

# 国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF） 2020 年年度报告

2020 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：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 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，安永华明会计师事务所（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 2020 年 08 月 06 日（基金合同生效日）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	5
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	7
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	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	10
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
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	10
<b>§5 托管人报告</b>	<b>11</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
<b>§6 审计报告</b>	<b>11</b>
6.1 审计报告基本信息	11
6.2 审计报告的基本内容	11
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>13</b>
7.1 资产负债表	13
7.2 利润表	14
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	15
7.4 报表附注	16

<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	38
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	39
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 .....	39
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	39
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	39
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 .....	39
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 .....	39
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 .....	40
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 .....	40
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	40
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	40
8.12 本报告期投资基金情况 .....	40
8.13 投资组合报告附注 .....	42
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>42</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	42
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	42
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	43
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>43</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>43</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	43
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 .....	43
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	43
11.4 基金投资策略的改变 .....	43
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	43
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	43
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	43
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	44
11.9 其他重大事件 .....	45
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>46</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 .....	46
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	47
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>47</b>
13.1 备查文件目录 .....	47
13.2 存放地点 .....	47
13.3 查阅方式 .....	47

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)
基金简称	国寿安保策略优选 3 个月持有混合 (FOF)
基金主代码	009151
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2020 年 8 月 6 日
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	546,063,507.19 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制下行风险的基础上, 力争通过合理灵活的大类资产配置与专业深入的基金品种选择, 实现基金资产的持续稳健增长。
投资策略	本基金坚持“自上而下”的资产配置与“自下而上”的基金品种选择相结合, 将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、基金类型配置、基金品种选择以及组合风险管理全过程中。
业绩比较基准	中债综合(全价)指数收益率*75%+中证 800 指数收益率*20%+一年期定期存款利率*5%
风险收益特征	本基金为混合型基金中基金, 其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金, 低于股票型基金和股票型基金中基金。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	申梦玉
	联系电话	010-50850744
	电子邮箱	public@gsfunds.com.cn
客户服务电话	4009-258-258	021-60637111
传真	010-50850776	010-66275853
注册地址	上海市虹口区丰镇路 806 号 3 幢 306 号	北京市西城区金融大街 25 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	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	王军辉	田国立

### 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
注册登记机构	国寿安保基金管理有限公司	北京市西城区金融大街 28 号院盈泰商务中心 2 号楼 11 层

## § 3 主要财务指标、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	2020 年 8 月 6 日（基金合同生效日）-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	12,535,398.87
本期利润	30,933,525.66
加权平均基金份额本期利润	0.0542
本期加权平均净值利润率	5.31%
本期基金份额净值增长率	5.49%
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末
期末可供分配利润	12,131,099.45
期末可供分配基金份额利润	0.0222
期末基金资产净值	576,068,773.42
期末基金份额净值	1.0549
3.1.3 累计期末指标	2020 年末
基金份额累计净值增长率	5.49%

注：本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

上述基金业绩指标不包括持有人交易基金的各项费用，计入费用后投资人的实际收益水平要低于所列数字。

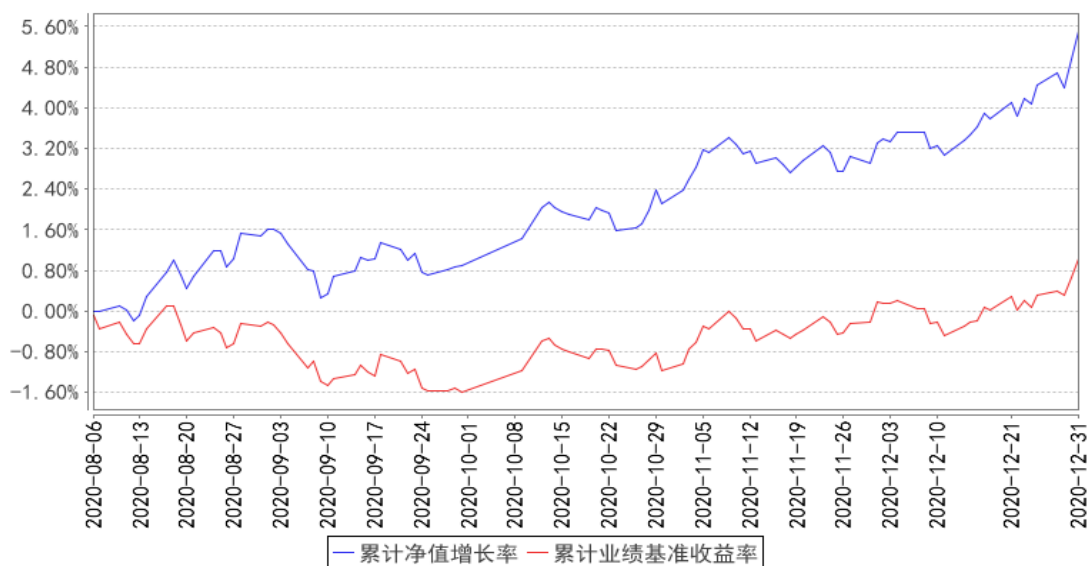
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.55%	0.23%	2.67%	0.20%	1.88%	0.03%
自基金合同生效起至今	5.49%	0.24%	1.03%	0.21%	4.46%	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

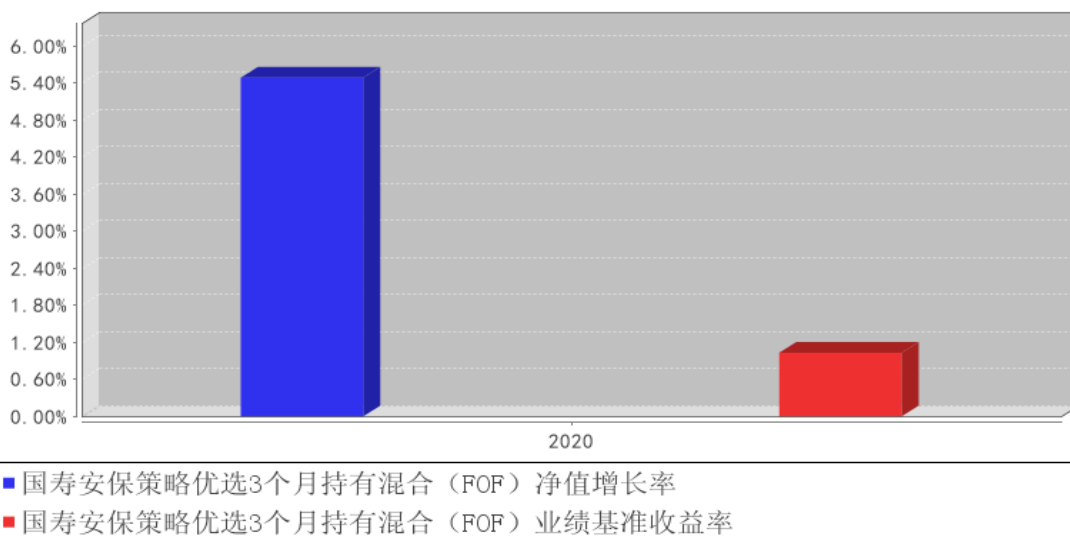
国寿安保策略优选3个月持有混合（FOF）累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金基金合同生效日为2020年8月06日，按照本基金的基金合同规定，自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同关于投资范围和投资限制的有关约定。截至本报告期末，本基金建仓期尚未结束。图示日期为2020年8月06日至2020年12月31日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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

国寿安保策略优选3个月持有混合（FOF）基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本基金基金合同自2020年08月06日起生效，基金合同生效以来未发生利润分配。

## § 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 12 月 31 日，公司共管理 71 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 2996.65 亿元，其中公募证券投资基金管理规模为 2296.27 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		
张志雄	基金经理	2020 年 08 月 06 日	-	11 年	张志雄先生，管理学硕士，2009 年 8 月至 2019 年 1 月就职于中国人寿保险股份有限公司，从事资产配置、组合管理、固定收益和权益投资管理工作。2019 年 2 月加入国寿安保基金资产配置部，现任国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）和国寿安保稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）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遵规守信情况的说明

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

2020 年初，新冠疫情爆发，权益市场震荡下跌，债券收益率下行；后续随着国内疫情逐步控制，货币政策宽松，国内经济复苏，权益市场震荡上涨，债券市场收益率震荡上行。

组合坚持稳健的投资策略，精选基金进行配置，实现稳定的收益。

#### 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 1.0549 元；本报告期基金份额净值增长率为 5.49%，业绩比较基准收益率为 1.03%

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年，随着疫苗注射和疫情逐步控制，海外经济有望逐步恢复，量化宽松政策难以大幅转向；国内经济和政策回归正常，货币政策存在灵活操作空间。权益市场持续上涨后，结构估值极端分化，部分行业板块估值处于历史高位，后续波动可能加大。全球经济共振复苏预期较强，如果通胀进一步上行导致国内货币政策收紧，债券收益率仍然存在上行可能。

#### 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

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签署服务协议, 由其按约定分别提供在银行间同业市场交易和在交易所市场交易的固定收益品种的估值数据。

#### 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

本报告期，中国建设银行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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

### 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 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	安永华明（2021）审字第 61090605_A59 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	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的财务报表，包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表，2020 年 8 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 8 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	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

	<p>我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF），并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）管理层对其他信息负责。其他信息包括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。</p> <p>基于我们已执行的工作，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>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）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>（3）评价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>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况</p>

	<p>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策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 不能持续经营。</p> <p>(5) 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	安永华明会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	范玉军	吴 军
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层	
审计报告日期	2021 年 3 月 30 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

报告截止日：2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	1,065,942.52
结算备付金		142,857.14
存出保证金		3,075.47
交易性金融资产	7.4.7.2	572,750,395.65
其中：股票投资		-
基金投资		540,895,173.75
债券投资		31,855,221.90
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		2,400,000.00
应收利息	7.4.7.5	390,051.90
应收股利		-
应收申购款		5,760,982.75
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		582,513,305.43

负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日
<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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		6,214,007.74
应付管理人报酬		25,719.87
应付托管费		89,191.30
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	-
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	115,613.10
负债合计		6,444,532.01
<b>所有者权益:</b>		
实收基金	7.4.7.9	546,063,507.19
未分配利润	7.4.7.10	30,005,266.23
所有者权益合计		576,068,773.42
负债和所有者权益总计		582,513,305.43

注：本基金合同生效日为 2020 年 08 月 06 日，本报告期自基金合同生效日 2020 年 08 月 06 日起至 2020 年 12 月 31 日止。报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0549 元，基金份额总额 546,063,507.19 份。

## 7.2 利润表

会计主体：国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期：2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		31,736,542.52
1. 利息收入		614,633.38
其中：存款利息收入	7.4.7.11	27,805.65
债券利息收入		516,031.84
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		70,795.89
证券出借利息收入		-

其他利息收入		-
2. 投资收益 (损失以“-”填列)		12,427,647.11
其中: 股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益	7.4.7.13	314,243.12
债券投资收益	7.4.7.14	-30,854.20
资产支持证券投资收益	7.4.7.14.5	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-
股利收益	7.4.7.17	12,144,258.19
3. 公允价值变动收益 (损失以“-”号填列)	7.4.7.18	18,398,126.79
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	7.4.7.19	296,135.24
减: 二、费用		803,016.86
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	227,675.40
2. 托管费	7.4.10.2.2	419,992.90
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-
4. 交易费用	7.4.7.20	47,824.12
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	7.4.7.21	107,524.44
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		30,933,525.66
减: 所得税费用		-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		30,933,525.66

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)

本报告期: 2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 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)	498,761,365.23	-	498,761,365.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	30,933,525.66	30,933,525.66
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	47,302,141.96	-928,259.43	46,373,882.53

（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	160,780,518.26	2,897,340.11	163,677,858.37
2. 基金赎回款	-113,478,376.30	-3,825,599.54	-117,303,975.84
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）	546,063,507.19	30,005,266.23	576,068,773.42

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告-至-财务报表由下列负责人签署：

<u>左季庆</u>	<u>王文英</u>	<u>韩占锋</u>
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

国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）（简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（简称“中国证监会”）证监许可[2020]287 号文《关于准予国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）注册的批复》的核准，由国寿安保基金管理有限公司（简称“国寿安保”）于 2020 年 7 月 27 日至 2020 年 8 月 3 日向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证出具安永华明（2020）验字第 61090605\_A11 号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于 2020 年 8 月 6 日正式生效，首次设立募集规模为 498,761,365.23 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为国寿安保，注册登记机构为国寿安保，基金托管人为中国建设银行股份有限公司（简称“建设银行”）。

本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（含 QDII 基金，但具有复杂、衍生品性质的基金份额除外），国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板和其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、中央银行票据、金融债券、次级债券、企业债券、公司债券、



中期票据、短期融资券、超短期融资券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、证券公司短期公司债、资产支持证券、可转换债券、可交换债券、债券回购、银行存款、同业存单以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于权益类资产的比例不超过 30%。权益类资产指股票、股票型基金和混合型基金。权益类资产中的混合型基金为满足如下条件之一的基金：基金合同中载明的股票资产占基金资产比例不低于 50% 的混合型基金；最近四个季度定期报告披露的股票资产占基金资产比例不低于 50% 的混合型基金。本基金应保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

#### 7.4.2 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（以下统称“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并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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 2 号《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。

#### 7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年 8 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间系 2020 年 8 月 6 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

##### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及贷款和应收款项；

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包括债券投资和基金投资等；

##### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券、基金等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本基金将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融

资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

#### (1) 债券投资

买入债券于成交日确认为债券投资。债券投资成本，按成交日应支付的全部价款扣除交易费用入账，其中所包含的债券应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

买入零息债券视同到期一次性还本付息的附息债券，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，按上述会计处理方法核算；

卖出债券于成交日确认债券投资收益，卖出债券的成本按移动加权平均法结转；

#### (2) 基金投资

买入基金于成交日按基金的公允价值入账，相关的交易费用直接计入当期损益；

卖出基金于成交日确认基金投资收益，卖出基金按移动加权平均法结转成本。

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的债券投资、基金投资等投资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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市

场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。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。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款,按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入,并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失,列入利息收入减项,存款利息收入以净额列示;

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认,在债券实际持有期内逐日计提;

(3) 债券投资收益/(损失)于成交日确认,并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账;

(4) 基金投资收益/(损失)于成交日确认,按卖出或赎回基金的成交总额扣除应结转的基金投资成本的差额入账;

(5) 公允价值变动收益/(损失)系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失;

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式分两种:现金分红与红利再投资,投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资;若投资者不选择,本基金默认的收益分配方式是现金分红;

(2) 基金收益分配后基金份额净值不能低于面值,即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值;

(3) 每一基金份额享有同等分配权;

(4) 法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

无。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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

无。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

无。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

无。

#### 7.4.6 税项

##### 7.4.6.1 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；

##### 7.4.6.2 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。

#### **7.4.6.3 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。

#### **7.4.6.4 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。

#### 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 2020 年 12 月 31 日
活期存款	1,065,942.52
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	1,065,942.52

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	31,998,673.55	31,855,221.90
	银行间市场	-	-
	合计	31,998,673.55	31,855,221.90
资产支持证券	-	-	-
基金	522,353,595.31	540,895,173.75	18,541,578.44
其他	-	-	-
合计	554,352,268.86	572,750,395.65	18,398,126.79

##### 7.4.7.3 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。



#### 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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	477.00
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	70.73
应收债券利息	389,502.74
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	1.43
合计	390,051.90

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金于本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

本基金于本报告期末无应付交易费用。

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	15,613.10
应付证券出借违约金	-
预提费用	100,000.00
合计	115,613.10

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	基金份额 (份)	账面金额
基金合同生效日	498,761,365.23	498,761,365.23
本期申购	160,780,518.26	160,780,518.26
本期赎回 (以“-”号填列)	-113,478,376.30	-113,478,376.30
- 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	546,063,507.19	546,063,507.19

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

#### 7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	12,535,398.87	18,398,126.79	30,933,525.66
本期基金份额交易产生的变动数	-404,299.42	-523,960.01	-928,259.43
其中：基金申购款	555,566.19	2,341,773.92	2,897,340.11
基金赎回款	-959,865.61	-2,865,733.93	-3,825,599.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,131,099.45	17,874,166.78	30,005,266.23

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日	
	活期存款利息收入	26,939.35
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	854.36	
其他	11.94	
合计	27,805.65	

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

本基金于本报告期无买卖股票差价收入。

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金于本报告期无股票投资收益。

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——证券出借差价收入

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年8月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出/赎回基金成交总额	77,816,330.61
减：卖出/赎回基金成本总额	77,502,087.49
基金投资收益	314,243.12

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2020年8月6日（基金合同生效日）至2020年12月31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	-30,854.20
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	-30,854.20

##### 7.4.7.14.2 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8月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	20,095,393.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	19,999,864.80
减：应收利息总额	126,382.54
买卖债券差价收入	-30,854.20

##### 7.4.7.14.3 资产支持证券投资收益

本基金于本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金于本报告期无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金于本报告期间无衍生工具产生的收益/损失。

#### 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	12,144,258.19
合计	12,144,258.19

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	18,398,126.79
股票投资	-
债券投资	-143,451.65
资产支持证券投资	-
基金投资	18,541,578.44
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	18,398,126.79

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	293,259.83
销售服务费	2,875.41
合计	296,135.24

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	586.41
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	47,237.71
其中: 申购费	-
赎回费	31,671.56
转换费	15,566.15
合计	47,824.12

#### 7.4.7.20.1 持有基金产生的费用

项目	本期费用
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	2,875.41
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	1,307,447.86
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	289,172.35

注: 当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值, 上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。该三项费用根据被投资基金的基金合同约定已经作为费用计入被投资基金的基金份额净值, 已在本基金持有基金的净值中体现, 不构成本基金的费用。

#### 7.4.7.21 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	60,000.00
信息披露费	40,000.00
证券出借违约金	-
银行费用	7,124.44
其他	400.00
合计	107,524.44

#### 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、注册登记机构、直销机构
建设银行	基金托管人、销售机构
中国人寿资产管理有限公司（简称“国寿资产”）	基金管理人的股东
安保资本投资有限公司（简称“安保资本”）	基金管理人的股东
中国人寿保险（集团）公司（简称“集团公司”）	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

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

本基金于本报告期未发生通过关联方交易单元进行股票交易。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金于本报告期未发生通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本基金于本报告期未发生通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 基金交易

本基金于本报告期未发生通过关联方交易单元进行基金交易。

##### 7.4.10.1.5 权证交易

本基金于本报告期未发生通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金于本报告期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
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	227,675.40
其中：支付销售机构的客户维护费	568,293.25

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除去本基金持有的基金管理人管理的其他基金所对应的基金资产净值后的净额的 0.8% 年费率计提；计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% / \text{当年天数}$$

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（除去本基金持有的基金管理人管理的其他基金所对应的基金资产净值）

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	419,992.90

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除去本基金持有的基金托管人托管的其他基金所对应的基金资产净值后的净额的 0.2% 年费率计提；计算方法如下：

$$H = E \times 0.2\% / \text{当年天数}$$

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（除去本基金持有的基金托管人托管的其他基金所对应的基金资产净值）

### 7.4.10.2.3 销售服务费

本基金于本报告期无销售服务费。

## 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

本基金本报告期末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

本基金的管理人本报告期无运用自有资金投资本基金的情况。

##### 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

本基金于本报告期末除基金管理人之外的其他关联方均未投资本基金。

#### 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 2020年8月6日（基金合同生效日）至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
建设银行-活期	1,065,942.52	26,939.35

##### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期间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

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

于本报告期末，本基金持有基金管理人国寿安保基金管理有限公司所管理的基金合计人民币 540,895,173.75 元，占本基金资产净值的比例为 93.89%。



**7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用**

项目	本期费用
	2020 年 8 月 6 日 (基金合同生效日) 至 2020 年 12 月 31 日
当期交易基金产生的申购费 (元)	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	31,671.56
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	2,875.41
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	1,307,447.86
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	289,172.35
当期交易基金产生的转换费 (元)	15,566.15

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、销售服务费等销售费用。

**7.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期间未进行利润分配。

**7.4.12 期末(2020 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**

本基金于本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

**7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金于本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

**7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券****7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

本基金于本报告期末未持有银行间市场证券证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**

本基金于本报告期末未持有交易所债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金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。

##### 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。

##### 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。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人在开放期内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。

###### 7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

###### 7.4.13.3.2 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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用

监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金主要投资于上市交易的证券，因此均能及时变现。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。本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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、存出保证金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020 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	1,065,942.52	-	-	-	1,065,942.52
结算备付金	142,857.14	-	-	-	142,857.14
存出保证金	3,075.47	-	-	-	3,075.47
交易性金融资产	31,855,221.90	-	-	540,895,173.75	572,750,395.65
应收利息	-	-	-	390,051.90	390,051.90
应收申购款	-	-	-	5,760,982.75	5,760,982.75
应收证券清算款	-	-	-	2,400,000.00	2,400,000.00
资产总计	33,067,097.03	-	-	549,446,208.40	582,513,305.43

负债					
应付赎回款	-	-	-	6,214,007.74	6,214,007.74
应付管理人报酬	-	-	-	25,719.87	25,719.87
应付托管费	-	-	-	89,191.30	89,191.30
其他负债	-	-	-	115,613.10	115,613.10
负债总计	-	-	-	6,444,532.01	6,444,532.01
利率敏感度缺口	33,067,097.03	-	-	-543,001,676.39	576,068,773.42

注：上表统计了本基金交易的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

经分析，若市场利率上升或下降 25 个基准点且其他市场变量保持不变，本基金净资产公允价值不会发生重大变动。

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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、债券、经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，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。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于权益类资产的比例不超过 30%。权益类资产指股票、股票型基金和混合型基金。权益类资产中的混合型基金为满足如下条件之一的基金：基金合同中载明的股票资产占基金资产比例不低于 50% 的混合型基金；最近四个季度定期报告披露的股票资产占基金资产比例不低于 50% 的混合型基金。本基金应保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。

本基金面临的其他价格风险列示如下：

##### 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 2020 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-
交易性金融资产—基金投资	540,895,173.75	93.89
交易性金融资产—债券投资	31,855,221.90	5.53
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	572,750,395.65	99.42

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 假定本基金的业绩比较基准变化 5%，其他变量不变；	
	2. 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；	
	3. 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	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
	量的变动	本期末（2020 年 12 月 31 日）
分析	5%	29,742,767.51
	-5%	-29,742,767.51

注：本基金管理人运用定量分析方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券投资价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.4 采用风险价值法管理风险

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 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

本基金于本报告期末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 540,895,173.75 元,属于第二层次的余额为人民币 31,855,221.90 元,本报告期末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。本基金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。

### 7.4.14.2 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。

### 7.4.14.3 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。

### 7.4.14.4 财务报表的批准

本财务报表已于 2021 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	-	-
	其中:股票	-	-
2	基金投资	540,895,173.75	92.86
3	固定收益投资	31,855,221.90	5.47
	其中:债券	31,855,221.90	5.47
	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	1,208,799.66	0.21
8	其他各项资产	8,554,110.12	1.47
9	合计	582,513,305.43	100.00

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未投资港股通股票。

## 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

本基金本报告期末未持有股票。

## 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末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

## 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	31,855,221.90	5.53
	其中：政策性金融债	31,855,221.90	5.53
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,855,221.90	5.53

## 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	108604	国开 1805	315,930	31,855,221.90	5.53

## 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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 8.12 本报告期投资基金情况

#### 8.12.1 投资政策及风险说明

本基金坚持“自上而下”的资产配置与“自下而上”的基金品种选择相结合，将定性分析与定量分析贯穿于资产配置、基金类型配置、基金品种选择以及组合风险管理全过程中。

本基金为混合型基金中基金，其预期收益和风险高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金和债券型基金中基金，低于股票型基金和股票型基金中基金。

#### 8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	004279	国寿安保稳荣混合A	契约型开放式	63,359,884.14	74,314,808.11	12.90	是
2	004225	国寿安保稳诚混合A	契约型开放式	66,344,422.33	71,817,837.17	12.47	是
3	001932	国寿安保灵活优选混合	契约型开放式	57,344,146.80	71,255,836.81	12.37	是
4	004405	国寿安保稳寿混合A	契约型开放式	46,494,327.69	53,459,177.98	9.28	是



5	004301	国寿安保 稳信混合 A	契约 型开 放式	43,842,534.68	50,502,215.70	8.77	是
6	004258	国寿安保 稳嘉混合 A	契约 型开 放式	40,587,334.42	45,969,214.96	7.98	是
7	004760	国寿安保 稳瑞混合 A	契约 型开 放式	34,331,817.01	42,849,540.81	7.44	是
8	004756	国寿安保 稳吉混合 A	契约 型开 放式	27,213,172.49	31,289,705.73	5.43	是
9	002720	国寿安保 尊利增强 回报债券 A	契约 型开 放式	16,482,106.89	19,251,100.85	3.34	是
10	002148	国寿安保 稳惠混合	契约 型开 放式	8,441,868.58	18,040,273.16	3.13	是
11	000668	国寿安保 尊享债券 A	契约 型开 放式	14,454,835.70	16,897,702.93	2.93	是
12	004318	国寿安保 尊裕优化 回报债券 A	契约 型开 放式	14,885,039.37	15,227,395.28	2.64	是
13	007837	国寿安保 尊耀纯债 债券 A	契约 型开 放式	13,078,106.14	13,792,170.74	2.39	是
14	000931	国寿安保 尊益信用 纯债债券	契约 型开 放式	9,508,415.04	10,174,004.09	1.77	是
15	005683	国寿安保 华兴灵活 配置混合	契约 型开 放式	2,919,651.54	6,054,189.43	1.05	是

### 8.13 投资组合报告附注

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

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体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。

#### 8.13.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,075.47
2	应收证券清算款	2,400,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	390,051.90
5	应收申购款	5,760,982.75
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,554,110.12

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

#### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

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 (%)
2,578	211,816.72	246,089,327.05	45.05	300,212,955.71	54.95

### 9.2 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	142.10	0.00
------------------	--------	------

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理本报告期末未持有本基金。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年8月6日）基金份额总额	498,761,365.23
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	160,780,518.26
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	113,478,376.30
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 （份额减少以“-”填列）	-
本报告期末基金份额总额	546,063,507.19

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大的人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 11.6 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。

### 11.7 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。

## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

## 11.8.1 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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-

注：根据中国证券监督管理委员会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基字[2007]48号）的有关规定要求，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。

### 11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	19,969,010.60	27.75%	67,000,000.00	81.71%	-	-	-	-
国泰君安	31,998,673.55	44.46%	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源	19,999,864.80	27.79%	15,000,000.00	18.29%	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-	-	-

### 11.9 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	关于国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）暂停大额申购和定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 12 月 31 日
2	关于国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）恢复大额申购及定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 12 月 22 日
3	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加广发证券费率优惠活动的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 11 月 17 日
4	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常赎回业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 11 月 6 日

5	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加建设银行费率优惠活动的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 10 月 12 日
6	国寿安保基金管理有限公司关于旗下基金参加中国银行费率优惠活动的公告（全上线基金）	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 9 月 21 日
7	关于国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）暂停大额申购和定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 8 月 27 日
8	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）开放日常申购和定期定额投资业务的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 8 月 12 日
9	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同生效公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 8 月 7 日
10	关于国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）认购申请确认比例结果公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 8 月 5 日
11	关于国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）提前结束募集的公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 8 月 1 日
12	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）招募说明书	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 7 月 22 日
13	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）托管协议	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 7 月 22 日
14	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 7 月 22 日
15	国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金份额发售公告	证券时报、证监会指定网站及公司网站	2020 年 7 月 22 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	1	20200806~20200818	100,780,729.40	-	-	100,780,729.40	18.45

个人	-	-	-	-	-	-
产品特有风险						
<p>本基金在报告期内出现单一投资者持有基金份额达到或超过 20% 的情形,可能存在大额赎回的风险,并导致基金净值波动。此外,机构投资者赎回后,可能导致基金规模大幅减小,不利于基金的正常运作。</p> <p>基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,并将采取有效措施保证中小投资者的合法权益。</p>						

## 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策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）募集的文件

13.1.2 《国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）基金合同》

13.1.3 《国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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 报告期内国寿安保策略优选 3 个月持有期混合型基金中基金（FOF）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.gs-funds.com.cn](http://www.gs-funds.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

2021 年 3 月 31 日