

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
2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 08 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 02 月 25 日（基金合同生效日）起至 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	44

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细.....	45
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	45
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	45
7.13 投资组合报告附注	45
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
8.3 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.....	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	47
10.4 基金投资策略的改变	47
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	49
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	50
§ 12 备查文件目录	50
12.1 备查文件目录	50
12.2 存放地点	50
12.3 查阅方式	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	国寿安保沪港深 300ETF 联接	
基金主代码	012663	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 2 月 25 日	
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	140,296,204.63 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C
下属分级基金的交易代码	012663	012664
报告期末下属分级基金的 份额总额	140,208,971.98 份	87,232.65 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	517300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 2 月 24 日
基金管理人名称	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人名称	招商银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对目标 ETF 基金份额的投资,追求跟踪标的指数,获得与指数收益相似的回报。
投资策略	本基金主要投资于目标 ETF,方便特定的客户群通过本基金投资目标 ETF。本基金不参与目标 ETF 的投资管理。
业绩比较基准	中证沪港深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	<p>本基金为 ETF 联接基金,通过投资于目标 ETF 跟踪中证沪港深 300 指数,其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p> <p>本基金属于 ETF 联接基金,目标 ETF 为股票型基金,其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金,属于高预期风险、高预期收益的开放式基金。</p> <p>本基金投资标的包括港股通投资标的的股票,还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p>

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
------	----------------------------

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉	张燕
	联系电话	010-50850744	0755-83199084
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	yan_zhang@cmbchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95555
传真		010-50850776	0755-83195201
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码		100033	518040
法定代表人		王军辉	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年 02 月 25 日（基金合同生效日）-2022 年 06 月 30 日	
	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C
本期已实现收益	195,956.48	36.45
本期利润	10,258,681.56	-2,389.30
加权平均基金份额本期利润	0.0573	-0.0014
本期加权平均净值利润率	5.76%	-0.14%
本期基金份额净值增长率	7.56%	7.91%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	182,725.49	397.84
期末可供分配基金份额利润	0.0013	0.0046
期末基金资产净值	150,803,828.94	94,129.12
期末基金份额净值	1.0756	1.0791
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	7.56%	7.91%

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

国寿安保沪港深 300ETF 联接 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	8.04%	1.03%	7.49%	1.06%	0.55%	-0.03%
过去三个月	7.54%	1.06%	5.88%	1.31%	1.66%	-0.25%
自基金合同生效起至今	7.56%	0.89%	-0.75%	1.55%	8.31%	-0.66%

国寿安保沪港深 300ETF 联接 C

阶段	份额净值	份额净值增长	业绩比较基	业绩比较基准收	①—③	②—④
----	------	--------	-------	---------	-----	-----

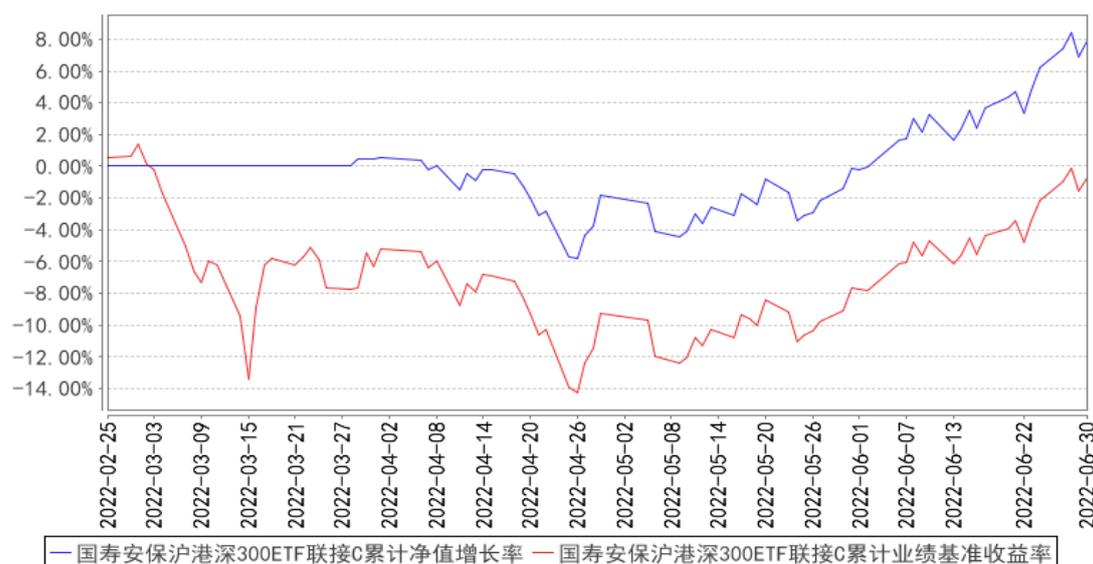
	增长率①	率标准差②	准收益率③	益率标准差④		
过去一个月	8.02%	1.03%	7.49%	1.06%	0.53%	-0.03%
过去三个月	7.45%	1.06%	5.88%	1.31%	1.57%	-0.25%
自基金合同生效起至今	7.91%	0.89%	-0.75%	1.55%	8.66%	-0.66%

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

国寿安保沪港深300ETF联接A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



国寿安保沪港深300ETF联接C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 2022 年 02 月 25 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。图示日期为 2022 年 02 月 25 日至 2022 年 06 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可（2013）1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，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 2022 年 6 月 30 日，公司共管理 93 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 3219.57 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2387.69 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	本基金的基金经理	2022 年 2 月 25 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、国寿安邦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基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内，本基金未发生违法违规且对基金财产造成损失的异常交易行为；且不存在所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情形。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年国内股票市场市场先抑后扬，阶段性结构分化和轮动明显，稳增长和科技是较为清晰的投资主线。一季度受欧洲地缘冲突和疫情反复影响整体表现较弱，至四月下旬 A 股触及低点，随着疫情有效控制和稳增长政策推进，投资者情绪和风险偏好修复，市场有所反弹。

本基金为目标 ETF 的联接基金，主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪。报告期内本基金处于建仓期，跟踪误差主要源自成立初期仓位不足、日常申赎以及目标 ETF 相对指数的偏离。成分股停复牌、公司行为和市场波动等因素，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

截至本报告期末国寿安保沪港深 300ETF 联接 A 基金份额净值为 1.0756 元,本报告期基金份额净值增长率为 7.56%;截至本报告期末国寿安保沪港深 300ETF 联接 C 基金份额净值为 1.0791 元,本报告期基金份额净值增长率为 7.91%;业绩比较基准收益率为-0.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年,国民经济韧性十足,长期向好的趋势没有发生改变。政策面和宏观流动性将保持对权益资产友好,国内通胀呈现 CPI 整体可控, PPI 逐步回落的趋势。随着经济复苏进程逐步恢复,企业盈利逐步向好,居民收入恢复增长也将带来消费逐步改善,部分低估值细分板块存在配置机会,科技成长板块也有望持续景气向好。港股方面,互联网平台整改初见成效,随着监管常态化的推进,上市公司更加注重公平和效率的平衡,业绩也有望逐步回升,目前极低的估值是很好的配置时点。整体上看,沪港深 300 指数将具有较好的投资机会。

本基金将严格遵守基金合同,力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人设有基金估值委员会,估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任,委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人以及各相关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其适用性的情况时,运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务,以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议,向估值委员会提出估值意见或建议,但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司分别签署服务协议,其中中债金融估值中心有限公司按约定提供固定收益品种信用减值数据和在银行间同业市场交易的固定收益品种估值数据,中证指数有限公司提供在交易所市场交易的固定收益品种估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	24,434,176.84
结算备付金		155,200.38
存出保证金		83,088.35

交易性金融资产	6.4.7.2	140,376,327.60
其中：股票投资		4,000,427.60
基金投资		136,375,900.00
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		4,869.68
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		165,053,662.85
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		14,042,274.74
应付管理人报酬		6,192.86
应付托管费		1,238.53
应付销售服务费		18.62
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	105,980.04
负债合计		14,155,704.79
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	140,296,204.63
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	10,601,753.43
净资产合计		150,897,958.06

负债和净资产总计		165,053,662.85
----------	--	----------------

注：本基金合同生效日为 2022 年 02 月 25 日，本报告期自基金合同生效日 2022 年 02 月 25 日起至 2022 年 06 月 30 日止。报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额总额 140,296,204.63 份，其中国寿安保沪港深 300ETF 联接 A 基金份额总额 140,208,971.98 份，基金份额净值 1.0756 元。国寿安保沪港深 300ETF 联接 C 基金份额总额 87,232.65 份，基金份额净值 1.0791 元。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2022 年 2 月 25 日（基金合同 生效日）至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		10,525,266.74
1. 利息收入		275,663.48
其中：存款利息收入	6.4.7.13	130,690.73
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		144,972.75
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		189,293.31
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-53,028.36
基金投资收益	6.4.7.15	205,747.05
债券投资收益	6.4.7.16	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.17	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-
股利收益	6.4.7.20	36,574.62
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	10,060,299.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.22	10.62
减：二、营业总支出		268,974.48
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	169,047.45
2. 托管费	6.4.10.2.2	33,809.46
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	1,683.41
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-

其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.23	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.24	64,434.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		10,256,292.26
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		10,256,292.26
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		10,256,292.26

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	224,064,967.95	-	-	224,064,967.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-83,768,763.32	-	10,601,753.43	-73,167,009.89
（一）、综合收益总额	-	-	10,256,292.26	10,256,292.26
（二）、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）	-83,768,763.32	-	345,461.17	-83,423,302.15
其中：1. 基金申购款	13,306,890.21	-	1,036,151.97	14,343,042.18
2. 基金赎回款	-97,075,653.53	-	-690,690.80	-97,766,344.33
（三）、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）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	140,296,204.63	-	10,601,753.43	150,897,958.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

左季庆

王文英

韩占锋

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“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[2021]1838 号《关于准予国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金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《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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 224,050,922.01 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第 0190 号予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于 2022 年 02 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 224,064,967.95 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,045.94 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,基金托管人为招商银行股份有限公司(以下简称“招商银行”)。

本基金为国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标 ETF”)的联接基金。目标 ETF 是采用完全复制法实现对中证沪港深 300 指数紧密跟踪的被动指数基金,本基金主要通过投资于目标 ETF 实现对业绩比较基准的紧密跟踪,力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度不超过 0.3%,年跟踪误差不超过 4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为目标 ETF 基金份额、标的指数成份股及备选成份股。此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于部分非成份股(包含港股通标的股票、中小板、创业板及其他经中国证监会核准发行的股票)、国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、可转换债券、分离交易可转债的纯债部分、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、证券公司短期公司债券、资产支持证券、债券回购、银行存款、股指期货、国债期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规本)。基金的业绩比较基准为:中证沪港深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求, 真实、完整地反映了本基金于 2022 年 06 月 30 日的财务状况以及 2022 年 02 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 06 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本财务报表的实际编制期间为 2022 年 2 月 25 日(基金合同生效日)至 2022 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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或金融负债。

(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、资产支持证券投资和基金投资，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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以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衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则,但选择不重述比较信息。因此,比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。

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。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权。在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次收益分配比例不得低于收益分配基准日每份基金份额该次可供分配利润的 10%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

6.4.4.13 分部报告

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

经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2)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。

(3)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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
活期存款	24,434,176.84
等于：本金	24,432,750.97
加：应计利息	1,425.87
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	24,434,176.84

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,656,334.73	-	4,000,427.60	344,092.87
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	126,659,693.54	-	136,375,900.00	9,716,206.46
其他	-	-	-	-
合计	130,316,028.27	-	140,376,327.60	10,060,299.33

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	45,012.42
其中：交易所市场	45,012.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	60,967.62
合计	105,980.04

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

国寿安保沪港深 300ETF 联接 A

项目	本期 2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	218,031,141.62	218,031,141.62
本期申购	13,043,987.93	13,043,987.93
本期赎回（以“-”号填列）	-90,866,157.57	-90,866,157.57
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	140,208,971.98	140,208,971.98

国寿安保沪港深 300ETF 联接 C

项目	本期 2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	6,033,826.33	6,033,826.33
本期申购	262,902.28	262,902.28
本期赎回（以“-”号填列）	-6,209,495.96	-6,209,495.96
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	87,232.65	87,232.65

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

6.4.7.11 其他综合收益

本基金于本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

国寿安保沪港深 300ETF 联接 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	195,956.48	10,062,725.08	10,258,681.56
本期基金份额交易产生的变动数	-13,230.99	349,406.39	336,175.40
其中：基金申购款	16,033.44	1,019,324.65	1,035,358.09
基金赎回款	-29,264.43	-669,918.26	-699,182.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	182,725.49	10,412,131.47	10,594,856.96

国寿安保沪港深 300ETF 联接 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	36.45	-2,425.75	-2,389.30
本期基金份额交易产生的变动数	361.39	8,924.38	9,285.77
其中：基金申购款	1,152.08	-358.20	793.88
基金赎回款	-790.69	9,282.58	8,491.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	397.84	6,498.63	6,896.47

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
活期存款利息收入	90,513.86
定期存款利息收入	35,555.56
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,389.15
其他	232.16
合计	130,690.73

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-144,655.04
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	91,626.68
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-53,028.36

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出股票成交总额	24,389,555.45
减：卖出股票成本总额	24,455,631.26
减：交易费用	78,579.23
买卖股票差价收入	-144,655.04

6.4.7.14.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
申购基金份额总额	143,319,728.21
减：现金支付申购款总额	88,505,030.74
减：申购股票成本总额	54,723,070.79
减：交易费用	-
申购差价收入	91,626.68

6.4.7.15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
卖出/赎回基金成交总额	6,795,167.64
减：卖出/赎回基金成本总额	6,588,324.27
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	1,096.32
基金投资收益	205,747.05

6.4.7.16 债券投资收益

本基金于本报告期无债券投资收益。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.18 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.19 衍生工具收益

本基金于本报告期无买卖衍生工具差价收入。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年2月25日（基金合同生效日）至2022年6月30日
股票投资产生的股利收益	36,574.62
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	36,574.62

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	10,060,299.33
股票投资	344,092.87
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	9,716,206.46
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	10,060,299.33

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	10.62
合计	10.62

6.4.7.23 信用减值损失

本基金于本报告期无信用减值损失。

6.4.7.24 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	20,322.54
信息披露费	40,645.08
证券出借违约金	-
开户费	400.00
银行费用	3,066.54
合计	64,434.16

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司(简称“国寿安保基金”)	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司(简称“招商银行”)	基金托管人、基金销售机构
中国人寿资产管理有限公司(简称“国寿资产”)	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司(简称“安保资本”)	基金管理人的股东
中国人寿保险(集团)公司(简称“集团公司”)	国寿安保的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司(简称“中国人寿”)	与基金管理人同受集团公司控制的公司、基金销售机构
国寿财富管理有限公司(简称“国寿财富”)	基金管理人的子公司
广发银行股份有限公司(简称“广发银行”)	基金管理人股东之股东的联营企业
国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	169,047.45
其中：支付销售机构的客户维护费	4,808.73

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费。支付基金管理人国寿安保基金的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额(若为负数则取 0)的 0.50%年费率计提基金管理费，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额
(若为负数则取 0)×0.50%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	33,809.46

注：本基金基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取托管费。支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（若为负数，则取 0）的 0.10%年费率计提基金托管费，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值扣除本基金投资于目标 ETF 部分基金资产净值后的净额（若为负数，则取 0）×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C	合计
国寿安保	-	1,580.74	1,580.74
招商银行	-	26.21	26.21
合计	-	1,606.95	1,606.95

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金资产净值 0.30%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给国寿安保基金管理有限公司，再由国寿安保基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日 C 类基金资产净值×0.30%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金于本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期末未运用自有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

国寿安保沪港深 300ETF 联接 A

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
中国人寿	60,001,700.00	42.79

注：对于分类基金，以上比例采用各自类别的基金总份额作为分母计算。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 2 月 25 日（基金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行	24,434,176.84	90,513.86
广发银行	0.00	35,555.56

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

2022 年 6 月 30 日，本基金持有 173,000,000.00 份目标 ETF 基金份额，占其总份额的比例为 5.71%。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末(2022年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

于本报告期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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 6.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	24,434,176.84	-	-	-	24,434,176.84
结算备付金	155,200.38	-	-	-	155,200.38
存出保证金	83,088.35	-	-	-	83,088.35

交易性金融资产	-	-	-	140,376,327.60	140,376,327.60
应收申购款	-	-	-	4,869.68	4,869.68
资产总计	24,672,465.57	-	-	140,381,197.28	165,053,662.85
负债					
应付赎回款	-	-	-	14,042,274.74	14,042,274.74
应付管理人报酬	-	-	-	6,192.86	6,192.86
应付托管费	-	-	-	1,238.53	1,238.53
应付销售服务费	-	-	-	18.62	18.62
其他负债	-	-	-	105,980.04	105,980.04
负债总计	-	-	-	14,155,704.79	14,155,704.79
利率敏感度缺口	24,672,465.57	-	-	-126,225,492.49	150,897,958.06

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券和资产支持证券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币元	港币 折合人民币元	其他币种 折合人民币元	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	33,456,621.56	-	33,456,621.56
应收股利	-	187,270.68	-	187,270.68
资产合计	-	33,643,892.24	-	33,643,892.24
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	33,643,892.24	-	33,643,892.24

注：表中数字为本基金直接持有的外币资产以及根据所投资的目标 ETF 持有的外币资产按照本基金所投资 ETF 份额比例计算得出的外币资产。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	假设本基金的单一外币汇率变化 5%，其他变量不变；	
	此项影响并未考虑管理层为减低汇率风险而可能采取的风险管理活动。	
	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2022 年 6 月 30 日）
分析	+5个基准点	1,682,194.61
	-5个基准点	-1,682,194.61

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,000,427.60	2.65
交易性金融资产—基金投资	136,375,900.00	90.38
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	140,376,327.60	93.03

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；	
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。	
	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（2022 年 6 月 30 日）
分析	+5 个基准点	6,818,792.02
	-5 个基准点	-6,818,792.02

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日
第一层次	140,376,327.60
第二层次	—
第三层次	—
合计	140,376,327.60

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项、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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,000,427.60	2.42
	其中：股票	4,000,427.60	2.42
2	基金投资	136,375,900.00	82.63
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,589,377.22	14.90
8	其他各项资产	87,958.03	0.05
9	合计	165,053,662.85	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	125,485.00	0.08
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,973,670.00	1.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,800.00	0.01
E	建筑业	50,220.00	0.03
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	55,810.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,440.00	0.05
J	金融业	377,637.60	0.25
K	房地产业	91,895.00	0.06
L	租赁和商务服务业	33,650.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	117,195.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,790.00	0.00
Q	卫生和社会工作	67,155.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	16,680.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	4,000,427.60	2.65

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	500	267,000.00	0.18
2	000858	五粮液	1,000	201,930.00	0.13
3	002594	比亚迪	500	166,745.00	0.11
4	000333	美的集团	2,500	150,975.00	0.10
5	300059	东方财富	5,400	137,160.00	0.09
6	002812	恩捷股份	500	125,225.00	0.08
7	000568	泸州老窖	500	123,270.00	0.08
8	002049	紫光国微	500	94,860.00	0.06
9	002304	洋河股份	500	91,575.00	0.06
10	002415	海康威视	2,500	90,500.00	0.06
11	002475	立讯精密	2,500	84,475.00	0.06
12	000651	格力电器	2,500	84,300.00	0.06
13	002714	牧原股份	1,500	82,905.00	0.05
14	603195	公牛集团	500	76,455.00	0.05
15	002460	赣锋锂业	500	74,350.00	0.05
16	000002	万科A	3,500	71,750.00	0.05
17	002142	宁波银行	2,000	71,620.00	0.05
18	300759	康龙化成	750	71,415.00	0.05
19	000001	平安银行	4,500	67,410.00	0.04
20	300015	爱尔眼科	1,500	67,155.00	0.04

21	300124	汇川技术	1,000	65,870.00	0.04
22	002466	天齐锂业	500	62,400.00	0.04
23	002709	天赐材料	1,000	62,060.00	0.04
24	603260	合盛硅业	500	58,980.00	0.04
25	002129	TCL 中环	1,000	58,890.00	0.04
26	000725	京东方 A	14,500	57,130.00	0.04
27	002352	顺丰控股	1,000	55,810.00	0.04
28	300122	智飞生物	500	55,505.00	0.04
29	002459	晶澳科技	700	55,230.00	0.04
30	002271	东方雨虹	1,000	51,470.00	0.03
31	300274	阳光电源	500	49,125.00	0.03
32	300014	亿纬锂能	500	48,750.00	0.03
33	300142	沃森生物	1,000	48,390.00	0.03
34	300347	泰格医药	400	45,780.00	0.03
35	000625	长安汽车	2,600	45,032.00	0.03
36	002179	中航光电	700	44,324.00	0.03
37	300498	温氏股份	2,000	42,580.00	0.03
38	000538	云南白药	700	42,273.00	0.03
39	002230	科大讯飞	1,000	41,220.00	0.03
40	000063	中兴通讯	1,500	38,295.00	0.03
41	300628	亿联网络	500	38,075.00	0.03
42	300979	华利集团	500	36,540.00	0.02
43	300601	康泰生物	800	36,144.00	0.02
44	002027	分众传媒	5,000	33,650.00	0.02
45	002241	歌尔股份	1,000	33,600.00	0.02
46	000100	TCL 科技	7,000	33,530.00	0.02
47	601186	中国铁建	4,000	31,600.00	0.02
48	300450	先导智能	500	31,590.00	0.02
49	000338	潍柴动力	2,500	31,175.00	0.02
50	002311	海大集团	500	30,005.00	0.02
51	000895	双汇发展	1,000	29,300.00	0.02
52	000776	广发证券	1,500	28,050.00	0.02
53	002050	三花智控	1,000	27,480.00	0.02
54	002001	新 和 成	1,200	27,372.00	0.02
55	002410	广联达	500	27,220.00	0.02
56	300999	金龙鱼	500	27,010.00	0.02
57	600919	江苏银行	3,500	24,920.00	0.02
58	000166	申万宏源	5,500	23,595.00	0.02
59	002493	荣盛石化	1,500	23,085.00	0.02
60	001979	招商蛇口	1,500	20,145.00	0.01
61	601668	中国建筑	3,500	18,620.00	0.01
62	000301	东方盛虹	1,000	16,910.00	0.01

63	003816	中国广核	6,000	16,800.00	0.01
64	300413	芒果超媒	500	16,680.00	0.01
65	000768	中航西飞	500	15,145.00	0.01
66	002938	鹏鼎控股	500	15,105.00	0.01
67	300408	三环集团	500	15,050.00	0.01
68	002736	国信证券	1,500	14,355.00	0.01
69	300433	蓝思科技	1,000	11,070.00	0.01
70	000708	中信特钢	500	10,075.00	0.01
71	002601	龙佰集团	500	10,025.00	0.01
72	002607	中公教育	1,000	5,790.00	0.00
73	600958	东方证券	560	5,717.60	0.00
74	000617	中油资本	1,000	4,810.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600036	招商银行	3,263,075.00	2.16
2	601318	中国平安	3,152,258.00	2.09
3	300750	宁德时代	1,801,691.00	1.19
4	601166	兴业银行	1,767,414.00	1.17
5	601012	隆基绿能	1,682,196.00	1.11
6	600900	长江电力	1,485,796.00	0.98
7	603259	药明康德	1,290,438.96	0.86
8	600030	中信证券	1,239,229.00	0.82
9	600887	伊利股份	1,117,160.00	0.74
10	000858	五粮液	1,106,490.00	0.73
11	603501	韦尔股份	1,084,666.00	0.72
12	601888	中国中免	1,017,006.00	0.67
13	000333	美的集团	1,011,739.00	0.67
14	600309	万华化学	1,009,080.00	0.67
15	601398	工商银行	971,349.00	0.64
16	601899	紫金矿业	950,330.00	0.63
17	600276	恒瑞医药	832,929.00	0.55
18	601328	交通银行	826,088.00	0.55
19	002594	比亚迪	818,083.00	0.54
20	603986	兆易创新	817,950.00	0.54

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,513,961.00	1.00
2	000858	五粮液	957,779.00	0.63
3	000333	美的集团	873,378.00	0.58
4	002594	比亚迪	726,311.00	0.48
5	300059	东方财富	697,685.00	0.46
6	002812	恩捷股份	646,414.00	0.43
7	002415	海康威视	612,382.21	0.41
8	002049	紫光国微	600,680.00	0.40
9	000568	泸州老窖	560,995.00	0.37
10	002714	牧原股份	505,510.00	0.34
11	000651	格力电器	496,265.00	0.33
12	002142	宁波银行	467,270.00	0.31
13	002475	立讯精密	451,881.00	0.30
14	000002	万科 A	448,020.00	0.30
15	000001	平安银行	443,002.00	0.29
16	002304	洋河股份	412,392.00	0.27
17	300122	智飞生物	408,787.00	0.27
18	002460	赣锋锂业	377,879.00	0.25
19	000725	京东方 A	373,048.00	0.25
20	300759	康龙化成	347,424.00	0.23

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	79,974,467.78
卖出股票收入（成交）总额	24,389,555.45

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国寿安保沪港深 300ETF	股票型	交易型开放式(ETF)	国寿安保基金管理有限公司	136,375,900.00	90.38

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

7.13 投资组合报告附注**7.13.1 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，东方财富信息股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到工信部的处罚；杭州海康威视数字技术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；国寿安保基金管理有限公司收到中国证券监督管理委员会北京监管局对其采取责令改正的监管措施。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.13.3 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	83,088.35
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,869.68
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	87,958.03

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	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 (%)
国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	218	643,160.42	139,959,875.44	99.82	249,096.54	0.18
国寿安保沪港深 300ETF 联接 C	133	655.88	-	-	87,232.65	100.00
合计	351	399,704.29	139,959,875.44	99.76	336,329.19	0.24

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	35,192.92	0.03
	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C	2,480.75	2.84
	合计	37,673.67	0.03

8.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	0~10
	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	0
	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	国寿安保沪港深 300ETF 联接 A	国寿安保沪港深 300ETF 联接 C
基金合同生效日（2022 年 2 月 25 日）基金份额总额	218,031,141.62	6,033,826.33
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	13,043,987.93	262,902.28
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	90,866,157.57	6,209,495.96
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	140,208,971.98	87,232.65

注：报告期内基金总申购份额含红利再投资和转换入份额，基金总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金管理人收到中国证券监督管理委员会北京监管局对其采取责令改正的监管措施，公司高度重视，已制定并实施相关整改措施。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中信证券	2	104,359,285.63	100.00	45,012.42	100.00	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中信证券	-	-	400,000,000.00	100.00	-	-	1,478,365.80	100.00
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同生效公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 2 月 26 日
2	国寿安保基金管理有限公司关于国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金投资关联方证券的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 3 月 2 日
3	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金开放日常申购、赎回、转换和定期定额投资业务的公告	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 3 月 26 日
4	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
5	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2022 年第 1 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
6	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基金产品资料概要更新	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
7	国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金更新招募说明书（2022 年第 2 号）	上证报、证监会指定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
机构	1	20220225~20220630	60,001,700.00	0.00	0.00	60,001,700.00	42.77
个人	-	-	-	-	-	-	-
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>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

12.1.1 中国证监会批准国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》

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

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.6 中国证监会要求的其他文件

12.2 存放地点

国寿安保基金管理有限公司, 地址: 北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

12.3 查阅方式

12.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

12.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: www.gsfunds.com.cn

12.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日