

国寿安保中证养老产业指数增强型
证券投资基金
2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：二〇二〇年八月二十九日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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 2020 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	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
3.3 其他指标.....	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 中期财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	17
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况.....	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	36
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.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	40
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
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.....	41
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	42

7.12 投资组合报告附注	42
§8 基金份额持有人信息	43
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	43
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	43
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	43
§9 开放式基金份额变动	44
§10 重大事件揭示	45
10.1 基金份额持有人大会决议	45
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	45
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	45
10.4 基金投资策略的改变	45
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	45
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	45
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	45
10.8 其他重大事件	46
§11 影响投资者决策的其他重要信息	48
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	48
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	48
§12 备查文件目录	49
12.1 备查文件目录	49
12.2 存放地点	49
12.3 查阅方式	49

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金
基金简称	国寿安保中证养老产业指数增强
基金主代码	168001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019 年 4 月 1 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	65,705,697.59 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对中证养老产业指数有效跟踪的基础上，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证养老产业指数为标的指数。本基金主要策略为跟踪标的指数，在跟踪标的指数的基础上一定程度的调整个股，力求投资收益能够跟踪并适度超越标的指数。 本基金主要采用量化多因子投资策略实现指数增强，通过对标的指数成分股及其他股票基本面的深入研究，运用多因子模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，力争实现超额收益。
业绩比较基准	95%中证养老产业指数收益率+5%银行人民币活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为股票型基金，具有较高预期风险、较高预期收益的特征，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		国寿安保基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	申梦玉	韩鑫普
	联系电话	010-50850744	0755-82943666
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4009-258-258	95565
传真		010-50850776	0755-82960794
注册地址		上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	广东省深圳市福田区福田街道福华一路 111 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	广东省深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		100033	518000

法定代表人	王军辉	霍达
-------	-----	----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	1,396,840.64
本期利润	14,850,023.59
加权平均基金份额本期利润	0.2243
本期加权平均净值利润率	22.06%
本期基金份额净值增长率	23.72%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)
期末可供分配利润	-23,953,075.79
期末可供分配基金份额利润	-0.3646
期末基金资产净值	77,406,863.54
期末基金份额净值	1.1781
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)
基金份额累计净值增长率	17.85%

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。

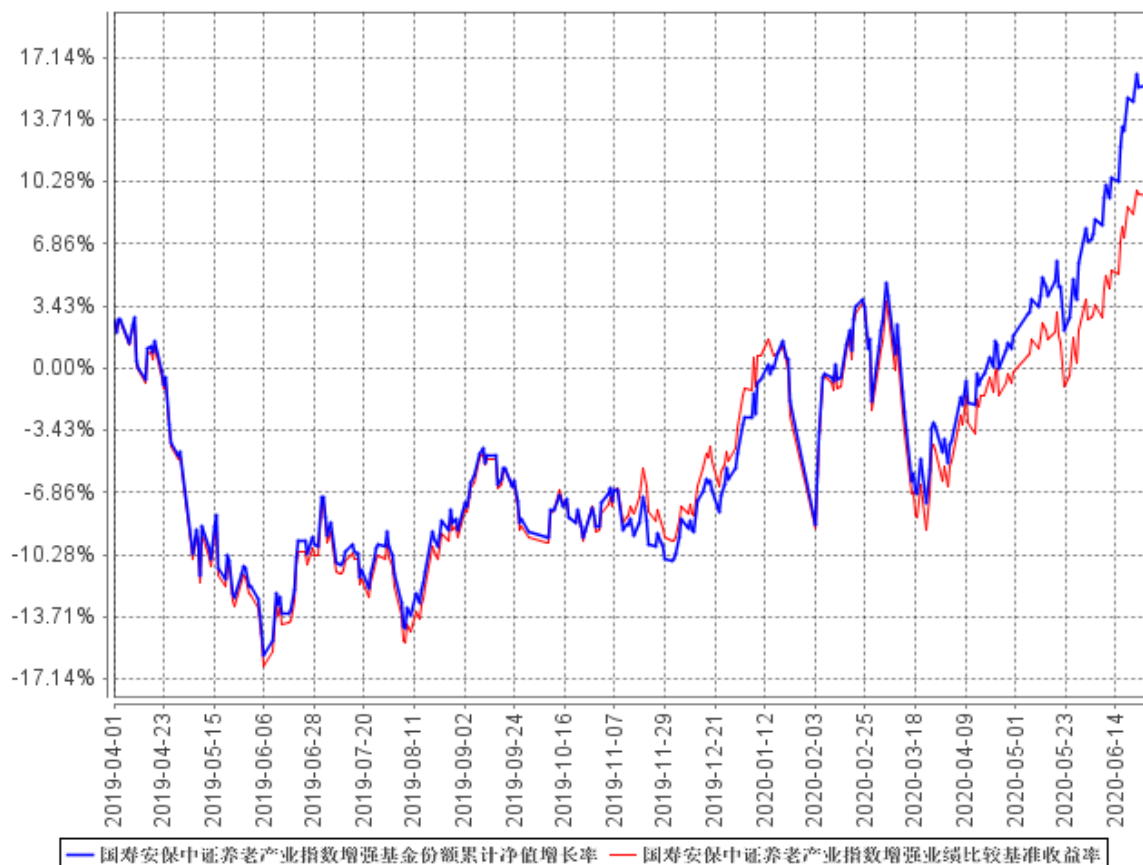
3.2 基金净值表现

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
过去一个月	11.46%	0.89%	9.35%	0.94%	2.11%	-0.05%
过去三个月	22.65%	1.00%	17.94%	1.05%	4.71%	-0.05%
过去六个月	23.72%	1.47%	15.44%	1.49%	8.28%	-0.02%
过去一年	30.64%	1.21%	24.49%	1.23%	6.15%	-0.02%
自基金合同生效起至今	17.85%	1.27%	11.58%	1.29%	6.27%	-0.02%

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

国寿安保中证养老产业指数增强基金份额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



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国寿安保基金管理有限公司经中国证监会证监许可〔2013〕1308 号文核准，于 2013 年 10 月 29 日设立，公司注册资本 12.88 亿元人民币，公司股东为中国人寿资产管理有限公司，其持有股份 85.03%，AMP CAPITAL INVESTORS LIMITED（澳大利亚安保资本投资有限公司），其持有股份 14.97%。截至 2020 年 6 月 30 日，公司共管理 63 只公募基金和部分私募资产管理计划，公司管理资产总规模为 2807.05 亿元，其中公募基金管理规模 2119.18 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
李康	基金经理	2018 年 1 月 30 日	-	10 年	李康先生，博士研究生。2009 年 10 月至 2012 年 12 月就职于中国国际金融有限公司，任职量化分析经理；2012 年 12 月至 2013 年 11 月就职于长盛基金管理有限公司，任职量化研究员；2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金、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及国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：任职日期为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 公平交易制度的执行情况

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司制定的公平交易相关制度。本报告期，不存在损害投资者利益的不公平交易行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金严格遵守基金合同，在紧密追踪标的指数的基础上力争取得相对指数超额收益。

本基金为指数增强基金，基金管理人在量化分析研究的基础上，综合利用各类量化模型筛选具有相对收益的个股构建投资组合，本基金基本保持与标的指数相近的行

业分布，在个股选择和风格上做了一定的主动暴露。基金管理人持续追踪选股量化因子的表现，依据不同市场环境灵活搭配因子组合，同时对个股风险事件进行监控，及时应对调仓。

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 1.1781 元；本报告期基金份额净值增长率为 23.72%，业绩比较基准收益率为 15.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

A 股市场在经过一季度大幅下跌后，二季度受益于疫情迅速得到控制生产稳步恢复，市场迎来反弹。展望下半年，相对世界其他主要经济体而言，国内疫情控制得力，加上继续积极稳健和精准导向的财政政策，全面复工生产后经济持续改善是大概率事件。外部环境方面，欧美疫情的延续使得全球疫情大概率趋于常态化，叠加美国大选带来中美关系波动，给 A 股市场带来的不确定性有所增加。整体来看，中游高端制造的相关个股有望继续成为市场主线，但是在全面的估值修复过后，个股表现将有所分化，具有业绩支撑的个股有望继续得到市场青睐，维持一定的估值溢价。另外“内循环”也将带来新的投资机会，与之相关的低估值的基建板块，消费和进口替代等相关行业也是值得关注的。综上，经济基本面的底部已经确认，三季度盈利恢复相对较强，尤其是结构性盈利恢复可能相对显著，市场将以结构性投资机会为主。在强调“内循环”的背景下，依靠科技创新和促进消费将是经济发展的重点方向，叠加人口结构日趋老龄化，与之密切相关的养老产业具备长期投资价值。

本基金将严格遵守基金合同，力争将对标的指数的跟踪误差降低到最小程度。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行。

本基金管理人设有基金估值委员会，估值委员会负责人由主管运营工作的公司领导担任，委员由运营管理部负责人、合规管理部负责人、监察稽核部负责人、研究部负责人组成，估值委员会成员均具有专业胜任能力和相关工作经验。估值委员会采取定期或临时会议的方式召开会议评估基金的估值政策和程序，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况时，运营管理部及时提请估值委员会召开会议修订估值方法并履行信息披露义务，以保证其持续适用。相关基金经理和研究员可列席会议，

向估值委员会提出估值意见或建议，但不参与具体的估值流程。

上述参与估值流程的各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司和中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供在银行间同业市场和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据，以及流通受限股票的估值数据。

4.7 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，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

本托管人复核审查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。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	7,064,493.43	3,896,065.89
结算备付金		-	125,060.36
存出保证金		2,989.56	9,381.58
交易性金融资产	6.4.7.2	70,856,059.66	57,353,534.28
其中：股票投资		70,856,059.66	57,353,534.28
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		24,003.11	885,398.10
应收利息	6.4.7.5	3,168.75	2,120.26
应收股利		-	-
应收申购款		136,647.30	39,260.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		78,087,361.81	62,310,820.59
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		-	453,931.34
应付赎回款		421,018.51	103,061.67
应付管理人报酬		60,238.06	50,872.52
应付托管费		12,047.60	10,174.50
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,507.09	74,267.95
应交税费		-	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	185,687.01	180,348.62
负债合计		680,498.27	872,656.60
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	85,331,711.77	83,795,736.85
未分配利润	6.4.7.10	-7,924,848.23	-22,357,572.86
所有者权益合计		77,406,863.54	61,438,163.99
负债和所有者权益总计		78,087,361.81	62,310,820.59

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，养老指数增强基金份额净值人民币 1.1781 元；基金份额总额为 65,705,697.59 份。

6.2 利润表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 4 月 1 日(基金合同生效日)至 2019 年 6 月 30 日
一、收入		15,445,126.51	-6,168,252.30
1.利息收入		47,614.41	17,191.37
其中：存款利息收入	6.4.7.11	47,611.65	17,191.37
债券利息收入		2.76	-
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		1,930,442.52	-3,635,349.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	1,149,051.72	-4,274,834.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	5,076.84	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	776,313.96	639,484.40

3.公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	6.4.7.17	13,453,182.95	-2,554,302.06
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	13,886.63	4,208.25
减：二、费用		595,102.92	325,998.89
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	334,490.13	154,047.25
2. 托管费	6.4.10.2.2	66,898.03	30,809.49
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	9,179.40	18,959.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	184,535.36	122,183.06
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,850,023.59	-6,494,251.19
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,850,023.59	-6,494,251.19

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金

本报告期：2020年1月1日至2020年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	83,795,736.85	-22,357,572.86	61,438,163.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,850,023.59	14,850,023.59
三、本期基金份额交易产	1,535,974.92	-417,298.96	1,118,675.96

生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)			
其中: 1.基金申购款	12,209,280.64	-2,701,417.92	9,507,862.72
2.基金赎回款	-10,673,305.72	2,284,118.96	-8,389,186.76
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	85,331,711.77	-7,924,848.23	77,406,863.54
	上年度可比期间		
	2019年4月1日(基金合同生效日)至2019年6月30日		
项目	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	88,140,371.98	-20,272,040.30	67,868,331.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-6,494,251.19	-6,494,251.19
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-2,140,389.84	486,197.82	-1,654,192.02
其中: 1.基金申购款	2,379,501.53	-717,012.77	1,662,488.76
2.基金赎回款	-4,519,891.37	1,203,210.59	-3,316,680.78
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	85,999,982.14	-26,280,093.67	59,719,888.47

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

左季庆 王文英 韩占锋
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金经中国证监会《关于准予国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金注册的批复》(证监许可【2015】763号)准予募

集注册，基金管理人为国寿安保基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金自 2015 年 6 月 8 日至 2015 年 6 月 19 日进行公开募集，募集总额为 276,524,524.25 元，募集结束后基金管理人向中国证监会办理备案手续。经中国证监会书面确认，《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》于 2015 年 6 月 26 日生效。

2019 年 2 月 18 日，国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，大会审议并通过《关于国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金修改基金运作方式等事项的议案》，内容包括对本基金基金名称、基金的上市交易、基金的申购与赎回、基金的投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、风险收益特征、基金资产估值、基金的费用、基金的收益分配原则、基金份额的分级、折算、配对转换等条款以及因法律法规变更的部分条款进行修改。

自 2019 年 4 月 1 日起，《国寿安保中证养老产业指数分级证券投资基金基金合同》失效且《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同》同时生效。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照中国财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》、《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净值变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策与最近一期年度报告相一致。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、

同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：（一）提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；（二）转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	7,064,493.43
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计：	7,064,493.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	51,597,364.43	70,856,059.66	19,258,695.23
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	51,597,364.43	70,856,059.66	19,258,695.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金于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**

本基金于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

本基金于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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	3,167.45
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-

其他	1.30
合计	3,168.75

6.4.7.6 其他资产

无。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	1,507.09
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,507.09

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,151.65
应付证券出借违约金	-
预提费用	84,535.36
应付指数使用费	100,000.00
合计	185,687.01

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,522,971.89	83,795,736.85
本期申购	9,401,173.92	12,209,280.64
本期赎回(以“-”号填列)	-8,218,448.22	-10,673,305.72
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	65,705,697.59	85,331,711.77

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,887,511.84	2,529,938.98	-22,357,572.86
本期利润	1,396,840.64	13,453,182.95	14,850,023.59
本期基金份额交易产生的变动数	-462,404.59	45,105.63	-417,298.96
其中：基金申购款	-3,586,561.09	885,143.17	-2,701,417.92
基金赎回款	3,124,156.50	-840,037.54	2,284,118.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,953,075.79	16,028,227.56	-7,924,848.23

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	47,330.65
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	224.31
其他	56.69
合计	47,611.65

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出股票成交总额	3,979,589.17
减：卖出股票成本总额	2,830,537.45
买卖股票差价收入	1,149,051.72

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	5,076.84
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	5,076.84

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	22,079.60
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	17,000.00
减：应收利息总额	2.76
买卖债券差价收入	5,076.84

6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期间无资产支持证券投资产生的收益/损失。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金于本报告期间无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金于本报告期间无投资衍生工具产生的收益/损失。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	776,313.96
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	776,313.96

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	13,453,182.95

——股票投资	13,453,182.95
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	13,453,182.95

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	13,886.63
合计	13,886.63

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
交易所市场交易费用	9,179.40
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	9,179.40

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	100,000.00
其他	-

合计	184,535.36
----	------------

6.4.7.21 分部报告

无。

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

截至本会计报表批准报出日，本基金无需作披露的重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内不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。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保基金”）	基金管理人、直销机构
招商证券股份有限公司（简称“招商证券”）	基金托管人
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

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

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年4月1日(基金合同生效日)至 2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
招商证券	2,862,336.00	45.00%	13,529,007.15	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年1月1日至2020年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	2,093.08	45.15%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年4月1日(基金合同生效日)至2019年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
招商证券	9,893.56	100.00%	9,893.56	100.00%

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年4月1日(基金合同生效日) 至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付 的管理费	334,490.13
其中：支付销售机构的客 户维护费	18,948.98	6,582.35

注：基金管理费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

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 2020年1月1日至2020年6 月30日	上年度可比期间 2019年4月1日(基金合同生效日) 至2019年6月30日

当期发生的基金应支付的托管费	66,898.03	30,809.49
----------------	-----------	-----------

注：基金托管费每日计提，按月支付。计算方法如下：

$$H = E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

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

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金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

报告期内基金管理人未投资本基金。

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 2020年6月30日		上年度末 2019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
集团公司	51,568,384.70	78.4839%	51,568,384.70	79.9225%

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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年4月1日(基金合同生效日)至2019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
招商证券	7,064,493.43	47,330.65	5,483,398.86	17,166.72

注：本基金的银行存款存放于基金托管人招商证券股份有限公司在交通银行深圳科技园支行开立的基金托管账户，并由基金托管人招商证券股份有限公司保管；本基金的银行存款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

本基金于本报告期末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

本基金本报告期无其他关联交易事项。

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（2020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	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300845	捷安高科	2020年6月24日	2020年7月3日	新股流通受限	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020年6月23日	2020年7月2日	新股流通受限	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	5.94	5.94	1,066	6,332.04	6,332.04	-
300846	首都在线	2020年6月22日	2020年7月1日	新股流通受限	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间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

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购余额。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。本基金管理人根据现代企业法人治理结构和内部控制的要求，建立在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。风险控制的体系由公司董事会、风险管理委员会、经理层、督察长、合规管理部、监察稽核部和各业务部门业务人员岗位自控构成。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种

所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

本基金所持证券在证券交易所上市，因此，除在附注 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，其余均能及时变现。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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

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

利率风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。本基金所面临的利率风险主要来源于本基金所持有的生息资产。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及结算保证金等。本基金于本报告期末未持有债券投资，因此基金净值受利率变动的影响较小。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	7,064,493.43	-	-	-	7,064,493.43
存出保证金	2,989.56	-	-	-	2,989.56
交易性金融资产	-	-	-	70,856,059.66	70,856,059.66
应收证券清算款	-	-	-	24,003.11	24,003.11
应收利息	-	-	-	3,168.75	3,168.75
应收申购款	-	-	-	136,647.30	136,647.30
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	7,067,482.99	-	-	71,019,878.82	78,087,361.81
负债					
应付赎回款	-	-	-	421,018.51	421,018.51

应付管理人报酬	-	-	-	60,238.06	60,238.06
应付托管费	-	-	-	12,047.60	12,047.60
应付交易费用	-	-	-	1,507.09	1,507.09
其他负债	-	-	-	185,687.01	185,687.01
负债总计	-	-	-	680,498.27	680,498.27
利率敏感度缺口	7,067,482.99	-	-	70,339,380.55	77,406,863.54
上年度末 2019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	3,896,065.89	-	-	-	3,896,065.89
结算备付金	125,060.36	-	-	-	125,060.36
存出保证金	9,381.58	-	-	-	9,381.58
交易性金融资产	-	-	-	57,353,534.28	57,353,534.28
应收证券清算款	-	-	-	885,398.10	885,398.10
应收利息	-	-	-	2,120.26	2,120.26
应收申购款	-	-	-	39,260.12	39,260.12
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,030,507.83	-	-	58,280,312.76	62,310,820.59
负债					
应付证券清算款	-	-	-	453,931.34	453,931.34
应付赎回款	-	-	-	103,061.67	103,061.67
应付管理人报酬	-	-	-	50,872.52	50,872.52
应付托管费	-	-	-	10,174.50	10,174.50
应付交易费用	-	-	-	74,267.95	74,267.95
其他负债	-	-	-	180,348.62	180,348.62
负债总计	-	-	-	872,656.60	872,656.60
利率敏感度缺口	4,030,507.83	-	-	57,407,656.16	61,438,163.99

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本报告期末持有的利率敏感性资产主要为银行存款等，除此之外的金融资产和金融负债均不计息。因此市场利率的变动对于本资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，

并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

本基金投资范围主要为标的指数成份股及备选成份股，所持有的股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于中证养老产业指数成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金面临的其他价格风险列示如下：

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 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 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	70,856,059.66	91.54	57,353,534.28	93.35
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-
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	70,856,059.66	91.54	57,353,534.28	93.35

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；		
	用期末时点比较基准浮动 5%基金资产净值相应变化来估测组合市场价格风险；		
	Beta 系数是根据本报告期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（2020 年 6 月 30 日）	上年度末（2019 年 12 月 31 日）
	5%	3,542,802.98	2,636,922.39
	-5%	-3,542,802.98	-2,636,922.39

6.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

无。

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.14.1 公允价值

银行存款、结算备付金、存出保证金等，因其剩余期限不长，公允价值与账面价值相若。

(1)各层次金融工具公允价值

于 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 70,830,112.54 元（上年度末：63,419,493.56 元），属于第二层次的余额为人民币 25,947.12 元（上年度末：1,017,435.90 元），无属于第三层次的余额。

(2)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和可转换债券，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可转换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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.2 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2020 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	70,856,059.66	90.74
	其中：股票	70,856,059.66	90.74
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	7,064,493.43	9.05
8	其他各项资产	166,808.72	0.21
9	合计	78,087,361.81	100.00

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,366,586.42	36.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	4,300,933.70	5.56
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	1,898,044.50	2.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,181,928.91	11.86
J	金融业	4,724,942.23	6.10
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	2,177,676.14	2.81
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	2,383,725.00	3.08
Q	卫生和社会工作	2,568,448.70	3.32
R	文化、体育和娱乐业	3,178,733.00	4.11
S	综合	-	-
	合计	58,781,018.60	75.94

7.2.2 期末积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,504,544.05	12.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,192.96	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	966,756.28	1.25
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	902,763.57	1.17
J	金融业	378,568.20	0.49
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	199,466.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	113,750.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	12,075,041.06	15.60

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末无港股通股票投资组合。

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000661	长春高新	9,200	4,004,760.00	5.17

2	300122	智飞生物	39,201	3,925,980.15	5.07
3	300760	迈瑞医疗	10,100	3,087,570.00	3.99
4	600436	片仔癀	16,801	2,860,370.25	3.70
5	600276	恒瑞医药	26,630	2,457,949.00	3.18
6	300015	爱尔眼科	56,426	2,451,709.70	3.17
7	002607	中公教育	85,900	2,383,725.00	3.08
8	002001	新和成	80,000	2,328,000.00	3.01
9	601888	中国中免	14,138	2,177,676.14	2.81
10	600754	锦江酒店	68,398	1,898,044.50	2.45
11	600637	东方明珠	193,764	1,869,822.60	2.42
12	600887	伊利股份	58,101	1,808,684.13	2.34
13	000100	TCL 科技	286,500	1,776,300.00	2.29
14	601336	新华保险	37,801	1,673,828.28	2.16
15	002555	三七互娱	35,100	1,642,680.00	2.12
16	603983	丸美股份	18,900	1,625,967.00	2.10
17	300413	芒果超媒	23,200	1,512,640.00	1.95
18	601318	中国平安	20,868	1,489,975.20	1.92
19	300383	光环新网	55,200	1,439,064.00	1.86
20	601360	三六零	69,701	1,276,225.31	1.65
21	002867	周大生	57,250	1,269,232.50	1.64
22	002624	完美世界	20,100	1,158,564.00	1.50
23	601098	中南传媒	109,200	1,155,336.00	1.49
24	600901	江苏租赁	215,900	1,124,839.00	1.45
25	002508	老板电器	33,641	1,046,571.51	1.35
26	300464	星徽精密	62,300	820,491.00	1.06
27	601933	永辉超市	85,700	803,866.00	1.04
28	002252	上海莱士	92,315	780,984.90	1.01
29	601607	上海医药	42,000	771,960.00	1.00
30	000538	云南白药	7,832	734,719.92	0.95
31	002558	巨人网络	36,520	635,448.00	0.82
32	000963	华东医药	25,114	635,384.20	0.82
33	002195	二三四五	194,600	546,826.00	0.71
34	600977	中国电影	38,900	510,757.00	0.66
35	600315	上海家化	10,600	507,740.00	0.66
36	603156	养元饮品	22,680	487,620.00	0.63
37	603000	人民网	24,500	485,835.00	0.63
38	601601	中国太保	16,011	436,299.75	0.56
39	300003	乐普医疗	10,203	372,613.56	0.48
40	000999	华润三九	12,400	361,956.00	0.47

41	002032	苏泊尔	2,800	198,800.00	0.26
42	600959	江苏有线	33,900	127,464.00	0.16
43	600763	通策医疗	700	116,739.00	0.15

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	300741	华宝股份	53,000	1,954,640.00	2.53
2	600566	济川药业	74,813	1,904,738.98	2.46
3	000869	张裕A	34,700	1,185,005.00	1.53
4	000403	振兴生化	13,200	978,516.00	1.26
5	300357	我武生物	15,500	964,875.00	1.25
6	002609	捷顺科技	64,200	818,550.00	1.06
7	600031	三一重工	40,200	754,152.00	0.97
8	600998	九州通	35,894	668,346.28	0.86
9	600519	贵州茅台	300	438,864.00	0.57
10	300059	东方财富	18,741	378,568.20	0.49
11	600690	海尔智家	17,700	313,290.00	0.40
12	600713	南京医药	68,600	298,410.00	0.39
13	600346	恒力石化	14,900	208,600.00	0.27
14	603118	共进股份	16,600	197,374.00	0.25
15	603737	三棵树	1,960	180,751.20	0.23
16	603833	欧派家居	1,200	139,080.00	0.18
17	600138	中青旅	13,300	131,271.00	0.17
18	601019	山东出版	18,200	113,750.00	0.15
19	600707	彩虹股份	18,000	82,080.00	0.11
20	601515	东风股份	13,300	81,263.00	0.10
21	600050	中国联通	14,900	72,116.00	0.09
22	603300	华铁应急	11,500	68,195.00	0.09
23	600612	老凤祥	1,200	57,828.00	0.07
24	603087	甘李药业	193	19,357.90	0.03
25	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.02
26	300839	博汇股份	502	11,751.82	0.02
27	600956	新天绿能	1,824	9,192.96	0.01
28	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.01
29	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.01
30	300840	酷特智能	1,066	6,332.04	0.01
31	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	603301	振德医疗	861,066.00	1.40
2	600519	贵州茅台	336,763.00	0.55
3	601098	中南传媒	187,463.00	0.31
4	603983	丸美股份	170,571.00	0.28
5	601607	上海医药	111,150.00	0.18
6	002195	二三四五	92,162.00	0.15
7	603156	养元饮品	79,321.00	0.13
8	300741	华宝股份	71,944.00	0.12
9	603000	人民网	71,342.00	0.12
10	600918	中泰证券	63,453.06	0.10
11	600901	江苏租赁	55,245.00	0.09
12	002252	上海莱士	42,864.00	0.07
13	000869	张裕 A	40,322.00	0.07
14	601827	三峰环境	39,637.80	0.06
15	300821	东岳硅材	39,350.70	0.06
16	601696	中银证券	34,351.60	0.06
17	000999	华润三九	31,465.00	0.05
18	002032	苏泊尔	31,278.00	0.05
19	601601	中国太保	27,283.00	0.04
20	601933	永辉超市	24,742.00	0.04

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	603301	振德医疗	1,093,678.00	1.78
2	600977	中国电影	204,061.00	0.33
3	600918	中泰证券	199,942.73	0.33
4	000509	华塑控股	182,127.00	0.30

5	600998	九州通	162,571.00	0.26
6	601696	中银证券	146,989.00	0.24
7	300832	新产业	127,008.00	0.21
8	600315	上海家化	105,259.00	0.17
9	002508	老板电器	103,925.00	0.17
10	603290	斯达半导	97,590.77	0.16
11	601888	中国中免	90,063.00	0.15
12	300821	东岳硅材	87,426.99	0.14
13	300059	东方财富	81,307.00	0.13
14	601827	三峰环境	67,939.32	0.11
15	002555	三七互娱	58,306.00	0.09
16	002989	中天精装	57,526.00	0.09
17	600138	中青旅	56,349.00	0.09
18	603893	瑞芯微	49,950.00	0.08
19	000963	华东医药	47,044.00	0.08
20	600959	江苏有线	44,932.00	0.07

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	2,879,879.88
卖出股票收入（成交）总额	3,979,589.17

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投资。

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投资。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注**7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明**

本基金本报告期内投资前十名证券的发行主体均无被监管部门立案调查和在报告编制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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资前十名股票未超出基金合同规定的股票库。

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	2,989.56
2	应收证券清算款	24,003.11
3	应收股利	-
4	应收利息	3,168.75
5	应收申购款	136,647.30
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	166,808.72

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**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票中无流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中无流通受限情况。

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	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
1,333	49,291.60	56,357,213.70	85.77%	9,348,483.89	14.23%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

基金管理人的从业人员本报告期末未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

报告期末基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人以及基金经理均未持有本基金。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年4月1日）基金份额总额	67,868,328.90
本报告期期初基金份额总额	64,522,971.89
本报告期基金总申购份额	9,401,173.92
减:本报告期基金总赎回份额	8,218,448.22
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	65,705,697.59

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期末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、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	3,476,987.17	54.85%	2,542.54	54.85%	-
招商证券	2	2,862,336.00	45.15%	2,093.08	45.15%	-

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

1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1) 综合实力较强、市场信誉良好；
- (2) 财务状况良好，经营状况稳健；
- (3) 经营行为规范，具备健全的内部控制制度；

(4) 研究实力较强，并能够第一时间提供丰富的高质量研究咨询报告，并能根据特定要求提供定制研究报告；能够积极同我公司进行业务交流，定期来我公司进行观点交流和路演；

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

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

(7) 从制度上和技术上保证我公司租用交易单元的交易信息严格保密。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
银河证券	22,079.60	100.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 1 月 18 日
2	国寿安保基金关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 3 月 25 日
3	国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 22 日
4	国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金 2019 年度报告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 4 月 30 日
5	国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金托管协议	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 6 月 5 日
6	国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金基金合同	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 6 月 5 日
7	国寿安保中证养老产业指数增强	证券时报、证监会指	2020 年 6 月 5 日

	型证券投资基金更新招募说明书 (摘要)(2020 年第 1 号)	定网站及公司网站	
8	国寿安保中证养老产业指数增强 型证券投资基金更新招募说明书 (2020 年第 1 号)	证券时报、证监会指 定网站及公司网站	2020 年 6 月 5 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	1	20200101~20200630	51,568,384.70	0.00	0.00	51,568,384.70	78.48%
个人	-	-	-	-	-	-	-

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。

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 《国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金托管协议》

12.1.2 基金管理人业务资格批件、营业执照

12.1.3 报告期内国寿安保中证养老产业指数增强型证券投资基金在指定媒体上披露的各项公告

12.1.4 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.gsfoods.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

2020 年 8 月 29 日