

# 国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券 投资基金 2022 年年度报告

2022 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：2023 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 03 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
3.3 其他指标.....	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	8
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	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.....	11
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明.....	11
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	11
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	12
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	12
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>12</b>
6.1 审计报告基本信息.....	12
6.2 审计报告的基本内容.....	12
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>14</b>
7.1 资产负债表.....	14
7.2 利润表.....	15
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18

<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>47</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	61
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.....	61
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.....	62
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.....	62
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.....	62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	62
8.12 投资组合报告附注.....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	63
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	63
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	64
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.....	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议.....	64
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.....	64
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	64
11.4 基金投资策略的改变.....	64
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	65
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.....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	65
11.8 其他重大事件.....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>67</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>68</b>
13.1 备查文件目录.....	68
13.2 存放地点.....	68
13.3 查阅方式.....	68

## § 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	138,318,687.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2015 年 7 月 3 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.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	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-2,144,783.77	137,113,025.32	55,940,018.79
本期利润	-51,427,151.03	73,201,604.26	160,034,633.22
加权平均基金份额本期利润	-0.2991	0.2210	0.2612
本期加权平均净值利润率	-21.56%	15.30%	20.48%
本期基金份额净值增长率	-19.02%	17.67%	21.94%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-117,397,141.64	-94,291,542.96	-515,682,836.17
期末可供分配基金份额利润	-0.8487	-0.5409	-0.8765
期末基金资产净值	181,326,928.22	282,180,998.55	809,348,527.85
期末基金份额净值	1.3109	1.6188	1.3757
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-39.30%	-25.04%	-36.30%

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

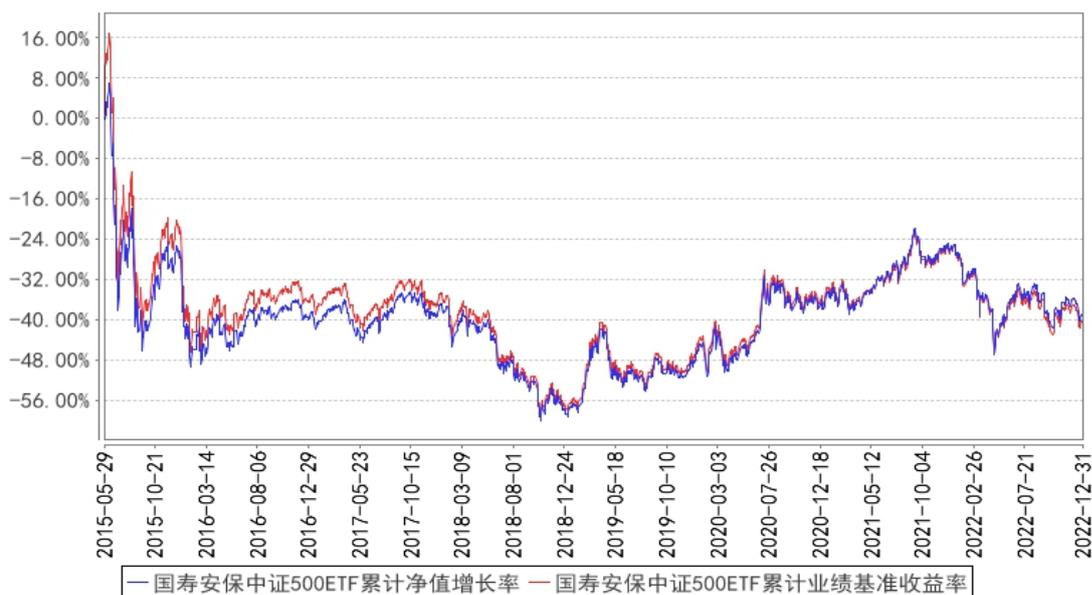
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.69%	1.02%	2.63%	1.03%	0.06%	-0.01%
过去六个月	-8.60%	1.09%	-9.14%	1.10%	0.54%	-0.01%

过去一年	-19.02%	1.37%	-20.31%	1.38%	1.29%	-0.01%
过去三年	16.19%	1.34%	11.33%	1.35%	4.86%	-0.01%
过去五年	-0.94%	1.40%	-6.18%	1.41%	5.24%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-39.30%	1.63%	-40.57%	1.66%	1.27%	-0.03%

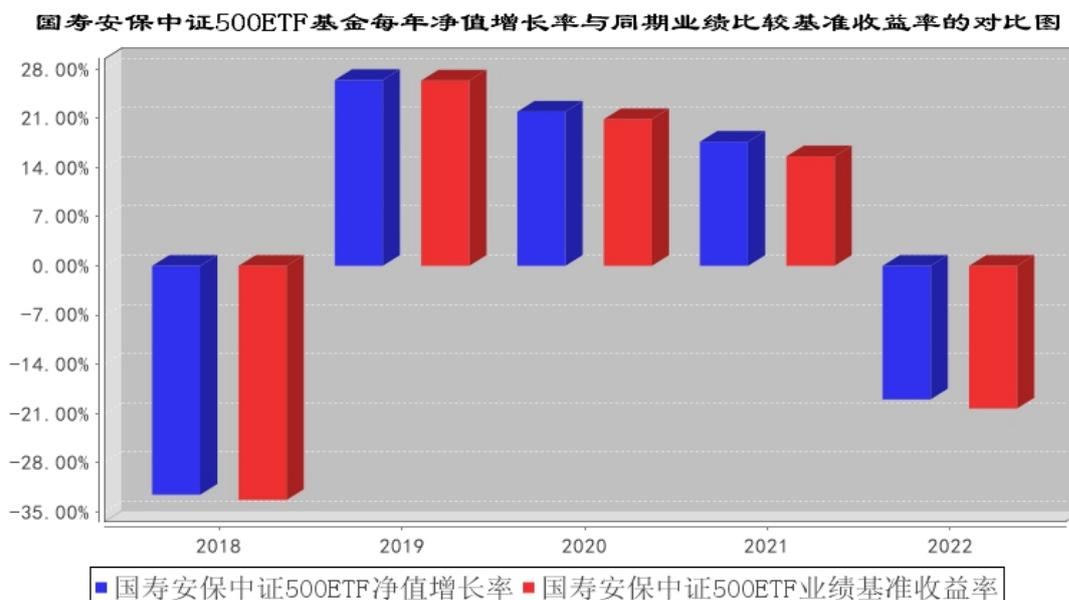
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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



注：本基金基金合同生效日为 2015 年 05 月 29 日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。本基金建仓期结束时各项资产配置比例符合基金合同约定。图示日期为 2015 年 05 月 29 日至 2022 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至2022年12月31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3218.34亿元，其中公募证券投资基金管理规模为2303.49亿元。

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

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 1.3109 元；本报告期基金份额净值增长率为 -19.02%，业绩比较基准收益率为 -20.31%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年权益市场整体下跌，受疫情反复、俄乌冲突和联储加息等因素影响，上证指数、沪深 300 指数、创业板指全年分别下跌 -15.1%，-21.6% 和 -29.4%。市场结构分化明显，31 个申万行业中（除综合外）仅煤炭板块录得正收益，跌幅最大的电子行业下跌 -36.54%，风格方面价值明显跑赢成长。

展望 2023 年，经济复苏预期和稳增长政策是驱动市场节奏的主要因素。按照去年底中央经济工作会议部署，恢复居民消费意愿，打通国内经济内循环的各个节点，在居民超额储蓄率创新高的背景下，未来消费端恢复的趋势较为明朗。房地产政策持续优化，对地产企业的债务风险化解、保交楼等措施将逐步增加居民改善需求的有效释放，带动相关产业链进一步修复。在稳增长政策效果显现之前，流动性预计将保持合理充裕。外部因素方面，海外经济衰退预期背景下，美联储和欧洲央行的加息进程将逐步缓解，成长型公司的估值压力逐步得到释放，地缘政治冲突和疫情可能阶段性带来风险。整体上，2023 年 A 股市场大概率呈震荡上涨行情。行业方面，相对看好自主可控和“大安全”战略相关的信创科技类板块，地产产业链中的建材家电等行业，以及消费板块的业绩修复带来的投资机会。

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(2023)第 24759 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	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 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。 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

	<p>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 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 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 2022 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估国寿安保中证 500ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算国寿安保中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督国寿安保中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险</p>

	<p>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，就可能导致对国寿安保中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致国寿安保中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张勇   周祎
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
审计报告日期	2023 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	1,832,598.11	2,501,130.01
结算备付金		-	26,928.75
存出保证金		2,044.90	50,578.62
交易性金融资产	7.4.7.2	179,929,906.55	279,946,083.95
其中：股票投资		179,894,906.09	279,930,083.95
基金投资		-	-
债券投资		35,000.46	16,000.00
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		-	72,464.01
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	583.02
资产总计		181,764,549.56	282,597,768.36
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		35,000.00	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		87,018.20	118,761.17
应付托管费		17,403.65	23,752.21
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.02	0.26
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	298,199.47	274,256.17
负债合计		437,621.34	416,769.81
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	298,724,069.86	376,472,541.51
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-117,397,141.64	-94,291,542.96
净资产合计		181,326,928.22	282,180,998.55
负债和净资产总计		181,764,549.56	282,597,768.36

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3109 元，基金份额总额 138,318,687.00 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		-49,683,010.46	77,702,513.89
1. 利息收入		15,583.96	104,513.31
其中：存款利息收入	7.4.7.13	15,583.96	58,707.00
债券利息收入		-	186.55
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	45,619.76
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-503,199.42	140,185,282.78
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-4,727,106.04	134,841,157.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	126,032.38	159,881.34
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	4,097,874.24	5,184,244.38
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	-49,282,367.26	-63,911,421.06
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	86,972.26	1,324,138.86
<b>减：二、营业总支出</b>		1,744,140.57	4,500,909.63
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,193,177.57	2,428,043.89
2. 托管费	7.4.10.2.2	238,635.64	485,608.75
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		0.27	164.64
8. 其他费用	7.4.7.23	312,327.09	1,587,092.35
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-51,427,151.03	73,201,604.26
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-51,427,151.03	73,201,604.26

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-51,427,151.03	73,201,604.26

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	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（基金净值）	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基金净值变动数（净值减少以“-”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）	298,724,069.86	-	-117,397,141.64	181,326,928.22
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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（基金净值）	1,270,579,965.54	-	-461,231,437.69	809,348,527.85
加：会计政策变更	-	-	-	-

前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期末初净资产(基金净值)	1,270,579,965.54	-	-461,231,437.69	809,348,527.85
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-894,107,424.03	-	366,939,894.73	-527,167,529.30
(一)、综合收益总额	-	-	73,201,604.26	73,201,604.26
(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)	-894,107,424.03	-	293,738,290.47	-600,369,133.56
其中: 1. 基金申购款	21,596,797.68	-	-6,146,169.16	15,450,628.52
2. 基金赎回款	-915,704,221.71	-	299,884,459.63	-615,819,762.08
(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、本期末末净资产(基金净值)	376,472,541.51	-	-94,291,542.96	282,180,998.55

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 2023 年 3 月 30 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》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

###### 新金融工具准则

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。

## (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。

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。

### (1) 金融资产的分类

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

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

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

### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

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。

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。

#### 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 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。

#### 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

##### 新金融工具准则

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投资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确认为利息收入,将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。

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。

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

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费等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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号——金融资产转移》、《企业会计准则第24号——套期会计》及《企业会计准则第37号——金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号),中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定,本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整2022年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额,2021年度的比较财务报表未重列。于2021年12月31日及2022年1月1日,本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于2022年1月1日,本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下:

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款,金额分别为2,501,130.01元、26,928.75元、50,578.62元、583.02元和72,464.01元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融

资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 2,501,672.23 元、26,942.06 元、50,603.59 元、0.00 元和 72,464.01 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 279,946,083.95 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 279,946,086.47 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 118,761.17 元、23,752.21 元、69,256.17 元和 205,000.00 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 118,761.17 元、23,752.21 元、69,256.17 元和 205,000.00 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、

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

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

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

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

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

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

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

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	1,832,598.11	2,501,130.01
等于：本金	1,832,214.61	2,501,130.01
加：应计利息	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	1,832,598.11	2,501,130.01

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 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	
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	249,038,284.73	-	279,930,083.95	30,891,799.22	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	16,000.00	-	16,000.00	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,000.00	-	16,000.00	-
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	249,054,284.73	-	279,946,083.95	30,891,799.22

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	583.02
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	583.02

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	93,199.47	69,256.17
其中：交易所市场	93,199.47	69,256.17
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	170,000.00	170,000.00
应付指数使用费	35,000.00	35,000.00
合计	298,199.47	274,256.17

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,318,687.00	376,472,541.51
本期申购	2,000,000.00	4,319,359.53
本期赎回（以“-”号填列）	-38,000,000.00	-82,067,831.18
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	138,318,687.00	298,724,069.86

#### 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
本期期初	-70,065,304.80	-24,226,238.16	-94,291,542.96
本期利润	-2,144,783.77	-49,282,367.26	-51,427,151.03
本期基金份额交易产生的变动数	14,604,019.02	13,717,533.33	28,321,552.35
其中：基金申购款	-803,459.67	-586,825.52	-1,390,285.19
基金赎回款	15,407,478.69	14,304,358.85	29,711,837.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-57,606,069.55	-59,791,072.09	-117,397,141.64

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	14,353.06	50,862.94
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	1,131.33	6,529.00
其他	99.57	1,315.06

合计	15,583.96	58,707.00
----	-----------	-----------

#### 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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,720,976.42	99,947,415.02
股票投资收益——赎回差价收入	-1,006,129.62	34,893,742.04
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	-4,727,106.04	134,841,157.06

##### 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 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年12月31日
卖出股票成交总额	108,468,639.12	518,887,448.87
减：卖出股票成本总额	111,884,788.19	418,940,033.85
减：交易费用	304,827.35	-
买卖股票差价收入	-3,720,976.42	99,947,415.02

##### 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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
赎回基金份额对价总额	52,355,993.64	615,819,762.08
减：现金支付赎回款总额	25,701,196.64	331,873,120.08
减：赎回股票成本总额	27,660,926.62	249,052,899.96
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-1,006,129.62	34,893,742.04

#### 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 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
债券投资收益——利息收入	109.44	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及	125,922.94	159,881.34

债券到期兑付) 差价收入		
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	126,032.38	159,881.34

#### 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 2022年1月1日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至 2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	767,165.73	1,070,370.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	641,100.00	910,300.00
减：应计利息总额	113.65	188.93
减：交易费用	29.14	-
买卖债券差价收入	125,922.94	159,881.34

#### 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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
股票投资产生的股利收益	4,097,874.24	5,184,244.38
其中：证券出借权益补偿收入	-	10,330.00
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,097,874.24	5,184,244.38

#### 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
1. 交易性金融资产	-49,282,367.26	-63,911,421.06
股票投资	-49,282,367.26	-63,911,421.06
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	-49,282,367.26	-63,911,421.06

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	86,972.26	1,324,138.86
合计	86,972.26	1,324,138.86

#### 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 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,326.52	8,458.84
指数使用费	140,000.00	175,333.24
存托服务费	0.57	-
交易费用	-	1,233,300.27
合计	312,327.09	1,587,092.35

#### 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，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

### 7.4.9 关联方关系

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

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

##### 7.4.10.1.2 权证交易

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期及上年度可比期间均未发生应支付关联方的佣金。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,193,177.57	2,428,043.89
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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

$$H = E \times 0.50\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	238,635.64	485,608.75

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% 的费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金的管理人于本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 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	136,246,286.00	98.50	170,286,286.00	97.69

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	1,832,598.11	14,353.06	2,501,130.01	50,862.94

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（2022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
118030	睿创转债	2022年12月30日	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.00	350	35,000.00	35,000.46	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值 单价	复牌日期	复牌 开盘 单价	数量 (股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
600038	中直股份	2022年12月26日	拟筹划重大资产重组	46.41	2023年1月10日	51.05	8,269	420,840.59	383,764.29	-

300850	新强联	2022 年 12 月 30 日	重大事 项停牌	53.28	2023 年 1 月 10 日	56.88	5,600	336,362.17	298,368.00	-
--------	-----	------------------------	------------	-------	--------------------	-------	-------	------------	------------	---

#### 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证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证券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金于本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

##### 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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

于本报告期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	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
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,501,130.01	-	-	-	2,501,130.01
结算备付金	26,928.75	-	-	-	26,928.75
存出保证金	50,578.62	-	-	-	50,578.62
交易性金融资产	-	-	16,000.00	279,930,083.95	279,946,083.95
应收证券清算款	-	-	-	72,464.01	72,464.01
其他资产	-	-	-	583.02	583.02
资产总计	2,578,637.38	-	16,000.00	280,003,130.98	282,597,768.36
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	118,761.17	118,761.17
应付托管费	-	-	-	23,752.21	23,752.21
应交税费	-	-	-	0.26	0.26
其他负债	-	-	-	274,256.17	274,256.17
负债总计	-	-	-	416,769.81	416,769.81
利率敏感度缺口	2,578,637.38	-	16,000.00	279,586,361.17	282,180,998.55

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 2022 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 0.0193%(2021 年 12 月 31 日：0.0057%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 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 2022年12月31日		上年度末 2021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	179,894,906.09	99.21	279,930,083.95	99.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	35,000.46	0.02	16,000.00	0.01
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	179,929,906.55	99.23	279,946,083.95	99.21

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据组合的净值数据和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）		
	本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）	
分析	+5%	8,885,019.48	13,967,959.43
	-5%	-8,885,019.48	-13,967,959.43

## 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	179,212,773.80	279,375,927.51
第二层次	717,132.75	560,652.49
第三层次	-	9,503.95
合计	179,929,906.55	279,946,083.95

#### 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

项目	本期 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	-	-	-
项目	上年度可比同期		
	2021年1月1日至2021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	-	966,784.74	966,784.74
转出第三层次	-	1,635,605.51	1,635,605.51
当期利得或损失总额	-	678,324.72	678,324.72
其中：计入损益的利得或损失	-	678,324.72	678,324.72
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	9,503.95	9,503.95
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	-	4,207.60	4,207.60

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产—流通受限股票	9,503.95	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	36.74%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 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 (2021 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以摊余成本计量的金融负债，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	179,894,906.09	98.97
	其中：股票	179,894,906.09	98.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,000.46	0.02
	其中：债券	35,000.46	0.02
	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	1,832,598.11	1.01
8	其他各项资产	2,044.90	0.00
9	合计	181,764,549.56	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	1,714,792.80	0.95
B	采矿业	7,863,433.48	4.34
C	制造业	109,598,935.64	60.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,002,596.80	3.31
E	建筑业	1,593,498.00	0.88
F	批发和零售业	7,615,711.20	4.20
G	交通运输、仓储和邮政业	3,999,651.79	2.21
H	住宿和餐饮业	469,216.00	0.26
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,875,768.25	7.10
J	金融业	15,607,502.06	8.61
K	房地产业	3,689,395.68	2.03
L	租赁和商务服务业	2,090,525.00	1.15

M	科学研究和技术服务业	1,968,840.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	1,002,731.79	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	356,343.40	0.20
R	文化、体育和娱乐业	2,373,243.00	1.31
S	综合	1,072,721.20	0.59
	合计	179,894,906.09	99.21

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

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	002340	格林美	144,800	1,075,864.00	0.59
2	300012	华测检测	47,400	1,057,020.00	0.58
3	600157	永泰能源	626,300	958,239.00	0.53
4	002384	东山精密	38,600	954,578.00	0.53
5	300724	捷佳伟创	7,900	900,758.00	0.50
6	688777	中控技术	9,800	890,134.00	0.49
7	603613	国联股份	10,020	886,168.80	0.49
8	688122	西部超导	9,200	871,148.00	0.48
9	300003	乐普医疗	37,100	852,187.00	0.47
10	002422	科伦药业	32,000	851,520.00	0.47
11	600487	亨通光电	55,700	838,842.00	0.46
12	002385	大北农	93,400	831,260.00	0.46
13	688063	派能科技	2,600	820,690.00	0.45
14	603345	安井食品	5,000	809,400.00	0.45
15	002966	苏州银行	103,260	803,362.80	0.44
16	603606	东方电缆	11,600	786,828.00	0.43
17	600885	宏发股份	23,476	784,333.16	0.43
18	002013	中航机电	77,500	778,875.00	0.43
19	600765	中航重机	24,880	773,519.20	0.43
20	600079	人福医药	32,300	771,647.00	0.43
21	600096	云天化	36,200	761,648.00	0.42
22	002497	雅化集团	32,500	755,625.00	0.42
23	601555	东吴证券	113,030	738,085.90	0.41
24	600352	浙江龙盛	73,400	726,660.00	0.40
25	002625	光启技术	42,500	723,350.00	0.40
26	002407	多氟多	21,600	719,712.00	0.40
27	002603	以岭药业	23,500	704,060.00	0.39
28	000009	中国宝安	58,180	703,396.20	0.39

29	601058	赛轮轮胎	69,000	691,380.00	0.38
30	601233	桐昆股份	47,600	687,820.00	0.38
31	002738	中矿资源	10,300	686,598.00	0.38
32	600988	赤峰黄金	37,500	676,875.00	0.37
33	000630	铜陵有色	216,500	675,480.00	0.37
34	600489	中金黄金	82,000	671,580.00	0.37
35	603605	珀莱雅	4,000	669,920.00	0.37
36	603688	石英股份	5,100	669,732.00	0.37
37	600298	安琪酵母	14,700	664,734.00	0.37
38	002028	思源电气	17,320	661,970.40	0.37
39	688390	固德威	2,040	659,103.60	0.36
40	300146	汤臣倍健	28,800	657,216.00	0.36
41	601108	财通证券	91,700	652,904.00	0.36
42	000807	云铝股份	58,600	651,632.00	0.36
43	600536	中国软件	11,170	651,546.10	0.36
44	603939	益丰药房	10,200	651,168.00	0.36
45	300390	天华超净	11,600	648,208.00	0.36
46	600418	江淮汽车	49,300	647,309.00	0.36
47	300144	宋城演艺	44,300	646,780.00	0.36
48	300073	当升科技	11,400	642,960.00	0.35
49	600141	兴发集团	21,980	637,420.00	0.35
50	300699	光威复材	8,800	635,800.00	0.35
51	600399	抚顺特钢	44,400	635,364.00	0.35
52	300037	新宙邦	14,600	634,662.00	0.35
53	600859	王府井	22,375	629,632.50	0.35
54	603517	绝味食品	10,300	629,227.00	0.35
55	300285	国瓷材料	22,600	623,082.00	0.34
56	601077	渝农商行	174,700	616,691.00	0.34
57	300568	星源材质	28,900	614,414.00	0.34
58	600873	梅花生物	60,100	611,818.00	0.34
59	600563	法拉电子	3,800	607,544.00	0.34
60	002185	华天科技	72,300	599,367.00	0.33
61	603456	九洲药业	14,100	598,263.00	0.33
62	002138	顺络电子	22,700	594,286.00	0.33
63	603816	顾家家居	13,900	593,669.00	0.33
64	600160	巨化股份	38,020	589,690.20	0.33
65	601128	常熟银行	77,200	582,860.00	0.32
66	603589	口子窖	10,100	582,467.00	0.32
67	000783	长江证券	109,000	580,970.00	0.32
68	688099	晶晨股份	8,200	578,182.00	0.32
69	002192	融捷股份	5,900	577,610.00	0.32
70	600153	建发股份	42,300	577,395.00	0.32
71	000629	钒钛股份	121,400	574,222.00	0.32

72	601699	潞安环能	33,800	569,530.00	0.31
73	300357	我武生物	10,300	567,530.00	0.31
74	605358	立昂微	13,300	566,580.00	0.31
75	601162	天风证券	195,600	561,372.00	0.31
76	000683	远兴能源	71,500	560,560.00	0.31
77	601607	上海医药	31,300	558,079.00	0.31
78	688567	孚能科技	20,500	554,115.00	0.31
79	600392	盛和资源	39,495	552,930.00	0.30
80	002568	百润股份	14,800	552,928.00	0.30
81	603596	伯特利	6,900	550,620.00	0.30
82	600161	天坛生物	23,200	550,536.00	0.30
83	000932	华菱钢铁	116,880	549,336.00	0.30
84	600521	华海药业	25,100	548,686.00	0.30
85	601168	西部矿业	53,666	547,393.20	0.30
86	600109	国金证券	62,900	547,230.00	0.30
87	000831	中国稀土	16,600	545,808.00	0.30
88	600499	科达制造	38,400	545,664.00	0.30
89	600486	扬农化工	5,220	542,358.00	0.30
90	600027	华电国际	91,900	540,372.00	0.30
91	002223	鱼跃医疗	16,950	540,027.00	0.30
92	002797	第一创业	94,600	532,598.00	0.29
93	603077	和邦生物	174,160	529,446.40	0.29
94	600862	中航高科	23,600	526,044.00	0.29
95	000999	华润三九	11,200	524,272.00	0.29
96	688385	复旦微电	7,500	523,575.00	0.29
97	002078	太阳纸业	45,400	523,008.00	0.29
98	000975	银泰黄金	46,972	518,570.88	0.29
99	601636	旗滨集团	45,400	517,106.00	0.29
100	002294	信立泰	15,700	515,745.00	0.28
101	601872	招商轮船	91,500	511,485.00	0.28
102	002025	航天电器	7,700	510,125.00	0.28
103	002268	电科网安	16,700	509,851.00	0.28
104	600497	驰宏锌锗	100,500	508,530.00	0.28
105	600143	金发科技	52,400	507,756.00	0.28
106	002532	天山铝业	65,500	505,660.00	0.28
107	300253	卫宁健康	48,500	498,580.00	0.27
108	002299	圣农发展	21,000	497,490.00	0.27
109	601696	中银证券	46,900	495,733.00	0.27
110	600177	雅戈尔	78,300	495,639.00	0.27
111	601990	南京证券	62,500	495,625.00	0.27
112	002439	启明星辰	18,800	490,304.00	0.27
113	600705	中航产融	149,300	489,704.00	0.27
114	002624	完美世界	38,300	487,176.00	0.27

115	000591	太阳能	66,000	483,780.00	0.27
116	600348	华阳股份	33,900	483,075.00	0.27
117	603737	三棵树	4,200	478,086.00	0.26
118	000998	隆平高科	29,700	477,279.00	0.26
119	000738	航发控制	18,500	474,340.00	0.26
120	600026	中远海能	39,259	473,070.95	0.26
121	600258	首旅酒店	18,920	469,216.00	0.26
122	600549	厦门钨业	24,000	469,200.00	0.26
123	000728	国元证券	73,900	467,787.00	0.26
124	600482	中国动力	30,500	466,345.00	0.26
125	000988	华工科技	28,400	466,044.00	0.26
126	002850	科达利	3,900	463,359.00	0.26
127	000519	中兵红箭	23,562	462,757.68	0.26
128	002273	水晶光电	39,229	462,509.91	0.26
129	002673	西部证券	75,700	461,013.00	0.25
130	688301	奕瑞科技	1,000	457,880.00	0.25
131	300604	长川科技	10,200	454,716.00	0.25
132	601997	贵阳银行	82,300	451,827.00	0.25
133	002507	涪陵榨菜	17,500	450,975.00	0.25
134	300136	信维通信	27,300	450,723.00	0.25
135	300832	新产业	8,900	446,246.00	0.25
136	002092	中泰化学	58,702	437,916.92	0.24
137	300363	博腾股份	10,700	437,095.00	0.24
138	002430	杭氧股份	11,100	436,896.00	0.24
139	000703	恒逸石化	62,000	435,860.00	0.24
140	600325	华发股份	47,770	432,796.20	0.24
141	002030	达安基因	27,744	431,696.64	0.24
142	002557	洽洽食品	8,600	430,000.00	0.24
143	002739	万达电影	30,700	429,800.00	0.24
144	002056	横店东磁	22,900	429,146.00	0.24
145	300308	中际旭创	15,800	427,074.00	0.24
146	601666	平煤股份	39,200	423,752.00	0.23
147	600529	山东药玻	14,900	423,160.00	0.23
148	603233	大参林	10,680	422,928.00	0.23
149	601198	东兴证券	54,700	422,284.00	0.23
150	002156	通富微电	25,600	421,888.00	0.23
151	600704	物产中大	87,700	421,837.00	0.23
152	000729	燕京啤酒	39,700	421,614.00	0.23
153	002465	海格通信	51,900	421,428.00	0.23
154	601016	节能风电	110,340	420,395.40	0.23
155	600655	豫园股份	54,900	417,789.00	0.23
156	600879	航天电子	61,200	416,160.00	0.23
157	300088	长信科技	69,100	412,527.00	0.23

158	688116	天奈科技	5,300	408,842.00	0.23
159	603658	安图生物	6,600	408,210.00	0.23
160	002409	雅克科技	8,100	407,997.00	0.23
161	600415	小商品城	77,300	405,052.00	0.22
162	002080	中材科技	18,900	405,027.00	0.22
163	002353	杰瑞股份	14,500	404,695.00	0.22
164	600546	山煤国际	27,900	404,271.00	0.22
165	000830	鲁西化工	32,500	402,675.00	0.22
166	000960	锡业股份	28,200	397,620.00	0.22
167	000400	许继电气	19,900	397,403.00	0.22
168	000878	云南铜业	33,800	397,150.00	0.22
169	002683	广东宏大	14,700	396,312.00	0.22
170	603267	鸿远电子	3,900	394,524.00	0.22
171	600516	方大炭素	64,300	393,516.00	0.22
172	000623	吉林敖东	26,200	392,738.00	0.22
173	600170	上海建工	150,600	391,560.00	0.22
173	603160	汇顶科技	7,800	391,560.00	0.22
174	002444	巨星科技	20,300	385,294.00	0.21
175	300418	昆仑万维	26,700	384,747.00	0.21
176	002531	天顺风能	25,400	384,302.00	0.21
177	002372	伟星新材	18,000	384,120.00	0.21
178	300017	网宿科技	68,800	383,904.00	0.21
179	600038	中直股份	8,269	383,764.29	0.21
180	600637	东方明珠	57,700	383,705.00	0.21
181	601577	长沙银行	56,600	382,616.00	0.21
182	600166	福田汽车	135,500	380,755.00	0.21
183	603712	七一二	10,900	380,628.00	0.21
184	600739	辽宁成大	30,200	380,218.00	0.21
185	600642	申能股份	69,100	379,359.00	0.21
186	601456	国联证券	33,700	379,125.00	0.21
187	600699	均胜电子	26,960	378,788.00	0.21
188	300373	扬杰科技	7,200	378,720.00	0.21
189	002326	永太科技	17,300	377,659.00	0.21
190	603444	吉比特	1,200	375,408.00	0.21
191	002203	海亮股份	33,200	375,160.00	0.21
192	000970	中科三环	27,425	374,077.00	0.21
193	002508	老板电器	13,400	371,984.00	0.21
194	688002	睿创微纳	10,000	371,900.00	0.21
195	000155	川能动力	20,800	371,072.00	0.20
196	600673	东阳光	42,500	369,325.00	0.20
197	603026	胜华新材	4,000	369,200.00	0.20
198	603127	昭衍新药	6,300	367,983.00	0.20
199	600380	健康元	32,496	366,879.84	0.20

200	000039	中集集团	51,833	364,904.32	0.20
201	600909	华安证券	79,490	364,859.10	0.20
202	600056	中国医药	21,060	362,863.80	0.20
203	300676	华大基因	7,000	361,830.00	0.20
204	600867	通化东宝	39,300	360,774.00	0.20
205	000739	普洛药业	16,700	359,718.00	0.20
206	600118	中国卫星	16,600	357,730.00	0.20
207	002065	东华软件	63,200	357,712.00	0.20
208	000750	国海证券	107,320	357,375.60	0.20
209	600985	淮北矿业	27,900	357,120.00	0.20
210	300244	迪安诊断	14,180	356,343.40	0.20
211	300058	蓝色光标	70,400	355,520.00	0.20
212	600008	首创环保	124,420	352,108.60	0.19
213	600369	西南证券	93,600	351,000.00	0.19
214	300474	景嘉微	6,400	349,248.00	0.19
215	688009	中国通号	72,800	348,712.00	0.19
216	002152	广电运通	35,000	347,900.00	0.19
217	002831	裕同科技	10,520	347,896.40	0.19
218	600372	中航电子	21,700	346,549.00	0.19
219	300558	贝达药业	7,000	344,890.00	0.19
220	600998	九州通	26,400	344,256.00	0.19
221	601880	辽港股份	211,940	343,342.80	0.19
222	000513	丽珠集团	10,553	342,761.44	0.19
223	000027	深圳能源	53,720	341,659.20	0.19
224	002936	郑州银行	144,876	340,458.60	0.19
225	000547	航天发展	36,200	339,918.00	0.19
226	600435	北方导航	29,300	339,880.00	0.19
227	002408	齐翔腾达	48,193	339,278.72	0.19
228	300070	碧水源	71,600	338,668.00	0.19
229	000636	风华高科	22,800	338,124.00	0.19
230	300866	安克创新	5,700	337,839.00	0.19
231	002131	利欧股份	190,709	337,554.93	0.19
232	300026	红日药业	59,400	337,392.00	0.19
233	002506	协鑫集成	115,600	336,396.00	0.19
234	002212	天融信	33,400	333,666.00	0.18
235	002926	华西证券	44,300	333,579.00	0.18
236	603883	老百姓	8,240	333,472.80	0.18
237	300383	光环新网	40,500	330,480.00	0.18
238	600378	昊华科技	7,700	330,407.00	0.18
239	300682	朗新科技	15,000	329,700.00	0.18
240	002183	怡亚通	51,200	329,216.00	0.18
241	002572	索菲亚	18,100	328,696.00	0.18
242	603858	步长制药	15,600	327,756.00	0.18

243	600820	隧道股份	61,900	326,213.00	0.18
244	600271	航天信息	31,300	325,833.00	0.18
245	002195	二三四五	161,685	324,986.85	0.18
246	600580	卧龙电驱	26,000	323,960.00	0.18
247	603893	瑞芯微	4,700	323,407.00	0.18
248	000887	中鼎股份	22,300	322,681.00	0.18
249	300296	利亚德	57,000	322,620.00	0.18
250	002250	联化科技	20,800	322,400.00	0.18
251	002368	太极股份	11,458	322,313.54	0.18
252	600390	五矿资本	63,400	322,072.00	0.18
253	600848	上海临港	27,000	321,840.00	0.18
254	002500	山西证券	60,690	321,657.00	0.18
255	600863	内蒙华电	91,800	320,382.00	0.18
256	603156	养元饮品	14,300	318,461.00	0.18
257	600021	上海电力	31,800	318,318.00	0.18
258	688779	长远锂科	21,800	318,062.00	0.18
259	002958	青农商行	109,500	316,455.00	0.17
260	601958	金铂股份	27,300	315,315.00	0.17
261	688538	和辉光电	117,300	314,364.00	0.17
262	300024	机器人	35,000	314,300.00	0.17
263	688521	芯原股份	7,100	312,897.00	0.17
264	300001	特锐德	20,500	311,805.00	0.17
265	600755	厦门国贸	43,500	310,590.00	0.17
266	300009	安科生物	33,132	310,115.52	0.17
267	002244	滨江集团	35,100	309,933.00	0.17
268	688256	寒武纪	5,673	309,518.88	0.17
269	600208	新湖中宝	121,300	308,102.00	0.17
270	002155	湖南黄金	23,704	306,966.80	0.17
271	600315	上海家化	9,600	305,760.00	0.17
272	002511	中顺洁柔	22,200	305,028.00	0.17
273	600316	洪都航空	12,100	304,799.00	0.17
274	000997	新大陆	23,319	303,380.19	0.17
275	000060	中金岭南	73,900	302,990.00	0.17
276	603885	吉祥航空	18,700	302,566.00	0.17
277	300776	帝尔激光	2,400	302,400.00	0.17
278	601231	环旭电子	18,600	301,878.00	0.17
279	000050	深天马 A	34,700	300,502.00	0.17
280	600060	海信视像	22,100	299,234.00	0.17
281	601005	重庆钢铁	189,000	298,620.00	0.16
282	300850	新强联	5,600	298,368.00	0.16
283	601992	金隅集团	117,300	297,942.00	0.16
284	603927	中科软	10,000	296,100.00	0.16
285	600511	国药股份	10,600	295,740.00	0.16

286	603218	日月股份	14,500	294,350.00	0.16
287	688185	康希诺	2,000	292,040.00	0.16
288	601717	郑煤机	25,900	289,044.00	0.16
289	300251	光线传媒	33,200	287,512.00	0.16
290	600528	中铁工业	37,547	286,483.61	0.16
291	600201	生物股份	31,614	284,842.14	0.16
292	600801	华新水泥	19,172	284,129.04	0.16
293	600566	济川药业	10,400	283,088.00	0.16
294	300168	万达信息	33,512	282,506.16	0.16
295	000021	深科技	26,400	282,216.00	0.16
296	002939	长城证券	34,000	281,520.00	0.16
297	600066	宇通客车	37,400	280,874.00	0.15
298	000825	太钢不锈	64,600	279,072.00	0.15
299	600171	上海贝岭	16,000	278,880.00	0.15
300	002373	千方科技	31,200	278,304.00	0.15
301	688188	柏楚电子	1,280	277,862.40	0.15
302	600906	财达证券	36,600	277,062.00	0.15
303	600839	四川长虹	104,300	275,352.00	0.15
304	600598	北大荒	20,000	275,200.00	0.15
305	600282	南钢股份	87,000	274,050.00	0.15
306	600827	百联股份	22,600	273,912.00	0.15
307	300677	英科医疗	13,020	273,810.60	0.15
308	600535	天士力	25,400	273,304.00	0.15
309	600970	中材国际	31,900	271,788.00	0.15
310	601866	中远海发	111,400	269,588.00	0.15
311	601778	晶科科技	49,000	269,500.00	0.15
312	601665	齐鲁银行	64,600	269,382.00	0.15
313	600500	中化国际	40,520	267,837.20	0.15
314	002128	电投能源	21,640	267,037.60	0.15
315	601179	中国西电	57,900	266,919.00	0.15
316	002127	南极电商	55,200	265,512.00	0.15
317	300861	美畅股份	5,400	265,464.00	0.15
318	002153	石基信息	17,700	265,323.00	0.15
319	603568	伟明环保	14,283	264,663.99	0.15
320	000930	中粮科技	31,600	264,176.00	0.15
321	600498	烽火通信	20,100	264,114.00	0.15
322	603000	人民网	15,600	263,172.00	0.15
323	000709	河钢股份	116,300	262,838.00	0.14
324	002595	豪迈科技	11,300	261,595.00	0.14
325	300182	捷成股份	58,100	259,707.00	0.14
326	000012	南玻 A	38,675	259,509.25	0.14
327	600398	海澜之家	48,700	258,110.00	0.14
328	300888	稳健医疗	3,600	257,400.00	0.14

329	002701	奥瑞金	50,780	256,439.00	0.14
330	000987	越秀资本	42,530	254,754.70	0.14
331	002985	北摩高科	5,643	254,499.30	0.14
332	002019	亿帆医药	20,700	253,575.00	0.14
333	002124	天邦食品	41,380	252,831.80	0.14
334	000581	威孚高科	14,200	251,766.00	0.14
335	600959	江苏有线	84,700	251,559.00	0.14
336	002396	星网锐捷	13,100	250,996.00	0.14
337	603707	健友股份	13,726	247,617.04	0.14
338	000598	兴蓉环境	50,600	247,434.00	0.14
339	600895	张江高科	21,800	247,212.00	0.14
340	000401	冀东水泥	30,000	246,900.00	0.14
341	000778	新兴铸管	67,500	246,375.00	0.14
342	300115	长盈精密	23,656	244,366.48	0.13
343	300618	寒锐钴业	6,100	244,305.00	0.13
344	002670	国盛金控	32,836	243,314.76	0.13
345	688208	道通科技	7,705	243,092.75	0.13
346	600582	天地科技	46,500	241,800.00	0.13
347	600663	陆家嘴	24,800	241,552.00	0.13
348	600718	东软集团	24,200	240,790.00	0.13
349	600297	广汇汽车	114,600	240,660.00	0.13
350	002249	大洋电机	46,800	239,616.00	0.13
351	300482	万孚生物	7,490	238,706.30	0.13
352	688690	纳微科技	4,600	238,142.00	0.13
353	600507	方大特钢	39,496	237,765.92	0.13
354	002690	美亚光电	9,940	237,566.00	0.13
355	002266	浙富控股	60,580	236,867.80	0.13
356	600329	达仁堂	8,100	235,710.00	0.13
357	603225	新凤鸣	21,640	235,443.20	0.13
358	600517	国网英大	48,200	233,288.00	0.13
359	000883	湖北能源	55,500	233,100.00	0.13
360	603866	桃李面包	15,063	231,970.20	0.13
361	002505	鹏都农牧	89,470	230,832.60	0.13
362	600409	三友化工	34,900	230,689.00	0.13
363	000656	金科股份	120,700	230,537.00	0.13
364	300212	易华录	11,240	229,408.40	0.13
365	600259	广晟有色	5,700	229,140.00	0.13
366	601000	唐山港	83,546	228,916.04	0.13
367	002002	鸿达兴业	70,308	227,797.92	0.13
368	600022	山东钢铁	153,770	227,579.60	0.13
369	000089	深圳机场	28,900	227,154.00	0.13
370	600871	石化油服	114,500	226,710.00	0.13
371	600064	南京高科	34,168	225,850.48	0.12

372	000785	居然之家	55,200	225,768.00	0.12
373	601106	中国一重	77,000	225,610.00	0.12
374	600567	山鹰国际	90,800	225,184.00	0.12
375	300376	易事特	32,700	223,341.00	0.12
376	002468	申通快递	21,600	223,128.00	0.12
377	002429	兆驰股份	63,700	222,313.00	0.12
378	600216	浙江医药	19,000	222,110.00	0.12
379	600782	新钢股份	54,000	220,860.00	0.12
380	002081	金螳螂	44,900	217,765.00	0.12
381	601333	广深铁路	95,400	216,558.00	0.12
382	601718	际华集团	74,100	215,631.00	0.12
383	600667	太极实业	41,700	215,172.00	0.12
384	601187	厦门银行	37,300	213,729.00	0.12
385	688029	南微医学	2,593	212,963.09	0.12
386	601118	海南橡胶	48,400	211,992.00	0.12
387	600062	华润双鹤	11,832	211,674.48	0.12
388	002010	传化智联	39,600	211,464.00	0.12
389	002191	劲嘉股份	29,000	209,670.00	0.12
390	600728	佳都科技	39,700	209,616.00	0.12
391	600737	中粮糖业	30,200	209,588.00	0.12
392	300463	迈克生物	12,100	209,330.00	0.12
393	000540	中天金融	138,600	209,286.00	0.12
394	600597	光明乳业	19,402	208,765.52	0.12
395	600155	华创阳安	32,000	208,000.00	0.11
396	000537	广宇发展	15,700	207,711.00	0.11
397	600376	首开股份	36,400	207,116.00	0.11
398	601156	东航物流	13,500	206,010.00	0.11
399	002221	东华能源	26,700	203,721.00	0.11
400	002745	木林森	25,100	203,561.00	0.11
401	300072	海新能科	46,600	203,176.00	0.11
402	601098	中南传媒	20,300	202,594.00	0.11
403	600131	国网信通	13,500	201,960.00	0.11
404	600967	内蒙一机	23,997	198,215.22	0.11
405	002416	爱施德	20,880	197,942.40	0.11
406	600126	杭钢股份	47,730	197,124.90	0.11
407	601991	大唐发电	70,100	195,579.00	0.11
408	000156	华数传媒	26,000	194,740.00	0.11
409	603379	三美股份	6,840	194,666.40	0.11
410	603228	景旺电子	9,568	193,656.32	0.11
411	600808	马钢股份	68,336	192,024.16	0.11
412	601568	北元集团	33,670	190,908.90	0.11
413	002048	宁波华翔	13,700	190,430.00	0.11
414	000937	冀中能源	29,900	190,164.00	0.10

415	002281	光迅科技	11,800	185,496.00	0.10
416	002423	中粮资本	25,900	185,444.00	0.10
417	600901	江苏租赁	33,600	184,128.00	0.10
418	688289	圣湘生物	8,355	183,392.25	0.10
419	001914	招商积余	11,900	183,022.00	0.10
420	600095	湘财股份	24,100	182,196.00	0.10
421	003035	南网能源	32,100	182,007.00	0.10
422	600373	中文传媒	19,000	181,830.00	0.10
423	000559	万向钱潮	37,300	181,651.00	0.10
424	000898	鞍钢股份	67,900	181,293.00	0.10
425	603056	德邦股份	8,700	181,221.00	0.10
426	300630	普利制药	7,313	180,338.58	0.10
427	002434	万里扬	22,200	178,710.00	0.10
428	603317	天味食品	6,464	177,630.72	0.10
429	301029	怡合达	2,700	177,498.00	0.10
430	000402	金融街	33,700	176,925.00	0.10
431	002867	周大生	12,300	172,569.00	0.10
432	600556	天下秀	25,400	171,196.00	0.09
433	601611	中国核建	22,500	171,000.00	0.09
434	601598	中国外运	44,500	170,880.00	0.09
435	601608	中信重工	48,900	170,661.00	0.09
436	601928	凤凰传媒	21,500	170,280.00	0.09
437	300257	开山股份	11,300	169,500.00	0.09
438	000563	陕国投 A	55,700	168,771.00	0.09
439	600707	彩虹股份	40,600	168,084.00	0.09
440	600195	中牧股份	14,400	167,328.00	0.09
441	002948	青岛银行	49,610	166,689.60	0.09
442	000959	首钢股份	44,200	166,634.00	0.09
443	001203	大中矿业	12,800	165,504.00	0.09
444	600968	海油发展	57,200	164,736.00	0.09
445	002110	三钢闽光	34,750	163,325.00	0.09
446	000967	盈峰环境	35,800	162,532.00	0.09
447	600167	联美控股	25,680	162,297.60	0.09
448	603650	彤程新材	5,100	157,233.00	0.09
449	002705	新宝股份	9,400	156,510.00	0.09
450	000415	渤海租赁	69,900	154,479.00	0.09
451	688006	杭可科技	3,499	153,151.23	0.08
452	000990	诚志股份	17,200	151,360.00	0.08
453	688819	天能股份	4,100	150,634.00	0.08
454	002925	盈趣科技	8,920	147,358.40	0.08
455	300869	康泰医学	4,500	146,565.00	0.08
456	600307	酒钢宏兴	87,800	144,870.00	0.08
457	601828	美凯龙	30,600	143,514.00	0.08

458	002242	九阳股份	8,626	142,156.48	0.08
459	603638	艾迪精密	9,520	142,038.40	0.08
460	600339	中油工程	47,000	140,060.00	0.08
461	600764	中国海防	6,000	137,760.00	0.08
462	000031	大悦城	36,000	135,360.00	0.07
463	002399	海普瑞	10,500	134,925.00	0.07
464	600623	华谊集团	21,300	134,616.00	0.07
465	002653	海思科	6,000	133,500.00	0.07
466	002146	荣盛发展	61,500	133,455.00	0.07
467	600928	西安银行	37,300	131,296.00	0.07
468	601969	海南矿业	17,200	127,452.00	0.07
469	688088	虹软科技	5,600	126,056.00	0.07
470	600648	外高桥	10,500	125,475.00	0.07
471	603719	良品铺子	3,400	125,358.00	0.07
472	600006	东风汽车	22,400	124,992.00	0.07
473	600787	中储股份	24,800	123,256.00	0.07
474	002563	森马服饰	22,800	119,472.00	0.07
475	000961	中南建设	54,200	118,698.00	0.07
476	000869	张裕 A	3,800	114,912.00	0.06
477	600377	宁沪高速	13,900	114,258.00	0.06
478	000553	安道麦 A	12,300	111,315.00	0.06
479	601869	长飞光纤	3,400	110,942.00	0.06
480	601298	青岛港	19,700	110,517.00	0.06
481	600350	山东高速	19,000	108,110.00	0.06
482	000062	深圳华强	8,810	107,570.10	0.06
483	601139	深圳燃气	16,200	105,948.00	0.06
484	002945	华林证券	7,600	100,168.00	0.06
485	601228	广州港	30,100	94,815.00	0.05
486	001872	招商港口	6,600	94,776.00	0.05
487	603868	飞科电器	1,400	94,262.00	0.05
488	600299	安迪苏	11,400	94,164.00	0.05
489	603355	莱克电气	3,260	91,410.40	0.05
490	601158	重庆水务	16,200	83,106.00	0.05
491	600956	新天绿能	8,600	82,904.00	0.05
492	300741	华宝股份	3,500	82,355.00	0.05
493	600927	永安期货	4,500	72,540.00	0.04
494	603786	科博达	1,100	72,413.00	0.04
495	600917	重庆燃气	8,700	69,252.00	0.04
496	002901	大博医疗	2,000	68,060.00	0.04
497	600032	浙江新能	5,900	67,791.00	0.04
498	001227	兰州银行	17,500	65,975.00	0.04
499	688772	珠海冠宇	3,100	57,784.00	0.03

## 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	600096	云天化	1,555,983.00	0.55
2	300769	德方纳米	1,527,769.00	0.54
3	300012	华测检测	1,426,933.00	0.51
4	002497	雅化集团	1,413,826.00	0.50
5	002340	格林美	1,373,018.00	0.49
6	002240	盛新锂能	1,368,529.00	0.48
7	300390	天华超净	1,215,245.00	0.43
8	300073	当升科技	1,176,968.00	0.42
9	002407	多氟多	1,168,919.00	0.41
10	688122	西部超导	1,143,293.81	0.41
11	688180	君实生物	1,115,080.73	0.40
12	002756	永兴材料	1,047,904.00	0.37
13	300003	乐普医疗	1,033,248.00	0.37
14	688777	中控技术	1,032,102.08	0.37
15	601058	赛轮轮胎	1,030,065.00	0.37
16	688063	派能科技	1,028,384.00	0.36
17	002738	中矿资源	950,424.00	0.34
18	601108	财通证券	946,360.00	0.34
19	603345	安井食品	941,321.00	0.33
20	603606	东方电缆	914,873.00	0.32

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	000733	振华科技	1,834,453.00	0.65
2	600256	广汇能源	1,807,152.00	0.64
3	002340	格林美	1,773,924.74	0.63
4	601615	明阳智能	1,624,884.00	0.58
5	600522	中天科技	1,621,711.00	0.57
6	600188	兖矿能源	1,516,576.00	0.54
7	002180	纳思达	1,496,795.00	0.53
8	300751	迈为股份	1,313,870.00	0.47
9	000723	美锦能源	1,263,052.00	0.45
10	601117	中国化学	1,245,033.00	0.44

11	600732	爱旭股份	1,222,521.00	0.43
12	600884	杉杉股份	1,156,552.10	0.41
13	688005	容百科技	1,151,183.42	0.41
14	300769	德方纳米	1,139,032.00	0.40
15	600233	圆通速递	1,116,217.00	0.40
16	000983	山西焦煤	1,104,638.40	0.39
17	601689	拓普集团	1,068,852.40	0.38
18	002240	盛新锂能	1,005,275.00	0.36
19	605358	立昂微	1,003,172.80	0.36
20	300763	锦浪科技	996,804.00	0.35

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	87,308,531.21
卖出股票收入（成交）总额	108,468,639.12

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）	35,000.46	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	35,000.46	0.02

#### 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	118030	睿创转债	350	35,000.46	0.02

**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****8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.11.2 本期国债期货投资评价****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，烟台睿创微纳技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的处罚；烟台睿创微纳技术股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚；浙江中控技术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。

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	2,044.90
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,044.90

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

#### 9.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例（%）	持有份额	占总份额比例（%）
347	398,612.93	136,797,106.00	98.90	1,521,581.00	1.10

### 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	550,720.00	0.40
2	姜晓平	235,683.00	0.17
3	张红艳	197,700.00	0.14
4	陈妙琴	139,373.00	0.10
5	李淑清	69,455.00	0.05
6	钮冰融	46,303.00	0.03
7	刘秀珍	46,303.00	0.03
8	王巍	41,200.00	0.03
9	黄子祺	36,200.00	0.03
10	冯进	27,782.00	0.02
11	中国农业银行股份有限公司—国寿安保中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	136,246,286.00	98.50

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	174,318,687.00
本报告期基金总申购份额	2,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	38,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	138,318,687.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2022 年 8 月 10 日发布公告，王东旭先生自 2022 年 8 月 9 日起任公司副总经理，鄂华先生自 2022 年 8 月 9 日起任公司副总经理。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022 年 3 月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

### 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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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行政监管措施，并对公司相关责任人员采取行政监管措施，公司高度重视，已制定并实施相关整改措施，截至本报告日，公司已完成整改工作并向北京监管局提交了整改报告。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
海通证券	2	123,994,835.84	63.53	115,476.68	63.84	-
中信证券	2	41,633,977.69	21.33	38,769.06	21.43	-
国泰君安	2	26,652,480.85	13.66	24,821.44	13.72	-
中银国际	2	2,894,661.72	1.48	1,827.42	1.01	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》

(证监基字[2007]48号)的有关规定要求, 我公司在比较了多家证券经营机构的财务状况、经营状况、研究水平后, 向多家券商租用了基金专用交易单元。

1、基金专用交易单元的选择标准如下:

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

2、基金专用交易单元的选择程序如下:

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

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位: 人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
海通证券	767,165.73	100.00	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

中金公司	-	-	-	-	-	-
------	---	---	---	---	---	---

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	证监会规定网站及公司网站	2022 年 1 月 24 日
2	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2021 年年度报告	证监会规定网站及公司网站	2022 年 3 月 31 日
3	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 (2022 年第 1 号)	证监会规定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
4	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站及公司网站	2022 年 4 月 2 日
5	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	证监会规定网站及公司网站	2022 年 4 月 22 日
6	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书更新 (2022 年第 2 号)	证监会规定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
7	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定网站及公司网站	2022 年 6 月 2 日
8	国寿安保基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中证报、证监会规定网站及公司网站	2022 年 6 月 20 日
9	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第二季度报告	证监会规定网站及公司网站	2022 年 7 月 21 日
10	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年中期报告	证监会规定网站及公司网站	2022 年 8 月 31 日
11	国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第三季度报告	证监会规定网站及公司网站	2022 年 10 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
其他	1	20220101~20221231	170,286,286.00	1,960,000.00	36,000,000.00	136,246,286.00	98.50

#### 产品特有风险

本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20%的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于

基金的正常运作。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

13.1.1 中国证监会批准国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

13.1.2 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

13.1.3 《国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

13.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

13.1.5 报告期内国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

13.1.6 中国证监会要求的其他文件

### 13.2 存放地点

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

### 13.3 查阅方式

13.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

13.3.2 登录本公司网站查阅基金产品相关信息: [www.gsfunds.com.cn](http://www.gsfunds.com.cn)

13.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日