,894,906.09
基金投资		-	-
债券投资		13,200.41	35,000.46
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		1,358,958.00	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		173,788,384.13	181,764,549.56
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负 债：			
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		-	-
应付清算款		1,384,953.78	35,000.00
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		72,286.24	87,018.20
应付托管费		14,457.25	17,403.65
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	229,187.59	298,199.47
负债合计		1,700,884.86	437,621.34
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	303,043,429.40	298,724,069.86
其他综合收益	7.4.7.11	-	-

未分配利润	7.4.7.12	-130,955,930.13	-117,397,141.64
净资产合计		172,087,499.27	181,326,928.22
负债和净资产总计		173,788,384.13	181,764,549.56

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值人民币 1.2264 元，基金份额总额 140,318,687.00 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-10,411,738.09	-49,683,010.46
1. 利息收入		13,971.78	15,583.96
其中：存款利息收入	7.4.7.13	13,971.78	15,583.96
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-3,268,455.71	-503,199.42
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-6,362,725.63	-4,727,106.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	39,657.05	126,032.38
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	3,054,612.87	4,097,874.24
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-7,154,485.54	-49,282,367.26
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-2,768.62	86,972.26
减：二、营业总支出		1,409,054.36	1,744,140.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	931,293.98	1,193,177.57
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	186,258.85	238,635.64
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		0.11	0.27
8. 其他费用	7.4.7.23	291,501.42	312,327.09
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-11,820,792.45	-51,427,151.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-11,820,792.45	-51,427,151.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-11,820,792.45	-51,427,151.03

7.3 净资产变动表

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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,319,359.54	-	-13,558,788.49	-9,239,428.95
（一）、综合收益总额	-	-	-11,820,792.45	-11,820,792.45
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	4,319,359.54	-	-1,737,996.04	2,581,363.50
其中：1. 基金申购款	8,638,719.07	-	-3,506,046.75	5,132,672.32
2. 基金赎回款	-4,319,359.53	-	1,768,050.71	-2,551,308.82
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	303,043,429.40	-	-130,955,930.13	172,087,499.27
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	376,472,541.51	-	-94,291,542.96	282,180,998.55
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	376,472,541.51	-	-94,291,542.96	282,180,998.55
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-77,748,471.65	-	-23,105,598.68	-100,854,070.33
（一）、综合收益总额	-	-	-51,427,151.03	-51,427,151.03
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-77,748,471.65	-	28,321,552.35	-49,426,919.30
其中：1. 基金申购款	4,319,359.53	-	-1,390,285.19	2,929,074.34
2. 基金赎回款	-82,067,831.18	-	29,711,837.54	-52,355,993.64
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22

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：

鄂华

王文英

于晓树

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

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》注册,由国寿安保基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证 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 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国寿安保于 2024 年 3 月 29 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其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计

核算业务指引》、《国寿安保中证 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

本基金财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本

基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按

照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

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净资产比例计算的金额。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净资产比例计算的金额。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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额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相关交易费用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。

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，以及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当期损益。

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。

以摊余成本计量的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净资产转出。

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(可转换债券和可交换债券除外)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》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于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(可转换债券和可交换债券除外)，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[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关

于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	2,101,931.78	1,832,598.11
等于：本金	2,101,468.11	1,832,214.61
加：应计利息	463.67	383.50
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	2,101,931.78	1,832,598.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	195,845,955.66	-	170,300,902.08	-25,545,053.58	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	13,200.00	0.41	13,200.41	0.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,200.00	0.41	13,200.41	0.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	195,859,155.66	0.41	170,314,102.49	-25,545,053.58	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	198,285,474.13	-	179,894,906.09	-18,390,568.04	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	35,000.00	0.46	35,000.46	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	35,000.00	0.46	35,000.46	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	198,320,474.13	0.46	179,929,906.55	-18,390,568.04

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 债权投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有债权投资。

7.4.7.6 其他债权投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他债权投资。

7.4.7.7 其他权益工具投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 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。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022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	-	-
应付交易费用	44,187.59	93,199.47
其中：交易所市场	44,187.59	93,199.47
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	150,000.00	170,000.00
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
合计	229,187.59	298,199.47

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	138,318,687.00	298,724,069.86
本期申购	4,000,000.00	8,638,719.07
本期赎回（以“-”号填列）	-2,000,000.00	-4,319,359.53
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	140,318,687.00	303,043,429.40

7.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期末及上年度末均无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-57,606,069.55	-59,791,072.09	-117,397,141.64
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-57,606,069.55	-59,791,072.09	-117,397,141.64
本期利润	-4,666,306.91	-7,154,485.54	-11,820,792.45
本期基金份额交易产生的变动数	-864,771.21	-873,224.83	-1,737,996.04
其中：基金申购款	-1,726,552.23	-1,779,494.52	-3,506,046.75
基金赎回款	861,781.02	906,269.69	1,768,050.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-63,137,147.67	-67,818,782.46	-130,955,930.13

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
	活期存款利息收入	12,995.50
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	856.03	1,131.33
其他	120.25	99.57
合计	13,971.78	15,583.96

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-6,196,165.63	-3,720,976.42
股票投资收益——赎回差价收入	-166,560.00	-1,006,129.62
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	-6,362,725.63	-4,727,106.04

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日
卖出股票成交总额	47,778,094.73	108,468,639.12
减：卖出股票成本总额	53,851,082.46	111,884,788.19
减：交易费用	123,177.90	304,827.35
买卖股票差价收入	-6,196,165.63	-3,720,976.42

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
赎回基金份额对价总额	2,551,308.82	52,355,993.64
减：现金支付赎回款总额	1,286,688.82	25,701,196.64
减：赎回股票成本总额	1,431,180.00	27,660,926.62
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-166,560.00	-1,006,129.62

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
债券投资收益——利息收入	31.47	109.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	39,625.58	125,922.94

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	39,657.05	126,032.38

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	212,666.66	767,165.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	173,000.00	641,100.00
减：应计利息总额	32.57	113.65
减：交易费用	8.51	29.14
买卖债券差价收入	39,625.58	125,922.94

7.4.7.16 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。

7.4.7.17 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。

7.4.7.18 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。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	3,054,612.87	4,097,874.24
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	3,054,612.87	4,097,874.24

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
1. 交易性金融资产	-7,154,485.54	-49,282,367.26
股票投资	-7,154,485.54	-49,282,367.26

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	-7,154,485.54	-49,282,367.26

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	-2,768.62	86,972.26
合计	-2,768.62	86,972.26

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。

7.4.7.22 信用减值损失

本基金于本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
审计费用	30,000.00	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	1,501.42	2,326.52
指数使用费	140,000.00	140,000.00
存托服务费	-	0.57
合计	291,501.42	312,327.09

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

截至财务报表批准日，本基金无需要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、基金销售机构
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保中证 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：1. 根据国寿安保基金管理有限公司于 2023 年 12 月 2 日发布的公告，经中国证监会证监许可[2023]2391 号核准，国寿安保基金管理有限公司原股东 AMP Capital Investors Limited 将其持有的国寿安保基金管理有限公司 14.97%股权转让给 National Mutual Funds Management Ltd.。

2. 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	931,293.98	1,193,177.57
其中：应支付销售机构的客户维护费	-	-
应支付基金管理人的净管理费	931,293.98	1,193,177.57

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	186,258.85	238,635.64

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

本基金本报告期及上年度可比期间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 2023年12月31日		上年度末 2022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	136,446,586.00	97.24	136,246,286.00	98.50

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	2,101,931.78	12,995.50	1,832,598.11	14,353.06

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（2023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

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127102	浙建转债	2023年12月25日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.00	132	13,200.00	13,200.41	-

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

本基金本报告期末参与转融通证券出借业务。。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 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 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产					
货币资金	2,101,931.78	-	-	-	2,101,931.78
结算备付金	10,629.17	-	-	-	10,629.17
存出保证金	2,762.69	-	-	-	2,762.69
交易性金融资产	-	-	13,200.41	170,300,902.08	170,314,102.49
应收清算款	-	-	-	1,358,958.00	1,358,958.00
资产总计	2,115,323.64	-	13,200.41	171,659,860.08	173,788,384.13
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	72,286.24	72,286.24
应付托管费	-	-	-	14,457.25	14,457.25
应付清算款	-	-	-	1,384,953.78	1,384,953.78
其他负债	-	-	-	229,187.59	229,187.59
负债总计	-	-	-	1,700,884.86	1,700,884.86
利率敏感度缺口	2,115,323.64	-	13,200.41	169,958,975.22	172,087,499.27
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,832,598.11	-	-	-	1,832,598.11
存出保证金	2,044.90	-	-	-	2,044.90
交易性金融资产	-	-	35,000.46	179,894,906.09	179,929,906.55
资产总计	1,834,643.01	-	35,000.46	179,894,906.09	181,764,549.56
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	87,018.20	87,018.20
应付托管费	-	-	-	17,403.65	17,403.65
应付清算款	-	-	-	35,000.00	35,000.00
应交税费	-	-	-	0.02	0.02
其他负债	-	-	-	298,199.47	298,199.47
负债总计	-	-	-	437,621.34	437,621.34
利率敏感度缺口	1,834,643.01	-	35,000.46	179,457,284.75	181,326,928.22

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 2023 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 0.01%(2022 年 12 月 31 日：0.02%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2022 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 2023年12月31日		上年度末 2022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	170,300,902.08	98.96	179,894,906.09	99.21
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	13,200.41	0.01	35,000.46	0.02
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	170,314,102.49	98.97	179,929,906.55	99.23

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。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	+5%	8,518,289.23	8,885,019.48

	-5%	-8,518,289.23	-8,885,019.48
--	-----	---------------	---------------

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	170,300,902.08	179,212,773.80
第二层次	13,200.41	717,132.75
第三层次	-	-
合计	170,314,102.49	179,929,906.55

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-

当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	5,237.96	5,237.96
转出第三层次	-	6,156.38	6,156.38
当期利得或损失总额	-	918.42	918.42
其中：计入损益的利得或损失	-	918.42	918.42
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	9,503.95	9,503.95
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	9,336.45	9,336.45
当期利得或损失总额	-	-167.50	-167.50
其中：计入损益的利得或损失	-	-167.50	-167.50
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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(2022 年 12 月 31 日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	170,300,902.08	97.99
	其中：股票	170,300,902.08	97.99
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,200.41	0.01
	其中：债券	13,200.41	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	2,112,560.95	1.22
8	其他各项资产	1,361,720.69	0.78
9	合计	173,788,384.13	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	1,160,700.00	0.67
B	采矿业	6,608,512.18	3.84
C	制造业	107,434,773.78	62.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,562,189.40	3.23
E	建筑业	1,363,483.00	0.79
F	批发和零售业	5,158,290.62	3.00
G	交通运输、仓储和邮政业	3,170,190.00	1.84
H	住宿和餐饮业	279,910.40	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,819,355.36	7.45
J	金融业	15,458,896.76	8.98
K	房地产业	2,135,511.70	1.24
L	租赁和商务服务业	1,519,848.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	1,567,081.00	0.91
N	水利、环境和公共设施管理业	908,619.00	0.53
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	471,240.00	0.27
Q	卫生和社会工作	1,291,490.80	0.75
R	文化、体育和娱乐业	2,388,957.88	1.39
S	综合	1,001,852.20	0.58
	合计	170,300,902.08	98.96

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

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	300502	新易盛	18,700	922,284.00	0.54
2	002422	科伦药业	31,600	917,980.00	0.53
3	002028	思源电气	16,420	854,496.80	0.50
4	300418	昆仑万维	22,700	848,980.00	0.49
5	600157	永泰能源	594,300	814,191.00	0.47
6	000988	华工科技	26,900	800,544.00	0.47
7	002463	沪电股份	35,600	787,472.00	0.46
8	601058	赛轮轮胎	66,700	783,725.00	0.46
9	601555	东吴证券	107,030	782,389.30	0.45
10	000975	银泰黄金	51,972	779,580.00	0.45
11	600079	人福医药	30,500	758,230.00	0.44
12	600418	江淮汽车	46,800	755,820.00	0.44
13	002340	格林美	137,200	749,112.00	0.44
14	601168	西部矿业	50,866	725,857.82	0.42
15	000933	神火股份	42,100	707,280.00	0.41
16	301236	软通动力	15,300	706,860.00	0.41
17	601233	桐昆股份	45,100	682,363.00	0.40
18	600161	天坛生物	22,000	680,680.00	0.40
19	300394	天孚通信	7,400	677,248.00	0.39
20	601077	渝农商行	165,400	674,832.00	0.39
21	601108	财通证券	86,800	673,568.00	0.39
22	000630	铜陵有色	203,400	667,152.00	0.39
23	002384	东山精密	36,500	663,570.00	0.39
24	300037	新宙邦	14,000	662,200.00	0.38
25	002156	通富微电	28,300	654,296.00	0.38
26	000009	中国宝安	55,180	647,813.20	0.38
27	688122	西部超导	12,140	646,212.20	0.38
28	002517	恺英网络	57,500	642,275.00	0.37
29	300012	华测检测	44,900	637,580.00	0.37
30	002966	苏州银行	97,960	632,821.60	0.37
31	600109	国金证券	69,600	631,968.00	0.37
32	600988	赤峰黄金	44,400	622,044.00	0.36
33	600885	宏发股份	22,276	615,708.64	0.36
34	300136	信维通信	25,900	611,240.00	0.36
35	002465	海格通信	46,500	597,525.00	0.35
36	000423	东阿阿胶	12,100	596,772.00	0.35
37	002625	光启技术	40,300	595,634.00	0.35

38	600160	巨化股份	36,120	595,618.80	0.35
39	300207	欣旺达	39,800	587,448.00	0.34
40	600352	浙江龙盛	69,600	584,640.00	0.34
41	600536	中国软件	16,081	583,097.06	0.34
42	002185	华天科技	68,400	582,768.00	0.34
43	002138	顺络电子	21,500	580,715.00	0.34
44	002738	中矿资源	15,480	577,558.80	0.34
45	688169	石头科技	2,040	577,218.00	0.34
46	601162	天风证券	185,400	572,886.00	0.33
47	000932	华菱钢铁	110,680	570,002.00	0.33
48	600298	安琪酵母	16,200	569,916.00	0.33
49	300003	乐普医疗	35,200	568,832.00	0.33
50	688099	晶晨股份	9,000	563,670.00	0.33
51	688072	拓荆科技	2,428	561,596.40	0.33
52	603596	伯特利	8,100	561,330.00	0.33
53	000783	长江证券	103,600	557,368.00	0.32
54	002223	鱼跃医疗	16,050	555,009.00	0.32
55	300144	宋城演艺	55,900	551,733.00	0.32
56	300724	捷佳伟创	7,400	547,674.00	0.32
57	002439	启明星辰	20,200	545,400.00	0.32
58	002078	太阳纸业	44,800	545,216.00	0.32
59	603939	益丰药房	13,520	541,340.80	0.31
60	000723	美锦能源	81,100	540,126.00	0.31
61	600415	小商品城	73,200	535,824.00	0.31
62	600096	云天化	34,300	535,080.00	0.31
63	300568	星源材质	34,200	527,364.00	0.31
64	600873	梅花生物	55,200	527,160.00	0.31
65	002385	大北农	88,400	526,864.00	0.31
66	600482	中国动力	29,200	525,892.00	0.31
67	600765	中航重机	27,480	525,142.80	0.31
68	002532	天山铝业	87,100	523,471.00	0.30
69	600839	四川长虹	98,800	522,652.00	0.30
70	002797	第一创业	89,900	522,319.00	0.30
71	000066	中国长城	51,600	522,192.00	0.30
72	002756	永兴材料	10,000	522,100.00	0.30
73	300474	景嘉微	7,300	516,183.00	0.30
74	688180	君实生物	12,300	514,509.00	0.30
75	300017	网宿科技	65,000	510,250.00	0.30
76	300395	菲利华	13,900	508,184.00	0.30
77	002600	领益智造	75,000	507,000.00	0.29
78	603160	汇顶科技	7,300	504,430.00	0.29
79	600155	华创云信	60,400	503,736.00	0.29
80	002044	美年健康	83,800	503,638.00	0.29

81	002273	水晶光电	37,129	502,726.66	0.29
82	300285	国瓷材料	21,500	497,080.00	0.29
83	600862	中航高科	22,300	493,945.00	0.29
84	300601	康泰生物	18,000	488,700.00	0.28
85	600129	太极集团	10,500	487,830.00	0.28
86	600177	雅戈尔	74,300	486,665.00	0.28
87	002294	信立泰	14,900	486,634.00	0.28
88	688120	华海清科	2,587	485,579.90	0.28
89	600497	驰宏锌锗	95,200	480,760.00	0.28
90	300866	安克创新	5,400	478,440.00	0.28
91	300058	蓝色光标	66,600	478,188.00	0.28
92	000728	国元证券	69,900	477,417.00	0.28
93	002739	万达电影	36,500	475,230.00	0.28
94	600699	均胜电子	26,460	475,221.60	0.28
95	603606	东方电缆	11,100	474,525.00	0.28
96	002472	双环传动	18,200	473,564.00	0.28
97	688114	华大智造	5,500	473,110.00	0.27
98	002607	中公教育	115,500	471,240.00	0.27
99	600348	华阳股份	48,250	470,920.00	0.27
100	601990	南京证券	59,000	470,820.00	0.27
101	000831	中国稀土	17,000	470,390.00	0.27
102	600066	宇通客车	35,500	470,375.00	0.27
103	002195	岩山科技	153,185	470,277.95	0.27
104	603882	金域医学	7,500	469,275.00	0.27
105	601128	常熟银行	73,300	468,387.00	0.27
106	002008	大族激光	22,500	466,200.00	0.27
107	300146	汤臣倍健	27,300	464,919.00	0.27
108	600546	山煤国际	26,500	464,015.00	0.27
109	603816	顾家家居	13,200	462,000.00	0.27
110	002353	杰瑞股份	16,400	461,004.00	0.27
111	601696	中银证券	44,500	457,905.00	0.27
112	002673	西部证券	71,700	456,729.00	0.27
113	000893	亚钾国际	17,400	456,576.00	0.27
114	600529	山东药玻	17,800	455,680.00	0.26
115	688301	奕瑞科技	1,400	455,364.00	0.26
116	300604	长川科技	11,700	444,483.00	0.26
117	600985	淮北矿业	26,500	440,695.00	0.26
118	600499	科达制造	41,700	439,935.00	0.26
119	601577	长沙银行	64,500	439,890.00	0.26
120	600060	海信视像	21,000	438,900.00	0.26
121	300088	长信科技	65,500	438,195.00	0.25
122	002262	恩华药业	16,100	436,632.00	0.25
123	603589	口子窖	9,600	434,880.00	0.25

124	600369	西南证券	106,300	434,767.00	0.25
125	002444	巨星科技	19,300	434,636.00	0.25
126	000997	新大陆	22,019	431,792.59	0.25
127	300118	东方日升	24,400	430,660.00	0.25
128	601666	平煤股份	37,100	428,876.00	0.25
129	002624	完美世界	36,200	428,608.00	0.25
130	688728	格科微	20,900	427,823.00	0.25
131	601198	东兴证券	51,800	426,314.00	0.25
132	603688	石英股份	4,900	425,712.00	0.25
133	688390	固德威	3,256	425,168.48	0.25
134	688002	睿创微纳	9,600	424,512.00	0.25
135	002409	雅克科技	7,600	423,548.00	0.25
136	000400	许继电气	19,100	419,436.00	0.24
137	600642	申能股份	65,300	419,226.00	0.24
138	300073	当升科技	10,900	416,380.00	0.24
139	600486	扬农化工	6,556	413,814.72	0.24
140	300699	光威复材	15,480	412,851.60	0.24
141	600637	东方明珠	54,800	412,096.00	0.24
142	002131	利欧股份	180,709	412,016.52	0.24
143	600884	杉杉股份	30,200	411,324.00	0.24
144	603000	人民网	14,700	411,306.00	0.24
145	002558	巨人网络	36,900	411,066.00	0.24
146	000683	远兴能源	69,900	410,313.00	0.24
147	600399	抚顺特钢	42,200	410,184.00	0.24
148	600879	航天电子	53,000	408,630.00	0.24
149	688220	翱捷科技	5,800	408,552.00	0.24
150	600535	天士力	24,000	408,480.00	0.24
151	000878	云南铜业	37,500	408,375.00	0.24
152	600118	中国卫星	15,800	407,956.00	0.24
153	000591	太阳能	73,100	407,898.00	0.24
154	000629	钒钛股份	124,200	407,376.00	0.24
155	002152	广电运通	33,200	407,032.00	0.24
156	000021	深科技	25,000	405,250.00	0.24
157	688521	芯原股份	8,100	404,676.00	0.24
158	600867	通化东宝	37,200	402,876.00	0.23
159	601997	贵阳银行	78,200	401,948.00	0.23
160	002497	雅化集团	30,700	401,863.00	0.23
161	600895	张江高科	20,700	399,510.00	0.23
162	600143	金发科技	50,000	399,500.00	0.23
163	688772	珠海冠宇	18,100	398,381.00	0.23
164	300001	特锐德	19,800	397,980.00	0.23
165	000998	隆平高科	28,200	397,620.00	0.23
166	300390	天华新能	15,640	396,474.00	0.23

167	600416	湘电股份	24,900	395,412.00	0.23
168	600516	方大炭素	75,400	395,096.00	0.23
169	000703	恒逸石化	58,700	394,464.00	0.23
170	605358	立昂微	14,400	394,416.00	0.23
171	300024	机器人	33,200	394,084.00	0.23
172	002240	盛新锂能	17,200	391,300.00	0.23
173	603712	七一二	12,400	390,724.00	0.23
174	603077	和邦生物	165,460	390,485.60	0.23
175	600549	厦门钨业	22,700	389,986.00	0.23
176	002407	多氟多	25,540	388,718.80	0.23
177	600170	上海建工	166,000	388,440.00	0.23
178	002432	九安医疗	10,300	388,001.00	0.23
179	600153	建发股份	40,200	387,126.00	0.22
180	002430	杭氧股份	13,200	385,572.00	0.22
181	600392	盛和资源	37,395	380,681.10	0.22
182	000960	锡业股份	26,500	379,480.00	0.22
183	600141	兴发集团	20,780	379,235.00	0.22
184	601966	玲珑轮胎	19,700	378,831.00	0.22
185	000623	吉林敖东	24,900	376,986.00	0.22
186	000039	中集集团	49,133	375,867.45	0.22
187	688188	柏楚电子	1,480	374,602.80	0.22
188	300383	光环新网	38,500	374,220.00	0.22
189	300748	金力永磁	18,340	370,834.80	0.22
190	002065	东华软件	60,000	370,200.00	0.22
191	600704	物产中大	83,200	368,576.00	0.21
192	600909	华安证券	75,490	368,391.20	0.21
193	688052	纳芯微	2,200	367,070.00	0.21
194	300212	易华录	11,640	366,078.00	0.21
195	600998	九州通	52,187	365,830.87	0.21
196	601717	郑煤机	28,700	363,055.00	0.21
197	000750	国海证券	102,320	362,212.80	0.21
198	603658	安图生物	6,300	359,163.00	0.21
199	002203	海亮股份	32,000	356,800.00	0.21
200	002064	华峰化学	53,000	355,630.00	0.21
201	300487	蓝晓科技	6,700	355,502.00	0.21
202	002268	电科网安	15,800	354,868.00	0.21
203	600673	东阳光	48,300	354,039.00	0.21
204	600583	海油工程	59,200	351,648.00	0.20
205	600166	福田汽车	128,500	350,805.00	0.20
206	002025	航天电器	7,300	350,546.00	0.20
207	000050	深天马 A	32,900	350,385.00	0.20
208	000738	航发控制	17,600	350,240.00	0.20
209	603456	九洲药业	14,400	348,624.00	0.20

210	603338	浙江鼎力	6,800	347,956.00	0.20
211	600521	华海药业	23,700	347,679.00	0.20
212	601456	国联证券	32,000	346,880.00	0.20
213	300114	中航电测	7,900	345,625.00	0.20
214	002939	长城证券	43,200	345,600.00	0.20
215	300558	贝达药业	6,700	345,385.00	0.20
216	000513	丽珠集团	9,853	344,953.53	0.20
217	002568	百润股份	14,000	344,540.00	0.20
218	002368	太极股份	11,658	344,260.74	0.20
219	002506	协鑫集成	125,400	343,596.00	0.20
220	600398	海澜之家	46,200	342,804.00	0.20
221	600563	法拉电子	3,700	342,620.00	0.20
222	002299	圣农发展	19,900	341,882.00	0.20
223	002128	电投能源	23,940	341,623.80	0.20
224	600863	内蒙华电	87,100	339,690.00	0.20
225	000636	风华高科	24,800	338,768.00	0.20
226	002092	中泰化学	55,502	338,562.20	0.20
227	600859	王府井	21,175	338,164.75	0.20
228	600820	隧道股份	58,700	338,112.00	0.20
229	601216	君正集团	90,200	337,348.00	0.20
230	002429	兆驰股份	60,400	337,032.00	0.20
231	600739	辽宁成大	28,600	336,908.00	0.20
232	002414	高德红外	45,600	332,880.00	0.19
233	002373	千方科技	29,500	330,695.00	0.19
234	300253	卫宁健康	45,900	330,021.00	0.19
235	600435	北方导航	28,100	329,894.00	0.19
236	002926	华西证券	42,100	326,696.00	0.19
237	000729	燕京啤酒	37,700	325,351.00	0.19
238	300595	欧普康视	14,400	325,152.00	0.19
239	300296	利亚德	54,100	324,600.00	0.19
240	600655	豫园股份	52,000	322,920.00	0.19
241	300009	安科生物	31,432	321,235.04	0.19
242	300251	光线传媒	39,300	320,295.00	0.19
243	688567	孚能科技	19,600	319,676.00	0.19
244	300244	迪安诊断	13,380	318,577.80	0.19
245	002595	豪迈科技	10,700	318,539.00	0.19
246	600325	华发股份	44,170	318,465.70	0.19
247	600021	上海电力	37,600	318,096.00	0.18
248	688234	天岳先进	4,798	317,003.86	0.18
249	300676	华大基因	6,600	316,800.00	0.18
250	600008	首创环保	117,720	316,666.80	0.18
251	600498	烽火通信	19,000	316,160.00	0.18
252	300373	扬杰科技	8,600	315,620.00	0.18

253	600271	航天信息	29,600	314,944.00	0.18
254	688005	容百科技	7,900	314,420.00	0.18
255	000519	中兵红箭	22,362	313,962.48	0.18
256	002500	山西证券	57,690	310,949.10	0.18
257	601016	节能风电	103,640	310,920.00	0.18
258	600380	健康元	24,896	309,457.28	0.18
259	002507	涪陵榨菜	21,630	309,092.70	0.18
260	600004	白云机场	31,600	309,048.00	0.18
261	002372	伟星新材	21,300	308,211.00	0.18
262	600566	济川药业	9,800	308,014.00	0.18
263	000830	鲁西化工	30,700	307,921.00	0.18
264	600282	南钢股份	82,600	305,620.00	0.18
265	603233	大参林	12,256	305,174.40	0.18
266	002281	光迅科技	10,700	304,950.00	0.18
267	002936	郑州银行	151,364	304,241.64	0.18
268	002850	科达利	3,600	304,056.00	0.18
269	002192	融捷股份	5,600	303,576.00	0.18
270	600038	中直股份	7,869	303,192.57	0.18
271	000060	中金岭南	69,900	301,968.00	0.18
272	688331	荣昌生物	4,839	300,308.34	0.17
273	688032	禾迈股份	1,100	297,000.00	0.17
274	688063	派能科技	2,800	296,800.00	0.17
275	002056	横店东磁	21,800	295,172.00	0.17
276	601636	旗滨集团	43,100	294,804.00	0.17
277	601880	辽港股份	201,840	292,668.00	0.17
278	002019	亿帆医药	19,700	291,166.00	0.17
279	002120	韵达股份	38,900	290,194.00	0.17
280	300070	碧水源	58,100	289,919.00	0.17
281	002670	国盛金控	31,036	289,255.52	0.17
282	300529	健帆生物	13,000	288,990.00	0.17
283	603225	新凤鸣	20,340	288,828.00	0.17
284	300682	朗新集团	17,600	288,464.00	0.17
285	300677	英科医疗	12,320	287,795.20	0.17
286	600580	卧龙电驱	24,500	287,385.00	0.17
287	603156	养元饮品	13,500	287,010.00	0.17
288	002865	钧达股份	3,700	286,676.00	0.17
289	600511	国药股份	10,000	286,200.00	0.17
290	000547	航天发展	34,100	285,417.00	0.17
291	603893	瑞芯微	4,500	285,300.00	0.17
292	002080	中材科技	17,900	284,968.00	0.17
293	603927	中科软	9,500	284,810.00	0.17
294	603885	吉祥航空	23,700	284,400.00	0.17
295	002557	洽洽食品	8,100	282,042.00	0.16

296	688385	复旦微电	7,300	281,999.00	0.16
297	600390	五矿资本	60,200	281,736.00	0.16
298	600258	首旅酒店	17,920	279,910.40	0.16
299	002531	天顺风能	23,900	277,240.00	0.16
300	002508	老板电器	12,700	276,606.00	0.16
301	601000	唐山港	78,946	276,311.00	0.16
302	688516	奥特维	3,045	275,572.50	0.16
303	688536	思瑞浦	1,873	274,019.90	0.16
304	601933	永辉超市	96,900	273,258.00	0.16
305	002958	青农商行	104,200	273,004.00	0.16
306	002831	裕同科技	9,920	272,899.20	0.16
307	002572	索菲亚	17,100	272,745.00	0.16
308	300026	红日药业	64,300	272,632.00	0.16
309	000598	兴蓉环境	47,800	271,982.00	0.16
310	002487	大金重工	10,200	271,524.00	0.16
311	603517	绝味食品	10,100	271,286.00	0.16
312	601179	中国西电	54,900	270,657.00	0.16
313	688200	华峰测控	2,200	270,160.00	0.16
314	688538	和辉光电	111,000	269,730.00	0.16
315	603444	吉比特	1,100	269,632.00	0.16
316	000970	中科三环	26,025	269,358.75	0.16
317	601231	环旭电子	17,800	268,958.00	0.16
318	603737	三棵树	5,640	268,520.40	0.16
319	601778	晶科科技	76,400	267,400.00	0.16
320	300438	鹏辉能源	9,400	265,926.00	0.15
321	600970	中材国际	28,300	264,322.00	0.15
322	000155	川能动力	19,700	261,813.00	0.15
323	000887	中鼎股份	21,100	261,007.00	0.15
324	600906	财达证券	34,700	260,250.00	0.15
325	600707	彩虹股份	38,300	258,525.00	0.15
326	600848	上海临港	25,700	258,285.00	0.15
327	603185	弘元绿能	7,700	256,256.00	0.15
328	600329	达仁堂	7,600	255,740.00	0.15
329	002030	达安基因	26,244	254,041.92	0.15
330	600481	双良节能	30,000	253,800.00	0.15
331	600995	南网储能	25,600	252,416.00	0.15
332	600959	江苏有线	80,300	252,142.00	0.15
333	603858	步长制药	14,800	251,748.00	0.15
334	002155	湖南黄金	22,504	250,694.56	0.15
335	000563	陕国投 A	82,200	249,888.00	0.15
336	601866	中远海发	105,700	247,338.00	0.14
337	600755	厦门国贸	35,400	246,738.00	0.14
338	000027	深圳能源	38,220	246,519.00	0.14

339	600208	新湖中宝	113,400	246,078.00	0.14
340	601958	金钼股份	26,000	245,700.00	0.14
341	600977	中国电影	19,987	244,640.88	0.14
342	000778	新兴铸管	63,800	243,716.00	0.14
343	300357	我武生物	8,400	243,600.00	0.14
344	600316	洪都航空	11,500	243,455.00	0.14
345	600131	国网信通	16,000	242,400.00	0.14
346	000987	越秀资本	40,230	242,184.60	0.14
347	002244	滨江集团	33,300	242,091.00	0.14
348	000739	普洛药业	15,700	241,623.00	0.14
349	600582	天地科技	44,400	241,536.00	0.14
350	002683	广东宏大	12,000	240,960.00	0.14
351	601991	大唐发电	99,400	240,548.00	0.14
352	601665	齐鲁银行	61,400	240,074.00	0.14
353	600373	中文传媒	18,100	238,558.00	0.14
354	002266	浙富控股	70,080	238,272.00	0.14
355	300888	稳健医疗	6,380	237,655.00	0.14
356	603127	昭衍新药	10,000	237,100.00	0.14
357	000709	河钢股份	110,800	236,004.00	0.14
358	600737	中粮糖业	28,600	235,664.00	0.14
359	688029	南微医学	2,393	231,642.40	0.13
360	603883	老百姓	7,740	231,348.60	0.13
361	688082	盛美上海	2,200	229,702.00	0.13
362	002032	苏泊尔	4,300	227,943.00	0.13
363	000825	太钢不锈	61,100	227,903.00	0.13
364	600598	北大荒	19,000	227,430.00	0.13
365	002326	永太科技	19,500	226,590.00	0.13
366	603826	坤彩科技	3,800	224,314.00	0.13
367	601611	中国核建	32,300	223,839.00	0.13
368	600801	华新水泥	17,972	223,391.96	0.13
369	600056	中国医药	19,960	222,953.20	0.13
370	600378	昊华科技	7,300	222,504.00	0.13
371	603379	三美股份	6,540	222,360.00	0.13
372	300776	帝尔激光	3,680	221,756.80	0.13
373	601598	中国外运	42,300	221,652.00	0.13
374	000785	居然之家	67,100	221,430.00	0.13
375	603267	鸿远电子	4,400	220,880.00	0.13
376	000883	湖北能源	52,200	220,806.00	0.13
377	600528	中铁工业	29,647	220,573.68	0.13
378	600517	国网英大	46,100	219,897.00	0.13
379	600901	江苏金租	45,300	219,252.00	0.13
380	603568	伟明环保	13,683	218,928.00	0.13
381	300363	博腾股份	8,700	218,805.00	0.13

382	002511	中顺洁柔	21,400	214,000.00	0.12
383	002153	石基信息	21,920	213,500.80	0.12
384	603650	彤程新材	6,400	213,120.00	0.12
385	003035	南网能源	40,400	212,504.00	0.12
386	601992	金隅集团	111,100	212,201.00	0.12
387	600500	中化国际	47,920	211,806.40	0.12
388	601106	中国一重	73,300	211,104.00	0.12
389	600062	华润双鹤	11,132	207,055.20	0.12
390	002653	海思科	8,900	206,035.00	0.12
391	600827	百联股份	21,500	204,035.00	0.12
392	603228	景旺电子	8,968	202,318.08	0.12
393	000937	冀中能源	28,300	202,062.00	0.12
394	603026	胜华新材	4,400	201,784.00	0.12
395	002408	齐翔腾达	37,993	200,603.04	0.12
396	000581	威孚高科	13,300	200,431.00	0.12
397	688520	神州细胞	3,700	199,319.00	0.12
398	600871	石化油服	108,400	198,372.00	0.12
399	001227	兰州银行	76,200	198,120.00	0.12
400	003022	联泓新科	10,800	197,748.00	0.11
401	600022	山东钢铁	142,800	195,636.00	0.11
402	603305	旭升集团	9,900	195,327.00	0.11
403	601098	中南传媒	19,200	195,264.00	0.11
404	603707	健友股份	12,926	193,890.00	0.11
405	601118	海南橡胶	45,700	193,768.00	0.11
406	600126	杭钢股份	36,230	193,105.90	0.11
407	600315	上海家化	9,000	190,620.00	0.11
408	600764	中国海防	7,600	189,620.00	0.11
409	601156	东航物流	12,800	189,184.00	0.11
410	688779	长远锂科	25,800	188,340.00	0.11
411	600967	内蒙一机	22,797	188,303.22	0.11
412	688276	百克生物	3,427	187,833.87	0.11
413	688349	三一重能	6,500	186,030.00	0.11
414	002690	美亚光电	9,440	185,401.60	0.11
415	000559	万向钱潮	35,400	183,726.00	0.11
416	000156	华数传媒	24,900	183,513.00	0.11
417	688778	厦钨新能	4,590	181,947.60	0.11
418	000401	冀东水泥	28,400	181,476.00	0.11
419	601928	凤凰传媒	20,400	179,724.00	0.10
420	002867	周大生	11,800	179,124.00	0.10
421	601608	中信重工	46,400	179,104.00	0.10
422	601187	厦门银行	35,300	178,971.00	0.10
423	000089	深圳机场	27,500	176,825.00	0.10
424	600808	马钢股份	64,136	174,449.92	0.10

425	600663	陆家嘴	19,900	174,125.00	0.10
426	002518	科士达	6,300	173,880.00	0.10
427	688208	道通科技	7,305	173,493.75	0.10
428	300861	美畅股份	5,200	173,108.00	0.10
429	603529	爱玛科技	6,900	172,776.00	0.10
430	600095	湘财股份	23,000	172,730.00	0.10
431	002010	传化智联	37,100	171,402.00	0.10
432	001286	陕西能源	20,000	171,000.00	0.10
433	688425	铁建重工	43,000	170,710.00	0.10
434	603218	日月股份	13,800	170,706.00	0.10
435	000958	电投产融	43,300	170,602.00	0.10
436	300257	开山股份	10,700	168,632.00	0.10
437	688107	安路科技	4,500	165,510.00	0.10
438	000930	中粮科技	24,900	165,336.00	0.10
439	002423	中粮资本	24,600	164,328.00	0.10
440	002505	鹏都农牧	102,170	163,472.00	0.09
441	603866	桃李面包	21,256	162,820.96	0.09
442	002925	盈趣科技	8,320	161,990.40	0.09
443	000967	盈峰环境	34,000	161,500.00	0.09
444	600597	光明乳业	18,402	160,649.46	0.09
445	002468	申通快递	20,500	159,695.00	0.09
446	000898	鞍钢股份	63,800	158,862.00	0.09
447	003031	中瓷电子	1,800	158,814.00	0.09
448	603786	科博达	2,200	156,992.00	0.09
449	600968	海油发展	54,400	155,040.00	0.09
450	688006	杭可科技	6,579	154,474.92	0.09
451	688690	纳微科技	5,600	153,552.00	0.09
452	300850	新强联	4,800	152,784.00	0.09
453	601568	北元集团	31,870	151,063.80	0.09
454	688281	华秦科技	1,100	149,226.00	0.09
455	002761	浙江建投	14,500	148,770.00	0.09
456	688297	中无人机	3,800	145,654.00	0.08
457	000959	首钢股份	41,500	143,590.00	0.08
458	000537	中绿电	14,800	142,524.00	0.08
459	002791	坚朗五金	3,500	141,715.00	0.08
460	600167	联美控股	24,380	138,234.60	0.08
461	600377	宁沪高速	13,300	136,325.00	0.08
462	600339	中油工程	44,800	135,744.00	0.08
463	001914	招商积余	11,300	135,148.00	0.08
464	688348	昱能科技	1,100	134,618.00	0.08
465	002608	江苏国信	20,100	132,057.00	0.08
466	688387	信科移动	18,200	131,222.00	0.08
467	601228	广州港	40,400	126,452.00	0.07

468	600350	山东高速	18,200	126,308.00	0.07
469	002563	森马服饰	21,700	125,209.00	0.07
470	001203	大中矿业	12,100	123,057.00	0.07
471	600927	永安期货	7,700	120,967.00	0.07
472	301029	怡合达	4,640	119,619.20	0.07
473	603056	德邦股份	8,200	118,654.00	0.07
474	600928	西安银行	35,400	117,882.00	0.07
475	002399	海普瑞	10,000	117,300.00	0.07
476	000402	金融街	32,100	116,523.00	0.07
477	601298	青岛港	18,800	116,184.00	0.07
478	000539	粤电力 A	23,700	115,893.00	0.07
479	603317	天味食品	8,509	113,084.61	0.07
480	601828	美凯龙	29,200	113,004.00	0.07
481	600925	苏能股份	20,200	111,302.00	0.06
482	688819	天能股份	3,900	108,888.00	0.06
483	002945	华林证券	7,200	108,720.00	0.06
484	601139	深圳燃气	15,400	106,106.00	0.06
485	688105	诺唯赞	3,300	105,666.00	0.06
486	688153	唯捷创芯	1,600	104,800.00	0.06
487	688295	中复神鹰	3,419	103,629.89	0.06
488	000031	大悦城	34,600	102,762.00	0.06
489	601061	中信金属	13,000	100,230.00	0.06
490	001872	招商港口	6,200	98,952.00	0.06
491	601158	重庆水务	15,300	86,751.00	0.05
492	600299	安迪苏	10,800	86,400.00	0.05
493	000553	安道麦 A	11,600	80,504.00	0.05
494	600956	新天绿能	9,400	76,422.00	0.04
495	688375	国博电子	900	71,577.00	0.04
496	603355	莱克电气	3,160	70,468.00	0.04
497	603868	飞科电器	1,300	65,650.00	0.04
498	688248	南网科技	2,300	57,431.00	0.03
499	600032	浙江新能	5,900	47,554.00	0.03
500	400174	中天 3	138,400	0.00	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	300502	新易盛	1,036,973.00	0.57
2	600372	中航机载	848,893.00	0.47
3	002463	沪电股份	817,851.00	0.45
4	000066	中国长城	760,041.00	0.42
5	300394	天孚通信	737,880.00	0.41

6	002517	恺英网络	704,665.00	0.39
7	688072	拓荆科技	673,734.00	0.37
8	000423	东阿阿胶	663,911.00	0.37
9	301236	软通动力	642,653.57	0.35
10	000933	神火股份	621,384.00	0.34
11	002240	盛新锂能	619,957.00	0.34
12	300395	菲利华	613,072.00	0.34
13	688122	西部超导	611,066.14	0.34
14	300207	欣旺达	593,011.00	0.33
15	002008	大族激光	581,248.00	0.32
16	000723	美锦能源	575,512.00	0.32
17	688120	华海清科	574,335.87	0.32
18	300601	康泰生物	572,123.00	0.32
19	603882	金域医学	564,140.00	0.31
20	300118	东方日升	538,927.99	0.30

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	300308	中际旭创	2,106,832.45	1.16
2	688256	寒武纪	1,024,957.75	0.57
3	600372	中航机载	1,003,276.80	0.55
4	600489	中金黄金	877,905.00	0.48
5	002013	中航机电	835,450.00	0.46
6	688122	西部超导	763,966.44	0.42
7	603345	安井食品	762,797.00	0.42
8	601607	上海医药	747,881.00	0.41
9	000999	华润三九	716,457.00	0.40
10	000807	云铝股份	714,725.00	0.39
11	300832	新产业	692,569.00	0.38
12	600487	亨通光电	686,187.00	0.38
13	688777	中控技术	664,967.16	0.37
14	002603	以岭药业	644,864.00	0.36
15	603605	珀莱雅	622,069.00	0.34
16	603606	东方电缆	601,818.00	0.33
17	601699	潞安环能	576,555.00	0.32
18	300168	万达信息	565,839.08	0.31
19	601872	招商轮船	561,629.00	0.31
20	603613	国联股份	556,433.00	0.31

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

易费用。

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	50,230,357.19
卖出股票收入（成交）总额	47,778,094.73

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）	13,200.41	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,200.41	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	127102	浙建转债	132	13,200.41	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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京证券交易所的处罚；东吴证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚；思源电气股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海事局的处罚；浙江省建设投资集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅的处罚；浙江省建设投资集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到生态环境部的处罚；浙江省建设投资集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到综合行政执法局的处罚。

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	2,762.69
2	应收清算款	1,358,958.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,361,720.69

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 (%)
345	406,720.83	138,686,167.00	98.84	1,632,520.00	1.16

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	1,239,481.00	0.88
2	上海盈象资产管理有限公司—上海盈象方中 鑫享私募证券投资基金	1,000,000.00	0.71
3	姜晓平	235,683.00	0.17
4	张红艳	197,700.00	0.14
5	陈妙琴	139,373.00	0.10
6	乐华	95,000.00	0.07
7	李淑清	69,455.00	0.05
8	钮冰融	46,303.00	0.03
9	刘秀珍	46,303.00	0.03
10	黄子祺	46,200.00	0.03
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	136,446,586.00	97.24

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

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

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

§ 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	138,318,687.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	140,318,687.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末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

本报告期内，基金管理人于 2023 年 1 月 4 日发布公告，鄂华先生自 2023 年 1 月 3 日起任公司总经理、董事，左季庆先生于 2023 年 1 月 3 日离任公司总经理、董事；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，韩占锋先生自 2023 年 1 月 5 日起任公司督察长，申梦玉先生于 2023 年 1 月 5 日离任公司督察长；基金管理人于 2023 年 1 月 6 日发布公告，董瑞倩女士于 2023 年 1 月 5 日离任公司固定收益投资总监。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

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 (%)	
兴业证券	2	44,382,740.54	46.19	32,457.13	39.98	-
中信证券	2	28,456,008.57	29.61	26,866.77	33.09	-
海通证券	2	22,733,041.22	23.66	21,485.31	26.46	-
招商证券	2	522,907.48	0.54	382.24	0.47	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；
- (4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

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

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

(7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

(1) 公司根据上述标准确定选用交易单元的证券经营机构；

(2) 公司和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

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 (%)
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	161,863.81	76.11	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	50,802.85	23.89	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	国寿安保基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2023年12月20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	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
-----	----------------	------------

类别	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	20230101~20231231	136,246,286.00	2,000,000.00	1,799,700.00	136,446,586.00	97.24
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

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

2024 年 3 月 30 日