

国寿安保沪深 300 交易型开放式
指数证券投资基金
2026 年中期报告

2026 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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 28 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 2026 年 01 月 01 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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 其他指标	7
§ 4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
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	11
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	36
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	45
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	45

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 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	46
§ 8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 盈利投资者数量占比	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	47
8.4 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.....	47
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	48
10.1 基金份额持有人大会决议	48
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.....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况.....	49
10.8 其他重大事件	50
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	50
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	50
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国寿安保沪深 300ETF
场内简称	沪深 300ETF 国寿
基金主代码	510380
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 1 月 19 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	1,242,802,400.00 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	2018 年 2 月 7 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属股票型基金，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似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	韩占锋	任航
	联系电话	010-50850888	010-66060069
	电子邮箱	service@gsfunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4009-258-258	95599
传真		010-50850777	010-68121816
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市东城区建国门内大街 69 号
办公地址		北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层	北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座 F9

邮政编码	100033	100031
法定代表人	于泳	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gsfunds.com.cn
基金中期报告置备地点	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	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	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	243,177,420.87
本期利润	156,298,233.33
加权平均基金份额本期利润	0.1286
本期加权平均净值利润率	9.16%
本期基金份额净值增长率	8.52%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	601,815,070.51
期末可供分配基金份额利润	0.4842
期末基金资产净值	1,844,617,470.51
期末基金份额净值	1.4842
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	48.42%

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。

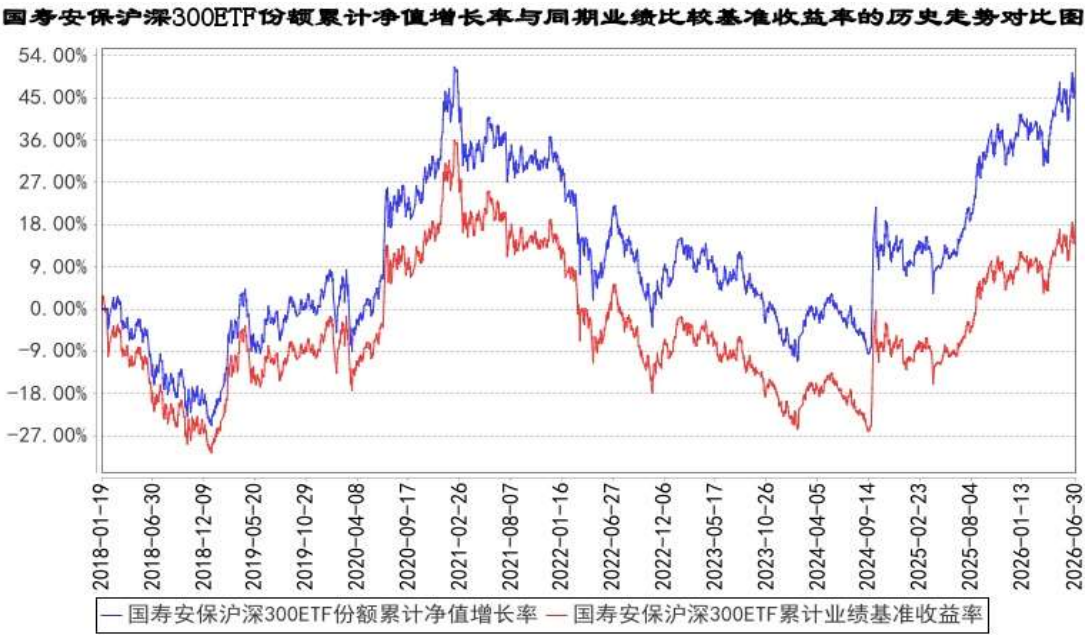
3.2 基金净值表现

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	12.82 %	1.24 %	11.90 %	1.26 %	0.92 %	-0.02 %

过去六个月	8.52 %	1.12 %	7.55 %	1.13 %	0.97 %	-0.01 %
过去一年	29.64 %	1.01 %	26.51 %	1.02 %	3.13 %	-0.01 %
过去三年	39.52 %	1.11 %	29.59 %	1.11 %	9.93 %	0.00 %
过去五年	7.10 %	1.11 %	-4.68 %	1.12 %	11.78 %	-0.01 %
过去七年	51.87 %	1.16 %	30.16 %	1.17 %	21.71 %	-0.01 %
自基金合同生效起至今	48.42 %	1.20 %	16.58 %	1.22 %	31.84 %	-0.02 %

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



注：本基金基金合同生效日为 2018 年 01 月 19 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 2018 年 01 月 19 日至 2026 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%，National Mutual Funds Management Ltd.（国家共同基金管理有限公司），其持有股份 14.97%。

截至 2026 年 06 月 30 日，公司共管理 107 只公募证券投资基金和部分私募资产管理计划。

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	2018 年 1 月 19 日	-	17 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、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 A500 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 800 指数增强型证券投资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或本基金管理人对外披露的任职日期。证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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。

本基金管理人于每季度和年度对公司管理的不同投资组合进行了同向交易价差分析，采用了日内、3 日内、5 日内的时间窗口，假设不同组合间价差为零，进行了 T 分布检验。经分析，本报告期未发现本基金管理人管理的不同投资组合间有同向交易价差异异常的情况。

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

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、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

截至本报告期末本基金份额净值为 1.4842 元，本报告期基金份额净值增长率为 8.52%，业绩比较基准收益率为 7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年 A 股市场呈现极致结构化，科创 50 上涨 64.25%，创业板指上涨 35.58%，半导体、电子与通信行业分别大涨 106.20%、86.29% 和 73.59%，但全市场仅约三成份股上涨，沪深 300 上涨 7.55%，与此同时上证 50 下跌 1.38%。宏观经济方面，国内 GDP 上半年同比增长 4.7%，其中一季度 5.0%、二季度回落至 4.3%，总量承压但价格端出

现积极变化，GDP 平减指数近十三个季度以来首次转正，PPI 由负转正，上半年累计上涨 1.5%。六月制造业 PMI 回升至 50.3%，连续四个月保持在扩张区间，高技术制造业增加值同比增长 13.3%，集成电路产量同比增长 23.1%，新动能以两成多的增加值占比贡献了近五成的工业增长，成为经济转型的核心动能。但内需复苏基础尚不牢固，上半年社零累计仅增长 1.3%，且六月当月同比滑落至 1.0%，地产投资上半年累计下降 18.0%，消费与地产仍是主要拖累。产业政策层面，科技仍然是主要抓手，“十五五”规划纲要对培育壮大新兴产业和未来产业作出专门部署，提出前瞻布局量子科技、生物制造、氢能、脑机接口和具身智能等未来产业。国常会明确将推进新型工业化作为长期战略任务，坚持智能化、绿色化、融合化方向，强调要加力推进人工智能创新突破，加快关键技术攻关和超大规模智算集群建设，深入实施“人工智能+”行动。政策已从技术突破转向全链条协同布局。货币政策方面，LPR 连续保持不变，央行保持较强政策定力。外部环境方面，美联储加息预期升温压制市场风险偏好，东欧与中东地缘冲突反复加剧供应链风险忧虑，油价成为全球通胀与货币政策路径的一个关键变量。展望下半年，市场核心特征可能由上半年的估值扩张转向业绩验证，业绩兑现确定性强的硬核科技板块的较高估值有望通过盈利上行逐步消化，企业盈利增长逐步带动居民收入和消费提升，经济稳中向好背景下消费、医药和红利等低位板块存在修复机会。整体而言，中国经济正处于新旧动能加速切换的关键期，科技主线明确但需关注阶段性交易拥挤风险，消费红利等低估价值板块具备中长期配置价值。

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、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历。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。

4.7 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。

4.8 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

本报告期内，中国农业银行股份有限公司（以下简称“本基金托管人”）在本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，对本基金的投资运作情况进行了必要的监督，对本基金的基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支、利润分配等方面进行了复核，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

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

本基金托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律、法规的规定和基金合同、托管协议的约定，以自身能够获取的数据和信息为限，对本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行核查，以上内容真实、准确、完整。

§ 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： 国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	17,993,998.11	13,365,093.08
结算备付金		553,257.66	17,797.00
存出保证金		620,107.66	57,253.68
交易性金融资产	6.4.7.2	1,828,129,624.20	2,287,773,950.24
其中：股票投资		1,828,129,624.20	2,287,773,950.24
基金投资		-	-
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		13,846,924.65	28,018,420.20
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		1,861,143,912.28	2,329,232,514.20
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 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		15,349,788.00	29,214,669.37
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		710,771.97	800,253.83
应付托管费		142,154.38	160,050.79
应付销售服务费		-	-
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	323,727.42	271,936.94

负债合计		16,526,441.77	30,446,910.93
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	1,242,802,400.00	1,680,802,400.00
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	601,815,070.51	617,983,203.27
净资产合计		1,844,617,470.51	2,298,785,603.27
负债和净资产总计		1,861,143,912.28	2,329,232,514.20

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.4842 元，基金份额总额 1,242,802,400.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		161,457,091.08	26,692,562.23
1. 利息收入		26,539.51	29,059.07
其中：存款利息收入	6.4.7.13	26,539.51	29,059.07
债券利息收入		-	-
资产支持证券利 息收入		-	-
买入返售金融资 产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		247,126,722.00	33,506,367.81
其中：股票投资收益	6.4.7.14	229,602,088.89	11,786,341.35
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	35,914.47
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	17,524,633.11	21,684,111.99
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）	6.4.7.20	-86,879,187.54	-7,258,437.73

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. 21	1, 183, 017. 11	415, 573. 08
减：二、营业总支出		5, 158, 857. 75	5, 178, 322. 52
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	4, 219, 953. 21	4, 147, 146. 02
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	843, 990. 62	829, 429. 21
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	-	-
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. 22	-	-
7. 税金及附加		-	0. 08
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	94, 913. 92	201, 747. 21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		156, 298, 233. 33	21, 514, 239. 71
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		156, 298, 233. 33	21, 514, 239. 71
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		156, 298, 233. 33	21, 514, 239. 71

6.3 净资产变动表

会计主体：国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	1, 680, 802, 400. 00	-	617, 983, 203. 27	2, 298, 785, 603. 27
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1, 680, 802, 400. 00	-	617, 983, 203. 27	2, 298, 785, 603. 27
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-438, 000, 000. 00	-	-16, 168, 132. 76	-454, 168, 132. 76
（一）、综合收益总额	-	-	156, 298, 233. 33	156, 298, 233. 33

（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-438,000,000.00	-	-172,466,366.09	-610,466,366.09
其中：1. 基金申购款	501,000,000.00	-	200,924,142.32	701,924,142.32
2. 基金赎回款	-939,000,000.00	-	-373,390,508.41	-1,312,390,508.41
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,242,802,400.00	-	601,815,070.51	1,844,617,470.51
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	1,599,802,400.00	-	208,363,575.90	1,808,165,975.90
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,599,802,400.00	-	208,363,575.90	1,808,165,975.90
三、本期增减变动金额（减少以“-”号填列）	-180,000,000.00	-	-2,571,976.63	-182,571,976.63
（一）、综合收益总额	-	-	21,514,239.71	21,514,239.71
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-180,000,000.00	-	-24,086,216.34	-204,086,216.34
其中：1. 基金申购款	33,000,000.00	-	3,340,681.62	36,340,681.62
2. 基金赎回款	-213,000,000.00	-	-27,426,897.96	-240,426,897.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,419,802,400.00	-	205,791,599.27	1,625,593,999.27

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：

刘忠江
基金管理人负责人

王文英
主管会计工作负责人

于晓树
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]2166 号《关于准予国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,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 294,788,000.00 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(2018)验字第 61090605_A01 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 1 月 19 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 294,802,400.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 14,400.00 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[2018]19 号文审核同意,本基金 294,802,400.00 份基金份额于 2018 年 2 月 7 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《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股、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)、衍生工具(权证等)、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、中小企业私募债、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%,权证及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:沪深 300 指数。

本基金的基金管理人国寿安保基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,募集成立了国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国寿安保

沪深 300ETF 联接基金”)。国寿安保沪深 300ETF 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。

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、《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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的《公开募集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》《证券投资基金会计核算业务指引》、《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注中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。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策和会计估计与上年度会计报表相一致。

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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金管理人为增值税纳税人。本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对除持有金融债券外的金融同业往来取得的利息收入免征增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对本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) 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对本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。对本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) 本基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳

增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	17,993,998.11
等于：本金	17,992,600.28
加：应计利息	1,397.83
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	17,993,998.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,542,374,644.03	-	1,828,129,624.20	285,754,980.17
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		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,542,374,644.03	-	1,828,129,624.20	285,754,980.17

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 2026 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	239,028.47
其中：交易所市场	239,028.47
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,698.95
合计	323,727.42

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,680,802,400.00	1,680,802,400.00
本期申购	501,000,000.00	501,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-939,000,000.00	-939,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,242,802,400.00	1,242,802,400.00

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	826,389,632.04	-208,406,428.77	617,983,203.27
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	826,389,632.04	-208,406,428.77	617,983,203.27
本期利润	243,177,420.87	-86,879,187.54	156,298,233.33
本期基金份额交易产生的变动数	-220,633,631.79	48,167,265.70	-172,466,366.09
其中：基金申购款	322,850,015.02	-121,925,872.70	200,924,142.32
基金赎回款	-543,483,646.81	170,093,138.40	-373,390,508.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	848,933,421.12	-247,118,350.61	601,815,070.51

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	23,256.83
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	2,446.39
其他	836.29
合计	26,539.51

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	117,039,406.71
股票投资收益——赎回差价收入	112,562,682.18
股票投资收益——申购差价收入	—
股票投资收益——证券出借差价收入	—
合计	229,602,088.89

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出股票成交总额	722,930,653.25
减：卖出股票成本总额	605,212,506.88
减：交易费用	678,739.66
买卖股票差价收入	117,039,406.71

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
赎回基金份额对价总额	1,312,390,508.41
减：现金支付赎回款总额	525,563,437.41
减：赎回股票成本总额	674,264,388.82
减：交易费用	—
赎回差价收入	112,562,682.18

6.4.7.15 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	17,524,633.11
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	17,524,633.11

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-86,879,187.54
股票投资	-86,879,187.54
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	-86,879,187.54

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,183,017.11
合计	1,183,017.11

注：替代损益收入是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	25,191.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	10,214.97
合计	94,913.92

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

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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	基金管理人
农业银行	基金托管人
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
国家共同基金管理有限公司（简称“国家共同基金”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	基金管理人的最终控制人
中国人寿保险股份有限公司（简称“中国人寿”）	与基金管理人同受集团公司控制的公司
国寿财富管理有限公司（简称“国寿财富”）	基金管理人的子公司
国寿安保沪深 300ETF 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。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,219,953.21	4,147,146.02
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,433.72	2,258.63
应支付基金管理人的净管理费	4,217,519.49	4,144,887.39

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	843,990.62	829,429.21

注：基金托管费每日计提，按月支付。本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10%的年费率计提。计算方法如下：

$$H=E\times 0.10\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

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

本基金于本报告期及上年度可比期间均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。

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。

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固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固有资金投资本基金。

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

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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（%）
国寿安保沪深 300ETF联接基金	910,000,000.00	73.22	1,201,000,000.00	71.45
中国人寿	217,859,100.00	17.53	-	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 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	17,993,998.11	23,256.83	15,334,262.67	28,349.60

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。

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。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2026 年 06 月 30 日，本基金持有 1,851,100.00 股农业银行的 A 股普通股，占基金资产净值的比例为 0.61%。本基金持有 107,600.00 股中国人寿的 A 股普通股，占基金资产净值的比例为 0.21%。（于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有 2,599,100.00 股农业银行的 A 股普通股，占基金资产净值的比例为 0.87%。本基金持有 151,600.00 股中国人寿的 A 股普通股，占基金资产净值的比例为 0.3%。）

6.4.11 利润分配情况

本基金于本报告期间未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 个月	新股流通受限	10.11	10.11	51,926	524,971.86	524,971.86	-
001248	华润新能源	2026 年 6 月 24 日	6 日	新股未上市	10.11	10.11	22,253	224,977.83	224,977.83	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月	6 个月	新股流	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-

		月 16 日		通受限						
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
603293	埃泰克	2026 年 4 月 9 日	6 个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
603352	至信股份	2026 年 1 月 8 日	6 个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	9 个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	83.06	126.45	2,319	192,616.14	293,237.55	-
688795	摩尔线程	2025 年 11 月 26 日	9 个月	新股流通受限	114.28	676.94	6,989	798,702.92	4,731,133.66	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	9 个月	新股流通受限	104.66	768.89	3,994	418,012.04	3,070,946.66	-
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,237	44,024.16	316,513.13	-
--------	------	-----------------	------	--------	-------	--------	-------	-----------	------------	---

6.4.12.2 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
688072	拓荆科技	2026 年 6 月 29 日	重大事项停牌	832.00	2026 年 7 月 13 日	890.99	11,000	7,366,508.00	9,152,000.00	-

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董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会负责公司整体风险的预防和控制，确定公司风险战略，审核、监督公司风险控制制度的有效执行，对有效的风险管理承担最终责任。董事会下设风险管理委员会，负责对公司经营管理和基金业务运作的风险控制及合法合规性进行审议、监督和检查。管理层对有效的风险管理承担直接责任，保证风险管理体系的持续有效运转，使公司风险管理的战略和政策要求及其各方面的具体工作落到实处。公司设督察长一名，负责牵头开展风险管理工作，监督检查公司内部风险控制情况，参与各项决策的风险评估及审批。公司设立合规管理部、监察稽核部两个独立的风险管理职能部门，由督察长领导，对督察长负责，并向督察长汇报工作。

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，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。

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

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 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未来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 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	17,993,998.11	-	-	-	17,993,998.11
结算备付金	553,257.66	-	-	-	553,257.66
存出保证金	620,107.66	-	-	-	620,107.66
交易性金融资产	-	-	-	1,828,129,624.20	1,828,129,624.20
应收清算款	-	-	-	13,846,924.65	13,846,924.65
资产总计	19,167,363.43	-	-	1,841,976,548.85	1,861,143,912.28
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	710,771.97	710,771.97
应付托管费	-	-	-	142,154.38	142,154.38
应付清算款	-	-	-	15,349,788.00	15,349,788.00
其他负债	-	-	-	323,727.42	323,727.42
负债总计	-	-	-	16,526,441.77	16,526,441.77
利率敏感度缺口	19,167,363.43	-	-	1,825,450,107.08	1,844,617,470.51
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,365,093.08	-	-	-	13,365,093.08
结算备付金	17,797.00	-	-	-	17,797.00
存出保证金	57,253.68	-	-	-	57,253.68
交易性金融资产	-	-	-	2,287,773,950.24	2,287,773,950.24
应收清算款	-	-	-	28,018,420.20	28,018,420.20
资产总计	13,440,143.76	-	-	2,315,792,370.44	2,329,232,514.20
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	800,253.83	800,253.83
应付托管费	-	-	-	160,050.79	160,050.79
应付清算款	-	-	-	29,214,669.37	29,214,669.37
其他负债	-	-	-	271,936.94	271,936.94
负债总计	-	-	-	30,446,910.93	30,446,910.93
利率敏感度缺口	13,440,143.76	-	-	2,285,345,459.51	2,298,785,603.27

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 2026 年 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资和资产支持证券（2025 年 12 月 31 日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2025 年 12 月 31 日：同）。

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。

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。本基金主要投资于标的指数成分股、备选成分股，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。

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，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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	1,828,129,624.20	99.11	2,287,773,950.24	99.52
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	1,828,129,624.20	99.11	2,287,773,950.24	99.52

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 系数是报告期内所有交易日的基金资产净值和基准指数数据回归得出，反映了基金和基准的相关性。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	+5%	91,171,376.99	114,454,447.56
	-5%	-91,171,376.99	-114,454,447.56

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	1,808,131,732.48	2,269,322,084.02
第二层次	9,901,949.69	13,180,390.76
第三层次	10,095,942.03	5,271,475.46
合计	1,828,129,624.20	2,287,773,950.24

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 2026 年 06 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(2025 年 12 月 31 日：同)。

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	1,828,129,624.20	98.23
	其中：股票	1,828,129,624.20	98.23
2	基金投资	—	—
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	18,547,255.77	1.00
8	其他各项资产	14,467,032.31	0.78
9	合计	1,861,143,912.28	100.00

注：股票资产含可退替代款估值增值。

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	10,370,492.10	0.56
B	采矿业	76,317,002.87	4.14
C	制造业	1,174,352,252.92	63.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,001,374.87	2.49
E	建筑业	20,783,935.40	1.13
F	批发和零售业	2,690,535.08	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	44,101,317.56	2.39
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	96,719,386.88	5.24
J	金融业	319,153,161.69	17.30
K	房地产业	5,935,157.00	0.32

L	租赁和商务服务业	8,337,661.81	0.45
M	科学研究和技术服务业	19,845,897.92	1.08
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	-	-
Q	卫生和社会工作	2,476,637.10	0.13
R	文化、体育和娱乐业	1,043,569.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	1,828,128,382.20	99.11

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	300308	中际旭创	72,040	91,490,800.00	4.96
2	300750	宁德时代	170,260	66,913,882.60	3.63
3	300502	新易盛	89,736	54,469,752.00	2.95
4	600519	贵州茅台	40,318	47,796,585.82	2.59
5	603986	兆易创新	42,989	35,036,035.00	1.90
6	601318	中国平安	686,807	32,788,166.18	1.78
7	688256	寒武纪	19,928	31,796,120.40	1.72
8	600036	招商银行	797,076	28,296,198.00	1.53
9	601899	紫金矿业	1,061,586	26,688,272.04	1.45
10	002371	北方华创	28,050	24,811,908.00	1.35
11	000333	美的集团	313,500	23,678,655.00	1.28
12	002475	立讯精密	328,405	23,119,712.00	1.25
13	688008	澜起科技	74,033	22,942,826.70	1.24
14	688041	海光信息	60,200	22,292,060.00	1.21
15	688012	中微公司	47,500	22,253,750.00	1.21
16	002384	东山精密	82,600	21,670,110.00	1.17
17	600900	长江电力	788,040	20,859,418.80	1.13
18	688981	中芯国际	130,000	20,646,600.00	1.12
19	000725	京东方 A	2,341,900	20,327,692.00	1.10
20	603259	药明康德	159,392	19,845,897.92	1.08
21	601138	工业富联	255,400	18,427,110.00	1.00
22	601166	兴业银行	1,090,625	18,060,750.00	0.98
23	600030	中信证券	628,545	18,058,097.85	0.98
24	300059	东方财富	815,290	16,615,610.20	0.90
25	600183	生益科技	93,500	16,212,900.00	0.88

26	600276	恒瑞医药	287,628	14,968,161.12	0.81
27	300274	阳光电源	93,420	14,855,648.40	0.81
28	601398	工商银行	2,084,100	14,734,587.00	0.80
29	300408	三环集团	86,300	14,403,470.00	0.78
30	002594	比亚迪	174,878	13,937,776.60	0.76
31	300476	胜宏科技	39,400	13,649,342.00	0.74
32	002463	沪电股份	86,700	13,247,760.00	0.72
33	601211	国泰海通	727,891	13,247,616.20	0.72
34	300394	天孚通信	42,124	12,750,092.32	0.69
35	000988	华工科技	63,200	11,667,352.00	0.63
36	600176	中国巨石	154,723	11,276,212.24	0.61
37	601288	农业银行	1,851,100	11,236,177.00	0.61
38	301308	江波龙	15,700	11,049,660.00	0.60
39	601328	交通银行	1,717,900	11,046,097.00	0.60
40	000651	格力电器	288,514	10,819,275.00	0.59
41	600522	中天科技	175,700	10,661,476.00	0.58
42	600919	江苏银行	945,500	10,192,490.00	0.55
43	603019	中科曙光	94,094	10,089,699.62	0.55
44	603993	洛阳钼业	562,900	9,878,895.00	0.54
45	600150	中国船舶	290,806	9,826,334.74	0.53
46	600887	伊利股份	407,701	9,768,515.96	0.53
47	688521	芯原股份	26,000	9,649,640.00	0.52
48	600584	长电科技	91,900	9,516,245.00	0.52
49	000338	潍柴动力	346,080	9,430,680.00	0.51
50	000858	五粮液	124,901	9,242,674.00	0.50
51	688072	拓荆科技	11,000	9,152,000.00	0.50
52	601816	京沪高铁	1,891,200	8,567,136.00	0.46
53	600309	万华化学	120,998	8,277,473.18	0.45
54	002916	深南电路	17,890	8,191,831.00	0.44
55	300124	汇川技术	122,050	8,095,576.50	0.44
56	002415	海康威视	236,200	8,078,040.00	0.44
57	600111	北方稀土	163,100	7,836,955.00	0.42
58	601688	华泰证券	376,560	7,764,667.20	0.42
59	000100	TCL 科技	1,321,750	7,692,585.00	0.42
60	000063	中兴通讯	207,400	7,505,806.00	0.41
61	600000	浦发银行	858,298	7,389,945.78	0.40
62	600089	特变电工	325,700	7,328,250.00	0.40
63	601857	中国石油	832,700	7,227,836.00	0.39
64	002028	思源电气	40,100	6,937,300.00	0.38
65	601088	中国神华	177,462	6,928,116.48	0.38
66	300433	蓝思科技	128,299	6,884,524.34	0.37
67	600031	三一重工	382,100	6,602,688.00	0.36
68	300014	亿纬锂能	97,500	6,340,425.00	0.34

69	002050	三花智控	144,438	6,330,717.54	0.34
70	002142	宁波银行	212,550	6,310,609.50	0.34
71	601601	中国太保	220,309	6,283,212.68	0.34
72	000001	平安银行	624,600	6,277,230.00	0.34
73	000792	盐湖股份	204,400	6,170,836.00	0.33
74	002714	牧原股份	175,790	6,150,892.10	0.33
75	600406	国电南瑞	258,574	5,908,415.90	0.32
76	002353	杰瑞股份	38,500	5,871,250.00	0.32
77	600549	厦门钨业	67,900	5,785,080.00	0.31
78	601668	中国建筑	1,330,900	5,776,106.00	0.31
79	601229	上海银行	640,835	5,562,447.80	0.30
80	000657	中钨高新	56,800	5,436,896.00	0.29
81	601919	中远海控	404,580	5,364,730.80	0.29
82	300760	迈瑞医疗	39,100	5,310,953.00	0.29
83	601988	中国银行	922,400	5,276,128.00	0.29
84	601939	建设银行	546,000	5,257,980.00	0.29
85	600660	福耀玻璃	103,600	5,225,584.00	0.28
86	002602	世纪华通	369,100	5,204,310.00	0.28
87	601728	中国电信	1,000,600	5,193,114.00	0.28
88	603501	豪威集团	54,378	5,157,753.30	0.28
89	600016	民生银行	1,599,500	5,150,390.00	0.28
90	601012	隆基绿能	391,068	5,130,812.16	0.28
91	601225	陕西煤业	249,800	5,083,430.00	0.28
92	002230	科大讯飞	124,100	5,068,244.00	0.27
93	600999	招商证券	238,950	5,041,845.00	0.27
94	600941	中国移动	57,967	4,992,697.71	0.27
95	600690	海尔智家	241,812	4,935,382.92	0.27
96	002352	顺丰控股	154,800	4,839,048.00	0.26
97	601985	中国核电	529,600	4,782,288.00	0.26
98	002460	赣锋锂业	72,930	4,769,622.00	0.26
99	688795	摩尔线程	6,989	4,731,133.66	0.26
100	300033	同花顺	19,625	4,729,625.00	0.26
101	002709	天赐材料	91,900	4,726,417.00	0.26
102	600926	杭州银行	326,966	4,724,658.70	0.26
103	002938	鹏鼎控股	44,800	4,721,024.00	0.26
104	603799	华友钴业	97,726	4,716,256.76	0.26
105	601169	北京银行	953,924	4,674,227.60	0.25
106	000977	浪潮信息	66,441	4,650,870.00	0.25
107	600160	巨化股份	87,021	4,612,983.21	0.25
108	000776	广发证券	190,200	4,450,680.00	0.24
109	300442	润泽科技	52,700	4,377,789.00	0.24
110	000425	徐工机械	529,600	4,284,464.00	0.23
111	688126	沪硅产业	106,900	4,264,241.00	0.23

112	300498	温氏股份	342,500	4,219,600.00	0.23
113	601600	中国铝业	510,400	4,195,488.00	0.23
114	600938	中国海油	154,300	4,189,245.00	0.23
115	600028	中国石化	938,100	4,183,926.00	0.23
116	000938	紫光股份	144,718	4,176,561.48	0.23
117	600460	士兰微	75,000	4,099,500.00	0.22
118	002466	天齐锂业	66,800	4,096,176.00	0.22
119	601766	中国中车	784,300	4,078,360.00	0.22
120	300661	圣邦股份	28,158	4,040,109.84	0.22
121	600050	中国联通	1,008,200	4,032,800.00	0.22
122	002600	领益智造	232,200	4,026,348.00	0.22
123	002202	金风科技	165,300	3,950,670.00	0.21
124	601009	南京银行	398,401	3,940,185.89	0.21
125	688082	盛美上海	9,100	3,931,200.00	0.21
126	002049	紫光国微	43,816	3,888,670.00	0.21
127	002837	英维克	47,900	3,810,924.00	0.21
128	601628	中国人寿	107,600	3,803,660.00	0.21
129	002179	中航光电	81,814	3,779,806.80	0.20
130	601100	恒立液压	34,618	3,723,512.08	0.20
131	000568	泸州老窖	47,300	3,666,696.00	0.20
132	601872	招商轮船	208,500	3,663,345.00	0.20
133	002241	歌尔股份	160,000	3,604,800.00	0.20
134	603288	海天味业	107,615	3,568,513.40	0.19
135	601006	大秦铁路	769,100	3,545,551.00	0.19
136	000408	藏格矿业	50,500	3,500,660.00	0.19
137	601658	邮储银行	710,000	3,500,300.00	0.19
138	605117	德业股份	32,907	3,494,065.26	0.19
139	601818	光大银行	1,197,000	3,459,330.00	0.19
140	600809	山西汾酒	31,598	3,455,873.26	0.19
141	600905	三峡能源	922,400	3,422,104.00	0.19
142	688396	华润微	34,900	3,404,495.00	0.18
143	601888	中国中免	63,151	3,391,840.21	0.18
144	600489	中金黄金	187,600	3,386,180.00	0.18
145	002625	光启技术	111,100	3,368,552.00	0.18
146	600893	航发动力	86,000	3,297,240.00	0.18
147	000630	铜陵有色	518,300	3,296,388.00	0.18
148	688271	联影医疗	32,400	3,279,852.00	0.18
149	600010	宝钢股份	1,457,140	3,249,422.20	0.18
150	601127	赛力斯	52,500	3,215,625.00	0.17
151	601336	新华保险	53,600	3,197,776.00	0.17
152	600958	东方证券	336,656	3,178,032.64	0.17
153	601689	拓普集团	55,905	3,154,160.10	0.17
154	002027	分众传媒	650,940	3,150,549.60	0.17

155	688111	金山办公	14,757	3,143,978.85	0.17
156	688802	沐曦股份	3,994	3,070,946.66	0.17
157	600019	宝钢股份	562,096	3,052,181.28	0.17
158	600118	中国卫星	37,000	3,035,850.00	0.16
159	600760	中航沈飞	72,896	2,996,025.60	0.16
160	000807	云铝股份	133,800	2,962,332.00	0.16
161	600362	江西铜业	67,100	2,905,430.00	0.16
162	601838	成都银行	163,800	2,899,260.00	0.16
163	600104	上汽集团	295,837	2,887,369.12	0.16
164	600989	宝丰能源	141,700	2,880,761.00	0.16
165	002001	新和成	99,000	2,813,580.00	0.15
166	600875	东方电气	97,700	2,810,829.00	0.15
167	300450	先导智能	68,900	2,805,608.00	0.15
168	601825	沪农商行	371,900	2,785,531.00	0.15
169	002422	科伦药业	72,000	2,773,440.00	0.15
170	601727	上海电气	395,800	2,770,600.00	0.15
171	601390	中国中铁	660,300	2,753,451.00	0.15
172	603296	华勤技术	36,768	2,730,759.36	0.15
173	688183	生益电子	20,600	2,727,440.00	0.15
174	601995	中金公司	75,400	2,725,710.00	0.15
175	000538	云南白药	57,341	2,716,243.17	0.15
176	601377	兴业证券	445,250	2,689,310.00	0.15
177	600547	山东黄金	116,332	2,686,105.88	0.15
178	600795	国电电力	573,900	2,680,113.00	0.15
179	600585	海螺水泥	154,954	2,626,470.30	0.14
180	603893	瑞芯微	13,900	2,618,204.00	0.14
181	600015	华夏银行	409,633	2,617,554.87	0.14
182	601669	中国电建	554,824	2,607,672.80	0.14
183	000166	申万宏源	581,700	2,559,480.00	0.14
184	601916	浙商银行	972,000	2,556,360.00	0.14
185	300316	晶盛机电	42,300	2,554,920.00	0.14
186	002648	卫星化学	108,720	2,553,832.80	0.14
187	300015	爱尔眼科	299,835	2,476,637.10	0.13
188	601698	中国卫通	81,300	2,459,325.00	0.13
189	600346	恒力石化	136,120	2,410,685.20	0.13
190	601868	中国能建	902,300	2,409,141.00	0.13
191	600482	中国动力	73,300	2,404,240.00	0.13
192	601066	中信建投	82,000	2,383,740.00	0.13
193	601998	中信银行	341,400	2,365,902.00	0.13
194	002311	海大集团	52,900	2,359,869.00	0.13
195	300418	昆仑万维	57,700	2,328,772.00	0.13
196	600066	宇通客车	85,600	2,294,936.00	0.12
197	002558	巨人网络	83,100	2,290,236.00	0.12

198	000625	长安汽车	319,310	2,289,452.70	0.12
199	600426	华鲁恒升	95,400	2,281,968.00	0.12
200	000157	中联重科	319,800	2,229,006.00	0.12
201	688036	传音控股	37,600	2,216,520.00	0.12
202	605499	东鹏饮料	17,761	2,192,240.23	0.12
203	300803	指南针	23,800	2,181,746.00	0.12
204	002532	天山铝业	202,800	2,176,044.00	0.12
205	600221	海航控股	1,611,600	2,175,660.00	0.12
206	600011	华能国际	283,882	2,154,664.38	0.12
207	600436	片仔癀	19,640	2,146,259.20	0.12
208	600048	保利发展	461,200	2,135,356.00	0.12
209	600438	通威股份	173,700	2,103,507.00	0.11
210	601077	渝农商行	342,000	2,089,620.00	0.11
211	600115	中国东航	547,700	2,086,737.00	0.11
212	002236	大华股份	126,100	2,079,389.00	0.11
213	002493	荣盛石化	193,050	2,075,287.50	0.11
214	600886	国投电力	155,200	2,065,712.00	0.11
215	600570	恒生电子	97,225	2,060,197.75	0.11
216	600188	兖矿能源	115,345	2,049,680.65	0.11
217	003816	中国广核	505,900	1,978,069.00	0.11
218	002736	国信证券	197,900	1,977,021.00	0.11
219	688047	龙芯中科	12,712	1,966,165.04	0.11
220	601360	三六零	225,600	1,960,464.00	0.11
221	601058	赛轮轮胎	169,500	1,954,335.00	0.11
222	000301	东方盛虹	170,400	1,951,080.00	0.11
223	600026	中远海能	107,500	1,928,550.00	0.10
224	002074	国轩高科	69,700	1,917,447.00	0.10
225	601901	方正证券	265,094	1,908,676.80	0.10
226	600009	上海机场	80,263	1,854,075.30	0.10
227	600196	复星医药	81,800	1,838,046.00	0.10
228	000768	中航西飞	89,300	1,828,864.00	0.10
229	000975	山金国际	107,400	1,825,800.00	0.10
230	601788	光大证券	126,000	1,818,180.00	0.10
231	601111	中国国航	298,100	1,803,505.00	0.10
232	600029	南方航空	347,318	1,799,107.24	0.10
233	600415	小商品城	176,700	1,795,272.00	0.10
234	600674	川投能源	126,000	1,785,420.00	0.10
235	601456	国联民生	201,100	1,777,724.00	0.10
236	600219	南山铝业	442,800	1,766,772.00	0.10
237	601881	中国银河	139,900	1,758,543.00	0.10
238	601186	中国铁建	295,500	1,758,225.00	0.10
239	601877	正泰电器	69,500	1,742,365.00	0.09
240	600233	圆通速递	110,600	1,741,950.00	0.09

241	601117	中国化学	236,300	1,736,805.00	0.09
242	301269	华大九天	14,400	1,719,648.00	0.09
243	301236	软通动力	40,000	1,698,000.00	0.09
244	600372	中航机载	155,800	1,690,430.00	0.09
245	601878	浙商证券	176,600	1,677,700.00	0.09
246	002920	德赛西威	19,500	1,589,250.00	0.09
247	000963	华东医药	56,359	1,584,815.08	0.09
248	600741	华域汽车	101,400	1,573,728.00	0.09
249	688506	百利天恒	5,208	1,531,308.24	0.08
250	000895	双汇发展	67,300	1,507,520.00	0.08
251	001979	招商蛇口	232,100	1,492,403.00	0.08
252	300866	安克创新	14,200	1,483,900.00	0.08
253	002304	洋河股份	38,800	1,480,220.00	0.08
254	601021	春秋航空	31,653	1,442,743.74	0.08
255	601898	中煤能源	118,200	1,439,676.00	0.08
256	601319	中国人保	205,900	1,391,884.00	0.08
257	600023	浙能电力	258,900	1,361,814.00	0.07
258	600039	四川路桥	167,980	1,313,603.60	0.07
259	601800	中国交建	228,900	1,307,019.00	0.07
260	000002	万科 A	438,600	1,298,256.00	0.07
261	688223	晶科能源	265,000	1,258,750.00	0.07
262	600588	用友网络	132,251	1,214,064.18	0.07
263	601633	长城汽车	80,400	1,213,236.00	0.07
264	600600	青岛啤酒	23,000	1,201,290.00	0.07
265	001965	招商公路	130,900	1,199,044.00	0.07
266	603369	今世缘	48,300	1,145,193.00	0.06
267	600027	华电国际	254,800	1,133,860.00	0.06
268	601618	中国中冶	459,800	1,121,912.00	0.06
269	302132	中航成飞	19,200	1,119,744.00	0.06
270	603260	合盛硅业	23,200	1,119,632.00	0.06
271	300628	亿联网络	32,820	1,109,972.40	0.06
272	601607	上海医药	71,800	1,105,720.00	0.06
273	600918	中泰证券	204,500	1,087,940.00	0.06
274	600061	国投资本	164,416	1,076,924.80	0.06
275	000617	中油资本	162,500	1,070,875.00	0.06
276	600025	华能水电	120,300	1,069,467.00	0.06
277	300832	新产业	25,400	1,066,800.00	0.06
278	300251	光线传媒	94,100	1,043,569.00	0.06
279	600085	同仁堂	44,300	1,023,773.00	0.06
280	600930	华电新能	213,500	1,018,395.00	0.06
281	601059	信达证券	62,700	1,015,113.00	0.06
282	688472	阿特斯	93,800	1,014,916.00	0.06
283	600515	海南机场	368,300	1,009,142.00	0.05

284	000999	华润三九	42,610	958,298.90	0.05
285	600803	新奥股份	59,500	940,100.00	0.05
286	600018	上港集团	194,200	916,624.00	0.05
287	600845	宝信软件	54,831	911,839.53	0.05
288	300122	智飞生物	76,700	896,623.00	0.05
289	300999	金龙鱼	38,204	888,625.04	0.05
290	300896	爱美客	10,160	885,952.00	0.05
291	000596	古井贡酒	10,900	869,820.00	0.05
292	000708	中信特钢	65,300	824,086.00	0.04
293	688009	中国通号	167,200	795,872.00	0.04
294	601018	宁波港	249,700	786,555.00	0.04
295	001248	华润新能源	74,179	749,949.69	0.04
296	688303	大全能源	42,300	737,289.00	0.04
297	601238	广汽集团	144,000	731,520.00	0.04
298	001280	中国铀业	10,700	713,690.00	0.04
299	300413	芒果超媒	48,512	709,730.56	0.04
300	301165	锐捷网络	8,400	675,780.00	0.04
301	603392	万泰生物	24,612	663,785.64	0.04
302	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.03
303	601136	首创证券	35,100	489,645.00	0.03
304	001391	国货航	94,686	385,372.02	0.02
305	688820	盛合晶微	2,237	316,513.13	0.02
306	688790	昂瑞微	2,319	293,237.55	0.02
307	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.01
308	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.01
309	001399	惠科股份	6,488	179,912.24	0.01
310	688809	强一股份	259	161,357.00	0.01
311	688797	臻宝科技	207	97,014.69	0.01
312	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
313	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
314	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
315	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
316	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
317	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
318	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
319	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
320	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
321	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
322	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
323	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
324	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
325	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
326	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00

327	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
328	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
329	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
330	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
331	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	300308	中际旭创	28,444,910.00	1.24
2	300750	宁德时代	27,447,337.00	1.19
3	300502	新易盛	20,954,916.51	0.91
4	002371	北方华创	12,499,528.70	0.54
5	000333	美的集团	10,573,065.80	0.46
6	000988	华工科技	9,920,522.00	0.43
7	002916	深南电路	8,750,821.36	0.38
8	301308	江波龙	8,621,650.00	0.38
9	002475	立讯精密	7,765,756.88	0.34
10	300059	东方财富	7,539,000.00	0.33
11	688012	中微公司	7,403,966.88	0.32
12	688072	拓荆科技	7,366,508.00	0.32
13	300394	天孚通信	7,330,238.00	0.32
14	002594	比亚迪	6,865,709.00	0.30
15	688521	芯原股份	6,370,024.11	0.28
16	002353	杰瑞股份	5,865,931.00	0.26
17	688256	寒武纪	5,775,535.14	0.25
18	300274	阳光电源	5,520,798.00	0.24
19	002602	世纪华通	5,386,907.00	0.23
20	300476	胜宏科技	5,175,541.00	0.23

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	300750	宁德时代	51,860,056.21	2.26
2	300308	中际旭创	42,616,476.00	1.85
3	300502	新易盛	29,507,556.04	1.28
4	000333	美的集团	20,996,168.58	0.91
5	002371	北方华创	18,393,740.35	0.80

6	300059	东方财富	15,604,513.11	0.68
7	002475	立讯精密	14,851,417.00	0.65
8	002594	比亚迪	13,395,444.10	0.58
9	300274	阳光电源	11,840,448.00	0.52
10	688256	寒武纪	10,818,433.24	0.47
11	000858	五粮液	10,497,099.00	0.46
12	002916	深南电路	10,377,881.00	0.45
13	300394	天孚通信	9,463,996.30	0.41
14	300476	胜宏科技	9,341,877.76	0.41
15	000651	格力电器	9,292,072.50	0.40
16	000725	京东方 A	8,847,401.00	0.38
17	002230	科大讯飞	8,333,272.00	0.36
18	300124	汇川技术	7,625,991.00	0.33
19	000338	潍柴动力	7,435,930.00	0.32
20	002050	三花智控	7,069,359.00	0.31

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

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	500,015,557.80
卖出股票收入（成交）总额	722,930,653.25

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 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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理厅、国家金融监督管理总局、国家金融监督管理总局地方监管分局、国家金融监督管理总局地方监管局、中国人民银行分支行、综合行政执法局的处罚。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同约定备选股票库之外的股票。

7.12.3 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	620,107.66
2	应收清算款	13,846,924.65
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	14,467,032.31

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 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

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		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	
		持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
410	3,031,225.37	330,402,600.00	26.59	2,399,800.00	0.19	910,000,000.00	73.22

8.2 盈利投资者数量占比

不适用。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	500.00	0.00

8.4 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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2018 年 1 月 19 日）基金份额总额	294,802,400.00
本报告期期初基金份额总额	1,680,802,400.00
本报告期基金总申购份额	501,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	939,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	1,242,802,400.00

§ 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

本报告期内，基金管理人于 2026 年 6 月 23 日发布公告，刘忠江先生于 2026 年 6 月 22 日起任公司总经理，鄂华先生于 2026 年 6 月 22 日离任公司总经理；基金管理人于 2026 年 7 月 2 日发布公告，岳海先生于 2026 年 6 月 30 日离任公司总经理助理。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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

本报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所，会计师事务所为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人未受监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

无。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

无。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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 (%)	
中金公司	2	813,164,007.01	66.65	159,301.30	66.65	-
中信证券	2	406,967,056.19	33.35	79,727.17	33.35	-
国泰海通	4	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（证监会公告〔2024〕3号）相关规定，本公司制定了基金专用交易单元的选择标准和程序，具体如下：

1、关于基金专用交易单元的选择标准：

（1）综合实力较强，财务状况良好，具有较强研究实力，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（为被动股票型基金选择证券公司不适用该条）；

（2）市场信誉良好、经营状况稳健；

（3）经营行为规范，合规风控能力较强，具备健全的内部控制制度；

（4）交易能力较强，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，能够提供全面的交易信息服务；

（5）从制度上和技术上保证我公司交易信息严格保密。

2、关于基金专用交易单元的选择程序：

（1）公司相关业务部门提出新增交易单元的需求，研究部根据公司《证券公司交易服务管理办法》的选择标准提出备选证券公司名单；

（2）备选的证券公司名单确定后，研究部会同投资相关部门组织证券公司就研究服务和佣金费率等展开评估，并对证券公司进行打分，最终按照综合分数排名情况确定入选的证券公司名单，合规管理部对谈判、打分及选择的过程进行合规性监督；

(3) 入选证券公司名单确定后, 研究部将全部协议内容以书面方式确定为合同文本, 交由合规管理部审核后, 与证券公司签署交易单元租用协议, 协议约定双方的权利义务, 明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
中金公司	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国泰海通	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

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	国寿安保基金管理有限公司关于变更旗下部分上交所 ETF 扩位证券简称的公告	上证报、证监会规定网站及公司网站	2026 年 1 月 23 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	20260101~20260630	1,201,000,000.00	258,000,000.00	549,000,000.00	910,000,000.00	73.22
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。							

注：上述申购份额含交易所二级市场买入，赎回份额含交易所二级市场卖出。

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沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

12.1.2 《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

12.1.3 《国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

12.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.5 报告期内国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

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

2026 年 8 月 29 日