

国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式
指数证券投资基金
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：国寿安保基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	国寿安保中证沪港深 300ETF
场内简称	AH300ETF
基金主代码	517300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 2 月 4 日
报告期末基金份额总额	2,868,434,450.00 份
投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
投资策略	<p>本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。</p> <p>1、组合复制策略</p> <p>本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。</p> <p>2、替代性策略</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p>

业绩比较基准	中证沪港深 300 指数。
风险收益特征	本基金为股票型指数基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数、标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资标的包括港股通投资标的股票，还需承担汇率风险和港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。
基金管理人	国寿安保基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日）
1. 本期已实现收益	15,615,095.09
2. 本期利润	-76,551,058.05
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0267
4. 期末基金资产净值	1,942,593,416.39
5. 期末基金份额净值	0.6772

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。

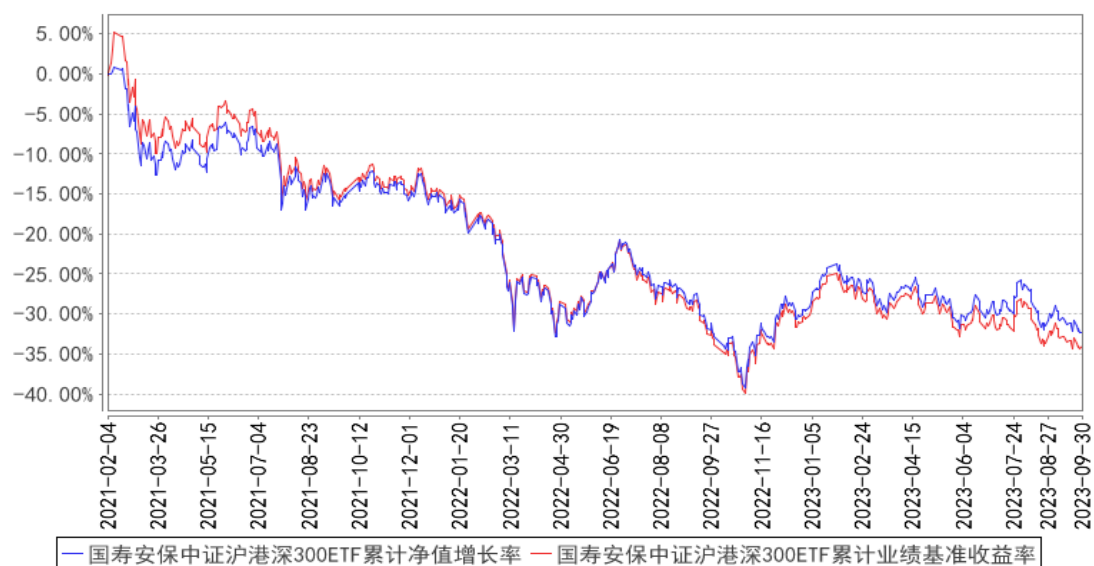
3.2 基金净值表现

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	净值增长率 ①	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	-3.81%	0.94%	-4.09%	0.94%	0.28%	0.00%
过去六个月	-6.95%	0.90%	-8.04%	0.89%	1.09%	0.01%
过去一年	0.86%	1.07%	-0.40%	1.05%	1.26%	0.02%
自基金合同 生效起至今	-32.28%	1.16%	-34.06%	1.16%	1.78%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

国寿安保中证沪港深300ETF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 2021 年 02 月 04 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。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 2021 年 02 月 04 日至 2023 年 09 月 30 日。

3.3 其他指标

无。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2021 年 2 月 4 日	-	13 年	博士研究生，曾任中国国际金融有限公司量化投资研究员、长盛基金管理有限公司金融工程研究员。2013 年 11 月加入国寿安保基金管理有限公司，历任基金经理助理、基金经理，现任国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、国寿安保中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保国证创业板中盘精选 88 交易型开放式指数证券投资基金、国寿安保稳丰 6 个月持有期混合型证券投资基金、国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金和国寿安保中证沪港深 300 交易型开放

					式指数证券投资基金联接基金和国寿安保稳泽两年持有期混合型证券投资基金基金经理。
苏天醒	本基金的基金经理	2021 年 3 月 1 日	-	12 年	硕士，2010 年 3 月至 2012 年 11 月任中国国际金融有限公司研究员；2013 年 2 月至 2014 年 6 月任新华资产管理股份有限公司交易员；2014 年 6 月至 2015 年 5 月任宁波灵均投资管理合伙企业（有限合伙）投资交易总监；2015 年 5 月加入国寿安保基金管理有限公司任基金经理助理，现任国寿安保中证沪港深 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 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金和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

报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《国寿安保中证沪港深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运作基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，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 公平交易专项说明

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 报告期内基金的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日常申赎和市场波动等因素引起的成份股权重偏离。汇率波动、港股交易备付金、股票停牌和成分股调整等因素，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。

4.5 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 0.6772 元；本报告期基金份额净值增长率为 -3.81%，业绩比较基准收益率为 -4.09%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,909,589,954.76	98.24
	其中：股票	1,909,589,954.76	98.24
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	33,130,139.51	1.70
8	其他资产	1,176,037.94	0.06
9	合计	1,943,896,132.21	100.00

注：1. 上述表权益投资中通过港股通交易机制投资的港股金额为人民币 447,670,568.16 元，占基金净资产的比例为 23.04%。

2. 通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 10,961,730.00 元，占基金资产净值的比例为 0.56%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	17,575,061.09	0.90
B	采矿业	64,260,479.89	3.31
C	制造业	794,780,012.79	40.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,900,898.00	2.16
E	建筑业	33,752,204.40	1.74
F	批发和零售业	3,349,632.00	0.17
G	交通运输、仓储和邮政业	44,115,468.19	2.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	63,644,286.40	3.28
J	金融业	333,692,357.82	17.18
K	房地产业	19,768,542.00	1.02
L	租赁和商务服务业	15,868,784.00	0.82
M	科学研究和技术服务业	21,632,345.30	1.11
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	7,579,314.72	0.39
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,461,919,386.60	75.26

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
基础材料	708,644.36	0.04
消费者非必需品	72,474,879.90	3.73
消费者常用品	17,720,130.40	0.91
能源	19,740,125.39	1.02
金融	159,072,119.44	8.19
医疗保健	15,585,534.46	0.80
工业	13,941,048.82	0.72
信息技术	16,175,209.91	0.83
电信服务	96,786,918.73	4.98
公用事业	12,722,560.52	0.65
地产建筑业	22,743,396.23	1.17
合计	447,670,568.16	23.04

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

5.3 报告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前十名股票投资 明细

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	600519	贵州茅台	56,800	102,157,640.00	5.26
2	00700	腾讯控股	257,000	70,136,112.63	3.61
3	601318	中国平安	978,300	47,251,890.00	2.43
3	02318	中国平安	285,000	11,507,080.20	0.59
4	300750	宁德时代	238,084	48,338,194.52	2.49
5	00005	汇丰控股	774,400	43,063,127.92	2.22
6	600036	招商银行	1,118,000	36,860,460.00	1.90
6	03968	招商银行	176,000	5,264,993.89	0.27
7	002594	比亚迪	81,800	19,362,060.00	1.00
7	01211	比亚迪股份	42,000	9,057,008.10	0.47
8	000858	五粮液	175,159	27,342,319.90	1.41
9	00941	中国移动	313,000	18,798,430.54	0.97
9	600941	中国移动	81,500	7,890,830.00	0.41
10	601398	工商银行	3,163,500	14,805,180.00	0.76
10	01398	工商银行	3,325,000	11,289,143.08	0.58

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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投资股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未投资国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本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、中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方国税局的处罚；招商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到金融监督管理局的处罚；招商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行分支行的处罚；招商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会或其派出机构的处罚；招商银行股份有限公司、中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会或其派出机构的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监察委员会的处罚；招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到银行间市场交易商协会的处罚；中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方市场监督管理局的处罚；中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家外汇管理局的处罚；中国工商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到综合行政执法局的处罚。中国工商银行股份有限公司本期内被纪委立案调查；中国工商银行股份有限公司本期内被监察委员会立案调查。

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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,932.37
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	1,149,378.83
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	7,726.74
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,176,037.94

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	2,880,434,450.00
报告期期间基金总申购份额	-
减：报告期期间基金总赎回份额	12,000,000.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	2,868,434,450.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

报告期内基金管理人未投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20230701~20230930	1,820,000,000.00	0.00	0.00	1,820,000,000.00	63.45
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>							

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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

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

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

9.1.4 基金管理人业务资格批件、营业执照

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

9.1.6 中国证监会要求的其他文件

9.2 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

9.3 查阅方式

9.3.1 营业时间内到本公司免费查阅

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

9.3.3 拨打本公司客户服务电话垂询: 4009-258-258

国寿安保基金管理有限公司

2023 年 10 月 25 日